

**Nordea**

Geprüfter Jahresbericht 2021

**Nordea 1, SICAV**

Société d'Investissement à Capital Variable  
à compartiments multiples

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

562, rue de Neudorf  
L-2220 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg  
HR Nummer: Luxemburg B-31442

**Für die folgenden Teilfonds von Nordea 1, SICAV wurde keine Anzeige zur Zulassung zum Vertrieb in der Bundesrepublik Deutschland erstattet und Aktien dieser Teilfonds dürfen an Anleger im Geltungsbereich des deutschen Kapitalanlagegesetzbuches („KAGB“) NICHT vertrieben werden. Die folgenden Teilfonds sind daher für Anleger in Deutschland NICHT verfügbar:**

- **Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund**

---

Zeichnungen können nicht auf Grundlage der Jahres- und Halbjahresberichte angenommen werden. Zeichnungen sind nur gültig auf Basis des aktuellen Prospekts zusammen mit dem neuesten Jahresbericht und dem neuesten Halbjahresbericht, sofern dieser später veröffentlicht wurde.

Diese übersetzte Fassung des Abschlusses wurde auf Grundlage der englischen Fassung erstellt. Im Falle von Auslegungsdifferenzen zwischen der übersetzten und der englischen Fassung, ist die englische Fassung maßgeblich.

---

# Inhalt

|  |     |
|--|-----|
| Bericht des Verwaltungsrates   | 3   |
| Erklärung zur Unternehmensführung  | 7   |
| Bericht des Abschlussprüfers   | 8   |
| Nettvermögensaufstellung per 31.12.2021  | 12  |
| Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettvermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021 | 32  |
| Statische Angaben zum 31.12.2021   | 54  |
| Total Expense Ratios   | 78  |
| Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettvermögenswerte per 31.12.2021,                     |     |
| Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 und                     |     |
| Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente per 31.12.2021   |     |
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund   | 98  |
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund  | 108 |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund  | 120 |
| Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund   | 132 |
| Nordea 1 - Asian Stars Equity Fund   | 135 |
| Nordea 1 - Balanced Income Fund  | 137 |
| Nordea 1 - Chinese Bond Fund (vormals Nordea 1 - Renminbi Bond Fund)                                 | 148 |
| Nordea 1 - Chinese Equity Fund   | 151 |
| Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund  | 153 |
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund  | 160 |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund   | 165 |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund   | 172 |
| Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund   | 179 |
| Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund   | 184 |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund  | 192 |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund  | 201 |
| Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund  | 204 |
| Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund   | 210 |
| Nordea 1 - European Corporate Bond Fund  | 213 |
| Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund  | 220 |
| Nordea 1 - European Covered Bond Fund  | 226 |
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund  | 234 |
| Nordea 1 - European Cross Credit Fund  | 242 |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund  | 246 |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund   | 251 |
| Nordea 1 - European High Yield Credit Fund   | 256 |
| Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund   | 261 |
| Nordea 1 - European Inflation Linked Bond Fund   | 265 |
| Nordea 1 - European Small and Mid Cap Equity Fund  | 267 |
| Nordea 1 - European Stars Equity Fund  | 269 |
| Nordea 1 - Flexible Credit Fund  | 272 |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund  | 277 |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund   | 287 |
| Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund   | 296 |
| Nordea 1 - Global Bond Fund  | 304 |
| Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund   | 309 |
| Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund   | 312 |
| Nordea 1 - Global Disruption Fund  | 315 |
| Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund   | 317 |
| Nordea 1 - Global Gender Diversity Fund  | 322 |
| Nordea 1 - Global Green Bond Fund  | 324 |
| Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund   | 329 |
| Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund   | 336 |
| Nordea 1 - Global Opportunity Fund   | 339 |
| Nordea 1 - Global Portfolio Fund   | 342 |
| Nordea 1 - Global Real Estate Fund   | 344 |
| Nordea 1 - Global Small Cap Fund   | 346 |
| Nordea 1 - Global Social Empowerment Fund (vormals Nordea 1 - Global Impact Fund)                    | 348 |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund   | 350 |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged   | 353 |
| Nordea 1 - Global Stars Equity Fund  | 356 |

# Inhalt (Fortsetzung)

|  |     |
|--|-----|
| Nordea 1 - Indian Equity Fund  | 359 |
| Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged                     | 361 |
| Nordea 1 - Latin American Equity Fund  | 369 |
| Nordea 1 - Long Duration US Bond Fund  | 372 |
| Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund                             | 374 |
| Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund                                | 382 |
| Nordea 1 - Nordic Equity Fund  | 386 |
| Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund  | 388 |
| Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund  | 392 |
| Nordea 1 - Nordic Stars Equity Fund  | 394 |
| Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund                                 | 396 |
| Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund                           | 405 |
| Nordea 1 - North American Small Cap Fund                                       | 411 |
| Nordea 1 - North American Stars Equity Fund                                    | 414 |
| Nordea 1 - North American Value Fund   | 417 |
| Nordea 1 - Norwegian Bond Fund   | 420 |
| Nordea 1 - Norwegian Equity Fund   | 424 |
| Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund                                      | 426 |
| Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund                                 | 429 |
| Nordea 1 - Stable Return Fund  | 432 |
| Nordea 1 - Swedish Bond Fund   | 441 |
| Nordea 1 - Swedish Short-Term Bond Fund  | 444 |
| Nordea 1 - US Corporate Bond Fund  | 446 |
| Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund  | 451 |
| Nordea 1 - US High Yield Bond Fund   | 457 |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund   | 463 |
| Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021                                       | 468 |
| Informationen für die Anteilsinhaber   | 485 |
| Angaben zur Risikotransparenz (ungeprüft)                                      | 485 |
| Angaben zur Vergütung (ungeprüft)  | 488 |
| Angaben gemäß der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) | 489 |
| Angaben gemäß der Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)                    | 492 |
| Organisation   | 495 |
| Verwaltung   | 498 |
| Berechtigung zum öffentlichen Vertrieb   | 498 |
| Vertreter, Zahl- und Informationsstellen außerhalb Luxemburgs                  | 499 |
| Abschlussprüfer  | 501 |

# Bericht des Verwaltungsrates

## Bericht des Vorsitzenden

Im Jahr 2021 bestanden die pandemiebedingten Herausforderungen und außergewöhnlichen Umstände nicht nur für Nordea 1, SICAV (die „Gesellschaft“), sondern auch auf globaler und persönlicher Ebene für viele Unternehmen und Menschen fort. Infolge zu geringer Investitionen, der hohen Nachfrage sowie der Pandemieauswirkungen und Überbestellungen in Erwartung von Lieferverzögerungen entstanden Lieferkettenprobleme. Die Konkurrenz durch Unternehmen wie Amazon zog höhere Gehaltsforderungen nach sich. Unter dem Strich führten all diese Faktoren dazu, dass die Inflation weltweit anzog, wozu auch die deutliche Erholung der Ölpreise aufgrund der Drosselung der Fördermengen durch die OPEC beitrug. Die US Federal Reserve wurde offenbar vom Preisauftrieb überrascht, und da erwartet wurde, dass sie ihre Geldpolitik strafft, verbuchten US-Aktien eine uneinheitliche Performance, während der Dollar im November und Dezember angesichts höherer US-Zinsen aufwertete. In Anbetracht der Inflation beschloss die Europäische Zentralbank Ende 2021, ihr Pandemie-Notfallankaufprogramm (PEPP) im März 2022 auslaufen zu lassen. Allerdings nahm sie weiterhin eine weniger aggressive Haltung ein als die Federal Reserve. Dies hatte mehrere Gründe:

- die Inflation zog in Europa nicht so stark an wie in den USA;
- klare Anzeichen für eine Lohn-Preis-Spirale waren in Europa nicht auszumachen, wenngleich in einigen Sektoren wie beispielsweise der Freizeitbranche, in der Covid-19 Anlass zu erheblichen Sorgen gibt, Hinweise auf einen Arbeitskräftemangel erkennbar sind;
- und schließlich dürfte die EZB gehofft haben, dass die Abschwächung in China und die Maßnahmen der Federal Reserve ausreichen, um die Lieferkettenstörungen allmählich zu beseitigen, wofür es Ende Dezember 2021 tatsächlich erste Anzeichen gab. In diesem Zeitraum beendete der MSCI Europe seine Underperformance gegenüber den USA. Die nordischen Indizes verzeichneten hingegen eine Outperformance, die zum Teil der Qualität ihrer Unternehmen zu verdanken war.

Das chinesische Wirtschaftswachstum zog zunächst stetig an, schwächte sich dann aber aufgrund des schwächeren Konsums und der sich abzeichnenden Immobilienkrise deutlicher ab als erwartet. Dies hatte eine starke Underperformance chinesischer Aktien zur Folge.

Nach einem erfreulichen Ende des Jahres 2020 setzte sich der positive Trend für die Gesellschaft im Jahr 2021 mit neuen Rekordständen beim verwalteten Vermögen (AuM) Monat für Monat fort. Bei der globalen Wirtschaftsaktivität setzte 2021 eine leichte Verlangsamung ein, da das geringe Angebot - wie bereits ausgeführt - nicht mit der hohen Nachfrage Schritt halten konnte und in mehreren Lieferketten Engpässe entstanden. Mit dem Aufkommen der Covid-19-Varianten Delta und Omikron wurden weltweit weitere Gesundheitsmaßnahmen ergriffen, die eine Belastung für die Wirtschaftstätigkeit darstellten. Die Gesellschaft verzeichnete dennoch weiterhin außergewöhnlich hohe Zuflüsse, die sich lediglich im September leicht abschwächten, und beendete das Jahr mit einem verwalteten Vermögen von 92,6 Mrd. EUR, das einen neuen Rekord in der Geschichte der Gesellschaft darstellt. Im Vergleich dazu belief sich das verwaltete Vermögen Ende 2020 auf 75,6 Mrd. EUR. Auch der Gesamtbetrag der Nettomittelflüsse von Nordea 1, SICAV in Höhe von beinahe 9,1 Mrd. EUR Ende 2021 verdeutlicht das hervorragende Jahresergebnis.

Das Vermögen verteilt sich auf 77 Teilfonds, von denen der für Neukunden geschlossene Global Climate and Environment Fund mit einem verwalteten Vermögen von 11,4 Mrd. EUR der größte ist und nunmehr vor dem Stable Return Fund rangiert. Die Schließung des Teilfonds für Neukunden (Soft Closure) erfolgte am 27. Januar 2021, wobei die Mittelflüsse im Jahresverlauf anhielten und keinerlei Probleme auftraten. Der Stable Return Fund ist derzeit der zweitgrößte Teilfonds. Er wies Ende 2021 ein verwaltetes Vermögen von 7,7 Mrd. EUR auf. Der Teilfonds verzeichnete während der Covid-19-Pandemie Kapitalabflüsse. Mittlerweile kam es jedoch zu einer Stabilisierung, und 2021 setzten wieder Zuflüsse ein. Andere Teilfonds konnten aufgrund ihrer starken Performance ebenfalls bemerkenswerte Kapitalflüsse anziehen. Erwähnenswert sind in erster Linie die Teilfonds, die ESG- und Nachhaltigkeitsaspekte berücksichtigen, wobei sich nicht nur der der Global Climate and Environment Fund gut entwickelte, sondern auch andere Teilfonds wie der Emerging Market Stars Equity Fund. Alles in allem fiel die Nachfrage nach ESG- und Nachhaltigkeitsprodukten im Jahr 2021 ungebrochen stark aus.

Die Erfolgsstory europäischer Covered-Bond-Strategien setzte sich ebenfalls fort, und unser Low Duration European Covered Bond Fund verzeichnete weiterhin starke Mittelflüsse. Dieser Teilfonds ist mittlerweile der drittgrößte von Nordea 1, SICAV und rangiert mit einem verwalteten Vermögen von 7,6 Mrd. EUR nunmehr nur knapp hinter dem Stable Return Fund.

Darüber hinaus verbuchte auch das Multi-Asset-Segment, so etwa der Alpha 10 MA Fund, hohe Mittelflüsse und eine starke Performance. Die Vielfalt unseres Produktspektrums, auch jenseits der ESG-, Multi-Asset- und Covered-Bond-Segmente, sowie die starke Wertentwicklung und kräftigen Mittelflüsse in unserem gesamten Fondsuniversum verdeutlichen, dass wir unseren Anteilsinhabern äußerst wettbewerbsstarke Lösungen bieten können.

Auf der Jahreshauptversammlung der Anteilsinhaber wird der Verwaltungsrat für das Geschäftsjahr 2021 die Ausschüttung folgender Dividenden durch die Nordea 1, SICAV vorschlagen:

| Name des Teilfonds                          | Anteilsklasse | Währung (*) | Betrag je Anteil |
|---|---------------|-------------|------------------|
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund                  | AC            | EUR         | 1,4820           |
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund                  | AI            | EUR         | 1,3604           |
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund                  | AP            | EUR         | 1,4495           |
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                 | AC            | EUR         | 0,2409           |
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                 | AP            | EUR         | 0,2328           |
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                 | HAX - GBP     | EUR         | 0,2657           |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund                 | AC            | EUR         | 1,9667           |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund                 | AI            | EUR         | 2,1970           |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund                 | AP            | EUR         | 1,9370           |
| Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund        | AP            | USD         | 0,5995           |
| Nordea 1 - Balanced Income Fund             | AP            | EUR         | 2,0177           |
| Nordea 1 - Chinese Bond Fund (Anmerkung 1c) | AP            | CNH         | 3,3917           |
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund         | AI            | DKK         | 2,1624           |
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund         | AP            | DKK         | 1,7974           |

# Bericht des Verwaltungsrates (Fortsetzung)

| Name des Teilfonds                                    | Anteilsklasse | Währung (*) | Betrag je Anteil |
|---|---------------|-------------|------------------|
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund                   | HAC - EUR     | DKK         | 2,5912           |
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund                   | HAI - EUR     | DKK         | 1,9586           |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund                  | AC            | USD         | 6,6620           |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund                  | AI            | USD         | 5,8974           |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund                  | AP            | USD         | 5,7868           |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund                  | HAC - EUR     | USD         | 6,1281           |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund                  | HA - EUR      | USD         | 5,5763           |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund                  | HAI - EUR     | USD         | 4,7761           |
| Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund        | AP            | USD         | 5,2326           |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund                   | AI            | USD         | 4,8629           |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund                   | AP            | USD         | 4,7267           |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund                   | HAF - SEK     | USD         | 4,7616           |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund                   | HAI - GBP     | USD         | 5,3500           |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund                 | AC            | USD         | 2,6345           |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund                 | AF            | USD         | 3,0855           |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund                 | AI            | USD         | 2,7695           |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund                 | AP            | USD         | 2,6226           |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund                 | JI            | USD         | 4,7875           |
| Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund (Anmerkung 1b) | AI            | EUR         | 0,1783           |
| Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund         | AP            | EUR         | 1,1699           |
| Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund         | HAF - SEK     | EUR         | 1,1643           |
| Nordea 1 - European Covered Bond Fund                 | AC            | EUR         | 0,1006           |
| Nordea 1 - European Covered Bond Fund                 | AI            | EUR         | 0,1079           |
| Nordea 1 - European Covered Bond Fund                 | AP            | EUR         | 0,0999           |
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund   | AC            | EUR         | 1,4967           |
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund   | AI            | EUR         | 0,5802           |
| Nordea 1 - European Cross Credit Fund                 | AC            | EUR         | 2,8452           |
| Nordea 1 - European Cross Credit Fund                 | AI            | EUR         | 2,7629           |
| Nordea 1 - European Cross Credit Fund                 | AP            | EUR         | 2,6998           |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund               | AD            | EUR         | 6,0459           |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund               | AI            | EUR         | 6,2478           |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund               | AP            | EUR         | 5,6534           |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund              | AC            | EUR         | 0,4335           |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund              | AI            | EUR         | 0,4646           |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund              | AP            | EUR         | 0,6582           |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund              | HAC - GBP     | EUR         | 0,3876           |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund              | HAC - USD     | EUR         | 0,5337           |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund              | HA - GBP      | EUR         | 0,4411           |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund              | HAI - GBP     | EUR         | 0,4493           |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund              | HAI - USD     | EUR         | 0,5543           |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund              | HA - USD      | EUR         | 0,5424           |
| Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund        | AI            | EUR         | 4,7477           |
| Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund        | AP            | EUR         | 4,2432           |
| Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund        | HAF - SEK     | EUR         | 4,4672           |
| Nordea 1 - European Small and Mid Cap Equity Fund     | AP            | EUR         | 15,1702          |
| Nordea 1 - European Stars Equity Fund                 | AC            | EUR         | 2,6891           |
| Nordea 1 - European Stars Equity Fund                 | AF            | EUR         | 0,0015           |
| Nordea 1 - European Stars Equity Fund                 | AP            | EUR         | 2,6875           |
| Nordea 1 - Flexible Credit Fund (Anmerkung 1b)        | AF            | EUR         | 2,0242           |
| Nordea 1 - Flexible Credit Fund (Anmerkung 1b)        | AZ            | EUR         | 1,0443           |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund                 | AC            | EUR         | 2,1282           |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund                 | AI            | EUR         | 2,1117           |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund                 | AP            | EUR         | 2,0322           |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund                 | HA - USD      | EUR         | 2,2114           |
| Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund                | AI            | GBP         | 1,8973           |
| Nordea 1 - Global Bond Fund                           | AP            | EUR         | 0,2228           |
| Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund        | AC            | EUR         | 0,2668           |
| Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund        | AI            | EUR         | 0,2880           |
| Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund        | AP            | EUR         | 0,2581           |
| Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund        | JI            | EUR         | 0,7410           |

# Bericht des Verwaltungsrates (Fortsetzung)

| Name des Teilfonds  | Anteilsklasse | Währung (*) | Betrag je Anteil |
|---|---------------|-------------|------------------|
| Nordea 1 - Global Disruption Fund                                   | AP            | USD         | 0,8071           |
| Nordea 1 - Global Gender Diversity Fund                             | AP            | USD         | 2,1580           |
| Nordea 1 - Global Green Bond Fund (Anmerkung 1a)                    | AQ            | EUR         | 0,9291           |
| Nordea 1 - Global Green Bond Fund (Anmerkung 1a)                    | HAQ - SEK     | EUR         | 0,9195           |
| Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund                              | AP            | USD         | 0,9723           |
| Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund                        | AI            | USD         | 0,4138           |
| Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund                        | AP            | USD         | 0,3483           |
| Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund                        | HAI - EUR     | USD         | 0,3894           |
| Nordea 1 - Global Opportunity Fund                                  | AI            | EUR         | 0,2585           |
| Nordea 1 - Global Real Estate Fund                                  | AP            | USD         | 4,6185           |
| Nordea 1 - Global Real Estate Fund                                  | JI            | USD         | 4,0678           |
| Nordea 1 - Global Social Empowerment Fund (Anmerkung 1c)            | AP            | USD         | 0,9698           |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund                                | AC            | EUR         | 0,4747           |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund                                | AI            | EUR         | 0,5173           |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund                                | AP            | EUR         | 0,4655           |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged                  | AI            | EUR         | 0,3973           |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged                  | AP            | EUR         | 0,3530           |
| Nordea 1 - Global Stars Equity Fund                                 | AF            | USD         | 2,6331           |
| Nordea 1 - Global Stars Equity Fund                                 | AP            | USD         | 2,4882           |
| Nordea 1 - Global Stars Equity Fund                                 | HA - EUR      | USD         | 2,6499           |
| Nordea 1 - Latin American Equity Fund                               | AP            | EUR         | 0,5988           |
| Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund                  | AC            | EUR         | 0,3690           |
| Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund                  | AI            | EUR         | 0,6756           |
| Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund                  | AP            | EUR         | 0,6768           |
| Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund                  | HAI - GBP     | EUR         | 0,7019           |
| Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund                     | AC            | USD         | 0,4593           |
| Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund                     | AP            | USD         | 0,4439           |
| Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund                     | HAC - EUR     | USD         | 0,4292           |
| Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund                     | HA - EUR      | USD         | 0,3631           |
| Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund                     | HAI - EUR     | USD         | 0,3103           |
| Nordea 1 - Nordic Equity Fund                                       | AC            | EUR         | 0,5840           |
| Nordea 1 - Nordic Equity Fund                                       | AP            | EUR         | 2,7127           |
| Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund                             | AP            | EUR         | 0,5447           |
| Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund                                 | AI            | EUR         | 5,8034           |
| Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund                                 | AP            | EUR         | 5,5608           |
| Nordea 1 - Nordic Stars Equity Fund                                 | AF            | EUR         | 0,0549           |
| Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund (Anmerkung 1a) | HAF - SEK     | USD         | 5,4362           |
| Nordea 1 - North American Small Cap Fund                            | AP            | USD         | 1,1669           |
| Nordea 1 - North American Stars Equity Fund                         | AF            | USD         | 0,3041           |
| Nordea 1 - North American Stars Equity Fund                         | AI            | USD         | 2,6935           |
| Nordea 1 - North American Stars Equity Fund                         | AP            | USD         | 2,3042           |
| Nordea 1 - North American Stars Equity Fund                         | HA - EUR      | USD         | 1,8787           |
| Nordea 1 - North American Value Fund                                | AP            | USD         | 0,7102           |
| Nordea 1 - North American Value Fund                                | HA - EUR      | USD         | 0,5402           |
| Nordea 1 - Norwegian Bond Fund                                      | AC            | NOK         | 2,4917           |
| Nordea 1 - Norwegian Bond Fund                                      | AP            | NOK         | 2,3588           |
| Nordea 1 - Norwegian Equity Fund                                    | AP            | NOK         | 12,7003          |
| Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund                           | AC            | NOK         | 2,3814           |
| Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund                           | AP            | NOK         | 1,2205           |
| Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund                      | AX            | USD         | 2,2786           |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                                       | AC            | EUR         | 0,2588           |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                                       | AI            | EUR         | 0,2973           |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                                       | AP            | EUR         | 0,2531           |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                                       | HAC - GBP     | EUR         | 0,2772           |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                                       | HAI - GBP     | EUR         | 0,2848           |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                                       | HAI - USD     | EUR         | 0,3122           |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                                       | HA - NOK      | EUR         | 0,2710           |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                                       | HAX - CAD     | EUR         | 0,1815           |
| Nordea 1 - Swedish Bond Fund  | AC            | SEK         | 1,1993           |
| Nordea 1 - Swedish Bond Fund  | AP            | SEK         | 1,1157           |

# Bericht des Verwaltungsrates (Fortsetzung)

| Name des Teilfonds                                     | Anteilsklasse | Währung (*) | Betrag je Anteil |
|--|---------------|-------------|------------------|
| Nordea 1 - Swedish Short-Term Bond Fund                | AP            | SEK         | 1,9500           |
| Nordea 1 - US Corporate Bond Fund                      | AI            | USD         | 0,4658           |
| Nordea 1 - US Corporate Bond Fund                      | AP            | USD         | 0,4547           |
| Nordea 1 - US Corporate Bond Fund                      | HA - EUR      | USD         | 0,4553           |
| Nordea 1 - US Corporate Bond Fund                      | HAI - EUR     | USD         | 0,3157           |
| Nordea 1 - US Corporate Bond Fund                      | HAI - GBP     | USD         | 0,3373           |
| Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund (Anmerkung 1a) | HAF - SEK     | USD         | 3,5554           |
| Nordea 1 - US High Yield Bond Fund                     | AI            | USD         | 0,6765           |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | AC            | USD         | 4,4391           |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | AD            | USD         | 4,5473           |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | AI            | USD         | 4,4337           |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | AP            | USD         | 4,3463           |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | HAD - EUR     | USD         | 4,1912           |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | HAD - GBP     | USD         | 4,5028           |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | HA - EUR      | USD         | 3,5268           |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | HA - GBP      | USD         | 3,6264           |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | HAI - EUR     | USD         | 3,6598           |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | HAI - GBP     | USD         | 3,6697           |

(\*) Die Dividendenbeträge sind in der Basiswährung des jeweiligen Teilfonds angegeben und werden am Ex-Tag in die Währung der jeweiligen Anteilsklasse umgerechnet.

In Bezug auf die aktuelle Ukraine-Krise behalten wir auf Ebene des Verwaltungsrats und des breiteren Nordea Asset-Managements die Eskalation des Konflikts zwischen Russland und der Ukraine genau im Blick und sind bestrebt, unsere von der Entwicklung der Lage in Mitleidenschaft gezogenen Anteilhaberinnen und Anteilhaber zu unterstützen. Wir achten auf neue Sanktionsvorschriften und stellen sicher, dass sie im Interesse unserer Anteilhaberinnen und Anteilhaber angemessen und rechtzeitig eingehalten werden.

Der Verwaltungsrat möchte wieder allen an der Funktionsweise der Nordea 1, SICAV beteiligten Interessensträgern für die Unterstützung im Jahr 2021 danken. In diesem motivierten und engagierten Umfeld freuen wir uns darauf, auch 2022 die bestmöglichen Leistungen für unsere Anteilhaberinnen und Anteilhaber zu erbringen.

16. März 2022

Claude Kremer, Vorsitzender

Bei den Angaben in diesem Bericht handelt es sich um historische Informationen, die für künftige Ergebnisse nicht repräsentativ sind.



# Erklärung zur Unternehmensführung

## Einleitung

Nordea 1, SICAV (hierin nachfolgend die „Gesellschaft“) wurde von der luxemburgischen Finanzaufsicht (Commission de Surveillance du Secteur Financier, „CSSF“) als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) zugelassen. Die Gesellschaft beachtet die Grundsätze guter Unternehmensführung des überarbeiteten Verhaltenskodex 2013, der im Juni 2013 vom Luxemburger Fondsverband (Association of the Luxembourg Fund Industry, „ALFI“) herausgegeben wurde. Der Verwaltungsrat der Gesellschaft (der „Verwaltungsrat“) ist der Wahrung höchster Standards der Unternehmensführung verpflichtet und den Anteilsinhaberinnen und Anteilsinhabern gegenüber für die Führung der Gesellschaftsangelegenheiten verantwortlich. Diese Erklärung fasst die Struktur und die Verfahren der Unternehmensführung zusammen, die im Berichtszeitraum für die Gesellschaft bestanden.

## Zusammensetzung des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat setzt sich derzeit aus fünf Verwaltungsratsmitgliedern (darunter drei unabhängige Verwaltungsratsmitglieder) zusammen. Der Verwaltungsrat ist der Wahrung eines angemessenen Gleichgewichts zwischen der Kompetenz, Erfahrung, Unabhängigkeit und dem Wissen seiner Mitglieder verpflichtet. Die Satzung der Gesellschaft (die „Satzung“) sieht gemäß Luxemburger Recht vor, dass die Verwaltungsratsmitglieder von den Anteilsinhaberinnen und Anteilsinhabern bei ihrer Jahreshauptversammlung gewählt und von der CSSF genehmigt werden müssen. Die Verwaltungsratsmitglieder bleiben bis zum Ende ihrer Amtszeit, bis zu ihrem Rücktritt oder bis zu ihrer Abberufung im Amt.

Die Mitglieder des Verwaltungsrats beginnen auf Verlangen des Verwaltungsrats baldmöglichst nach ihrer Bestellung ein Einarbeitungsprogramm. Der jeweils amtierende Verwaltungsrat gibt alle zwei Jahre eine Selbstbeurteilung seiner Arbeit ab, um seine Arbeitsmethoden weiterzuentwickeln und seine Effizienz zu steigern.

## Verantwortung des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat tagt vierteljährlich und bei Bedarf ad hoc. Der Verwaltungsrat wird zeitnah mit Informationen versorgt.

Der Verwaltungsrat ist für die generelle Anlagepolitik, die Anlageziele und die Verwaltung der Gesellschaft verantwortlich und verfügt, wie in der Satzung näher beschrieben, über umfassende Vollmachten, um im Auftrag der Gesellschaft zu handeln, und hat unter anderem folgende Befugnisse:

- Bestellung und Beaufsichtigung der Verwaltungsgesellschaft;
- Festlegung der Anlagepolitik und Genehmigung der Bestellung von Anlageverwaltern oder Unteranlageverwaltern;
- Beschlussfassung über die Errichtung/Auflegung, Änderung, Verschmelzung oder Auflösung der Gesellschaft und einzelner Anteilklassen, was Entscheidungen über Belange wie Zeitpunkt, Preisfestsetzung, Gebühren, Basiswährung, Dividendenpolitik und Dividendenausschüttung, Liquidation der Gesellschaft und sonstige Bedingungen einschließt;
- Festlegung der Berechtigungsvoraussetzungen und Eigentumsbeschränkungen für Anleger oder Anteilklassen sowie der im Falle eines Verstoßes zu ergreifenden Schritte;
- Festlegung der Verfügbarkeit von Anteilklassen für einen Anleger oder eine Vertriebsstelle oder in einer Rechtsordnung;
- Festlegung, wann und wie die Gesellschaft ihre Rechte ausübt und Mitteilungen an die Anteilsinhaberinnen und Anteilsinhaber verbreitet oder veröffentlicht;
- Gewährleistung, dass die Bestellung der Verwaltungsgesellschaft und der Verwahrstelle im Einklang mit dem Gesetz von 2010 und den geltenden Verträgen der Gesellschaft erfolgt;
- Entscheidung über die Notierung von Anteilen an der Börse in Luxemburg.

Der Verwaltungsrat kann diese Verantwortlichkeiten teilweise an die Verwaltungsgesellschaft übertragen.

## Vergütung des Verwaltungsrats

Die Gesellschaft zahlt den unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern eine Gesamtvergütung in Höhe von 100.000 EUR brutto p.a., ohne eine gegebenenfalls anfallende Luxemburger Mehrwertsteuer, vorbehaltlich der Genehmigung durch die Anteilsinhaberinnen und Anteilsinhaber bei der Jahreshauptversammlung, die auch Gegenstand der Mitteilung „Genehmigung der Gebühren der Verwaltungsratsmitglieder“ ist. Die Vertreter von Nordea erhalten für ihr Verwaltungsratsmandat keine Vergütung.

## **BERICHT DES ABSCHLUSSPRÜFERS**

An die Anteilshaberinnen und Anteilshaber von  
Nordea 1, SICAV

---

### *Unser Bestätigungsvermerk*

Unseres Erachtens vermittelt der beiliegende Abschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Finanzlage von Nordea 1, SICAV (der „Fonds“) und aller Teilfonds per 31. Dezember 2021 sowie der Ergebnisse der Geschäftstätigkeit und der Entwicklung des Nettovermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr im Einklang mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen an die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen.

### **Gegenstand unserer Prüfung**

Der Abschluss des Fonds umfasst:

- die Nettovermögensaufstellung per 31. Dezember 2021;
- die Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das zu diesem Zeitpunkt beendete Geschäftsjahr;
- die Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31. Dezember 2021;
- die Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente per 31. Dezember 2021 und
- die Anmerkungen zum Abschluss, die eine Zusammenfassung der wichtigen Grundsätze der Rechnungslegung umfassen.

---

### *Grundlage für die Prüfungsurteile*

Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über den Beruf des Abschlussprüfers (Gesetz vom 23. Juli 2016) unter Beachtung der von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) für Luxemburg übernommenen International Standards on Auditing (ISA) durchgeführt. Unsere Verantwortung nach dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den für Luxemburg von der CSSF übernommenen ISA ist im Abschnitt „Verantwortung des zugelassenen Abschlussprüfers („Réviseur d’entreprises agréé“) für die Prüfung des Abschlusses“ unseres Berichts beschrieben.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unsere Prüfungsurteile zu dienen.

Wir sind vom Fonds unabhängig in Übereinstimmung mit dem International Code of Ethics for Professional Accountants, einschließlich internationaler Unabhängigkeitsstandards, des International Ethics Standard Board for Accountants (IESBA Code) gemäß dessen Übernahme in Luxemburg durch die CSSF in Verbindung mit den für unsere Prüfung des Abschlusses einschlägigen ethischen Anforderungen. Wir haben unsere sonstigen ethischen Pflichten, die aus diesen ethischen Anforderungen erwachsen, erfüllt.

---

### *Weitere Informationen*

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die weiteren Informationen verantwortlich. Die weiteren Informationen umfassen die im Jahresbericht stehenden Angaben, beinhalten jedoch nicht den Abschluss und unseren Bestätigungsvermerk dazu.

Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss erstreckt sich nicht auf die weiteren Informationen, sodass wir zu den weiteren Informationen weder eine Bestätigung erteilen noch eine Aussage abgeben.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Abschlusses haben wir die Verantwortung, die weiteren Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die weiteren Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zum Abschluss oder unseren bei der Prüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Kommen wir auf der Grundlage unserer Tätigkeit zu dem Schluss, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser weiteren Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in dieser Hinsicht nichts mitzuteilen.

---

#### *Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds für den Abschluss*

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die Erstellung und wahrheitsgetreue und angemessene Darstellung (nach dem Grundsatz der „Fair Presentation“) des Abschlusses im Einklang mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen an die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen verantwortlich sowie für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat für notwendig erachtet, um die Erstellung eines Abschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat des Fonds dafür verantwortlich, die Fähigkeit des Fonds und aller Teilfonds des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit zu beurteilen und, sofern einschlägig, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung der Unternehmenstätigkeit anzugeben, und den Rechnungslegungsgrundsatz der Fortführung der Unternehmenstätigkeit anzuwenden, sofern der Verwaltungsrat nicht beabsichtigt, den Fonds aufzulösen oder einen seiner Teilfonds zu schließen oder die Geschäftstätigkeit einzustellen, oder für den Verwaltungsrat keine realistische Alternative mehr besteht, als so zu handeln.

---

#### *Verantwortung des zugelassenen Abschlussprüfers („Réviseur d’entreprises agréé“) für die Prüfung des Abschlusses*

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist, und einen Bestätigungsvermerk zu erteilen, der unsere Prüfungsurteile beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 unter Beachtung der von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISA durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus Verstößen oder Unrichtigkeiten resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden kann, dass sie einzeln oder insgesamt, die auf Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und unter Beachtung der von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISA üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren während der gesamten Prüfung eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher - beabsichtigter oder unbeabsichtigter - falscher Darstellungen im Abschluss, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unsere Prüfungsurteile zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen und beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können;

- gewinnen wir ein Verständnis von den für die Prüfung relevanten internen Kontrollen, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit der internen Kontrollen des Fonds abzugeben;
- beurteilen wir die Angemessenheit der vom Verwaltungsrat des Fonds angewandten Rechnungslegungsmethoden und der Vertretbarkeit der vom Verwaltungsrat des Fonds ermittelten Schätzwerte sowie der damit zusammenhängenden Angaben;
- ziehen wir Schlussfolgerungen über die Angemessenheit des vom Verwaltungsrat des Fonds angewandten Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Unternehmenstätigkeit sowie, auf Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder einer seiner Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bestätigungsvermerk auf die dazugehörigen Angaben im Abschluss aufmerksam zu machen, oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf Grundlage der bis zum Datum unseres Bestätigungsvermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds seine Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen kann;
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Abschlusses, einschließlich der Angaben, und ob der Abschluss die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass er ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen unter anderem den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger Mängel der internen Kontrollen, die wir während unserer Prüfung feststellen.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
Vertreten durch

Luxemburg, 16. März 2022

Christelle Crépin

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

# Nettovermögensaufstellung per 31.12.2021

|  | Konsolidierte Aufstellung | Nordea 1 -<br>Alpha 7 MA Fund | Nordea 1 -<br>Alpha 10 MA Fund |
|--|---------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
|  | (in EUR)                  | (in EUR)                      | (in EUR)                       |
| <b>Aktiva</b>  |                           |                               |                                |
| Aktien zum Marktwert (Anmerkung 2)   | 45.781.547.200,93         | 347.771.464,36                | 2.738.419.850,85               |
| Fonds zum Marktwert (Anmerkung 2)  | 120.377.277,16            | -                             | -                              |
| Anleihen zum Marktwert (Anmerkung 2)   | 42.208.543.996,18         | 97.824.778,87                 | 1.216.264.571,33               |
| Gekaufte Optionen zum Marktwert (Anmerkung 2)  | 649.175,53                | 19.014,46                     | 270.091,78                     |
| Bankguthaben   | 4.274.280.294,05          | 86.168.733,53                 | 1.050.281.783,27               |
| Dividenden- und Zinsforderungen  | 357.777.587,69            | 946.517,00                    | 12.319.022,96                  |
| Forderungen aus Anteilsverkäufen   | 30.284.900,63             | 40.882,12                     | 569.170,06                     |
| Forderungen aus Anteilszeichnungen   | 343.000.679,65            | 2.098.444,16                  | 10.705.693,90                  |
| Forderungen aus Devisenterminkontrakten  | 68.607.461,74             | -                             | -                              |
| Sonstige Nettoforderungen (Anmerkung 2p)   | 22.344.117,62             | -                             | -                              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)   | 158.589.646,23            | -                             | 49.926.357,15                  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)                      | 89.772.834,05             | -                             | 41.707.661,52                  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | 483.744.086,41            | 7.811.209,19                  | 112.123.236,02                 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                 | 9.369.200,01              | 178.739,12                    | 2.375.560,41                   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                           | 3.549.601,90              | 5.129,07                      | -                              |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)        | 74.045.237,00             | -                             | -                              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswaps (Anmerkung 2)  | 38.345.333,04             | -                             | -                              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                              | 78.553.311,49             | -                             | -                              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2)  | 185.057,20                | 251,88                        | -                              |
|  | <b>94.143.566.998,53</b>  | <b>542.865.163,76</b>         | <b>5.234.962.999,25</b>        |
| <b>Passiva</b>   |                           |                               |                                |
| Aufwandsabgrenzung   | 215.056.881,20            | 681.271,98                    | 14.416.301,90                  |
| Verbindlichkeiten aus Zinsforderungen  | 21.827,92                 | -                             | -                              |
| Verbindlichkeiten aus Devisenterminkontrakten  | 68.629.991,01             | -                             | -                              |
| Verbindlichkeiten aus Anteilskäufen  | 30.601.820,79             | -                             | -                              |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen  | 172.870.069,25            | 17.530,99                     | 2.626.705,87                   |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)   | 536.916.463,35            | -                             | -                              |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten (Anmerkung 2p)   | 27.178.380,26             | 33.764,75                     | 458.213,41                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Equity Swaps (Anmerkung 2)  | 596.185,11                | -                             | -                              |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)                                  | 36.173.675,23             | -                             | 10.170.933,61                  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)               | 42.004.851,42             | -                             | 11.031.262,25                  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | 21.282.664,64             | -                             | -                              |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                | 7.424.722,19              | -                             | -                              |
| Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                          | 6.472.483,70              | -                             | 810.303,52                     |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)       | 92.148.124,32             | 3.054.835,80                  | 29.675.455,36                  |
| Zinsswaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)   | 752.000,00                | -                             | -                              |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswaps (Anmerkung 2)   | 5.909.093,42              | -                             | -                              |
| Nicht realisierter Verlust aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)                                  | 84.335,91                 | -                             | -                              |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                             | 274.986.020,14            | 7.656.260,05                  | 72.276.328,82                  |
| Nicht realisierter Verlust aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2) | 99.600,56                 | -                             | 1.364,80                       |
|  | <b>1.539.209.190,42</b>   | <b>11.443.663,57</b>          | <b>141.466.869,54</b>          |
| <b>Summe Nettovermögen - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>  | <b>92.604.357.808,11</b>  | <b>531.421.500,19</b>         | <b>5.093.496.129,71</b>        |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung  | -                         | -                             | -                              |
| <b>Summe Nettovermögen - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>   | <b>92.604.357.808,11</b>  | <b>531.421.500,19</b>         | <b>5.093.496.129,71</b>        |
| Wertpapiere zum Anschaffungspreis  | 78.661.604.686,12         | 368.362.942,26                | 3.360.332.369,32               |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Alpha 15 MA Fund<br><br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Asia ex Japan<br>Equity Fund<br><br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Asian Stars<br>Equity Fund<br><br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Balanced<br>Income Fund<br><br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Chinese Bond Fund<br>(Anmerkung 1c)<br><br>(in CNH) |
|--|--|--|---|---|
| 2.952.400.875,90                               | 98.693.155,09  | 235.495.196,38   | -   | -   |
| -  | -  | -  | 13.209.113,58   | -   |
| 901.954.162,10                                 | -  | -  | 549.048.777,27  | 338.915.922,19  |
| 360.069,29                                     | -  | -  | -   | -   |
| 964.221.235,14                                 | 2.435.846,36   | 5.212.528,21   | 26.182.026,06   | 1.352.995,14  |
| 12.282.636,45                                  | 100.060,64   | 253.676,81   | 1.846.014,61  | 5.465.901,87  |
| 748.142,91                                     | 822.273,46   | 842.265,97   | -   | -   |
| 7.922.030,73                                   | 483.354,68   | 163.567,03   | 956.050,55  | 302.561,84  |
| -  | 65.084,56  | 608.461,81   | -   | 315.668,65  |
| -  | -  | -  | 28.888,58   | -   |
| 108.663.289,08                                 | -  | -  | -   | -   |
| 47.731.476,66                                  | -  | -  | -   | -   |
| 162.409.613,51                                 | -  | -  | 19.784.875,88   | -   |
| 3.466.987,34                                   | -  | -  | 73.156,51   | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| -  | -  | -  | 3.743.267,03  | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| -  | 32.438,28  | -  | -   | -   |
| -  | 964,37   | 779,76   | -   | 398,65  |
| <b>5.162.160.519,11</b>                        | <b>102.633.177,44</b>                                      | <b>242.576.475,97</b>                                    | <b>614.872.170,07</b>                                 | <b>346.353.448,34</b>   |
| 14.811.389,27                                  | 431.132,22   | 864.855,14   | 883.119,07  | 514.938,96  |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| -  | 65.132,57  | 608.660,87   | -   | 315.404,61  |
| -  | 1.401.592,63   | 1.598.214,01   | -   | -   |
| 11.944.470,87                                  | 141.307,01   | 762.125,38   | 479.991,88  | 43.889,66   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| 676.716,54                                     | 94.973,54  | 807.739,86   | -   | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| 26.002.741,62                                  | -  | -  | -   | -   |
| 30.973.589,17                                  | -  | -  | -   | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| 1.820.351,41                                   | -  | -  | 478.566,48  | -   |
| 35.314.362,47                                  | -  | -  | -   | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| 71.961.183,11                                  | -  | -  | 9.912.010,13  | 139.811,62  |
| 50,99  | -  | -  | 13,94   | -   |
| <b>193.504.855,45</b>                          | <b>2.134.137,97</b>  | <b>4.641.595,26</b>                                      | <b>11.753.701,50</b>                                  | <b>1.014.044,85</b>   |
| <b>4.968.655.663,66</b>                        | <b>100.499.039,47</b>                                      | <b>237.934.880,71</b>                                    | <b>603.118.468,57</b>                                 | <b>345.339.403,49</b>   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| <b>4.968.655.663,66</b>                        | <b>100.499.039,47</b>                                      | <b>237.934.880,71</b>                                    | <b>603.118.468,57</b>                                 | <b>345.339.403,49</b>   |
| 3.261.215.062,15                               | 87.400.396,90  | 229.656.507,47   | 556.820.953,20  | 332.067.043,00  |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nettovermögensaufstellung per 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Chinese<br>Equity Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Conservative Fixed<br>Income Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Danish Covered<br>Bond Fund<br>(in DKK) |
|--|--|---|---|
| <b>Aktiva</b>  |  |   |   |
| Aktien zum Marktwert (Anmerkung 2)   | 269.315.317,69                                   | -   | -   |
| Fonds zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -  | 1.441.384,88  | -   |
| Anleihen zum Marktwert (Anmerkung 2)   | -  | 117.493.455,21  | 7.968.276.211,04                                      |
| Gekaufte Optionen zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -  | -   | -   |
| Bankguthaben   | 7.111.746,55                                     | 5.263.099,52  | 149.010.073,89  |
| Dividenden- und Zinsforderungen  | 424.304,46                                       | 266.037,09  | 23.907.263,08   |
| Forderungen aus Anteilsverkäufen   | -  | -   | -   |
| Forderungen aus Anteilszeichnungen   | 6.570,93   | -   | 6.450.753,72  |
| Forderungen aus Devisenterminkontrakten  | 1.574.267,41                                     | -   | 784.524,63  |
| Sonstige Nettoforderungen (Anmerkung 2p)   | -  | -   | 96.590.476,03   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)   | -  | -   | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)                      | -  | -   | -   |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -  | 1.264.822,02  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                 | -  | 11.612,00   | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                           | -  | -   | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)        | -  | 394.295,41  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswaps (Anmerkung 2)  | -  | -   | 47.960.531,14   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                              | -  | -   | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2)  | -  | -   | -   |
|  | <b>278.432.207,04</b>                            | <b>126.134.706,13</b>                                       | <b>8.292.979.833,53</b>                               |
| <b>Passiva</b>   |  |   |   |
| Aufwandsabgrenzung   | 129.036,41                                       | 15.481,32   | 9.965.057,66  |
| Verbindlichkeiten aus Zinsforderungen  | -  | -   | -   |
| Verbindlichkeiten aus Devisenterminkontrakten  | 1.574.254,24                                     | -   | 784.270,91  |
| Verbindlichkeiten aus Anteilskäufen  | 1.567.022,42                                     | -   | -   |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen  | 7.417,97   | -   | 1.262.649,12  |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)   | -  | -   | -   |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten (Anmerkung 2p)   | -  | -   | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Equity Swaps (Anmerkung 2)  | -  | -   | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)                                  | -  | -   | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)               | -  | -   | -   |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -  | -   | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                | -  | -   | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                          | -  | 25.493,76   | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)       | -  | -   | 14.074.618,85   |
| Zinsswaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)   | -  | -   | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswaps (Anmerkung 2)   | -  | -   | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)                                  | -  | -   | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                             | -  | 170.208,56  | 9.679.964,68  |
| Nicht realisierter Verlust aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2) | 243,26   | -   | 14.755,79   |
|  | <b>3.277.974,30</b>                              | <b>211.183,64</b>   | <b>35.781.317,01</b>                                  |
| <b>Summe Nettovermögen - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>  | <b>275.154.232,74</b>                            | <b>125.923.522,49</b>                                       | <b>8.257.198.516,52</b>                               |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung  | -  | -   | -   |
| <b>Summe Nettovermögen - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>   | <b>275.154.232,74</b>                            | <b>125.923.522,49</b>                                       | <b>8.257.198.516,52</b>                               |
| Wertpapiere zum Anschaffungspreis  | 266.168.114,09                                   | 119.137.054,28  | 8.153.302.419,71                                      |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



| Nordea 1 -<br>Emerging Market<br>Bond Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Emerging Market Bond<br>Opportunities Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Emerging Market<br>Corporate Bond Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Emerging Markets<br>Debt Total Return Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Emerging Stars<br>Bond Fund<br>(in USD) |
|--|--|--|--|---|
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| 1.127.847.562,87                                       | 59.598.917,39  | 205.755.578,74   | 83.444.965,71  | 1.528.793.241,64                                      |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| 44.862.432,81  | 1.962.096,91   | 13.008.145,23  | 4.276.851,31   | 6.281.891,38  |
| 17.114.682,72  | 930.389,65   | 2.766.839,09   | 1.325.616,02   | 19.546.162,26   |
| -  | -  | 219.269,11   | -  | 4.970.300,77  |
| 1.360.163,36   | 6.228,98   | 1.146.023,60   | 138.844,13   | 5.682.747,57  |
| 208.974,67   | 5.628,99   | 288.558,21   | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | 1.076.985,85   | 1.122.353,49  |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| 4.030.719,70   | -  | 777.554,41   | 3.044.650,26   | 111.213,98  |
| -  | -  | 1.003,14   | 13.290,71  | 8.617.332,82  |
| -  | -  | -  | -  | 7.119,40  |
| <b>1.195.424.536,13</b>                                | <b>62.503.261,92</b>   | <b>223.962.971,53</b>  | <b>93.321.203,99</b>   | <b>1.575.132.363,31</b>                               |
| 2.740.263,03   | 180.897,50   | 482.625,33   | 27.451,34  | 1.812.044,08  |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| 209.240,80   | 5.630,65   | 288.224,28   | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| 830.638,32   | 232,61   | 52.825,12  | 6.758,01   | 357.145,24  |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | 460,68   | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | 5.925,56   | 326.423,40  |
| -  | -  | -  | 1.234,38   | 42.815,64   |
| -  | -  | -  | 150.796,24   | 823.608,70  |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | 2.061.877,91   | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | 54.863,26  | -  | -  | -   |
| 823,11   | 70,27  | -  | -  | -   |
| <b>3.780.965,26</b>                                    | <b>242.154,97</b>  | <b>823.674,73</b>  | <b>2.254.043,44</b>  | <b>3.362.037,06</b>                                   |
| <b>1.191.643.570,87</b>                                | <b>62.261.106,95</b>   | <b>223.139.296,80</b>  | <b>91.067.160,55</b>   | <b>1.571.770.326,25</b>                               |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| <b>1.191.643.570,87</b>                                | <b>62.261.106,95</b>   | <b>223.139.296,80</b>  | <b>91.067.160,55</b>   | <b>1.571.770.326,25</b>                               |
| 1.181.010.670,44                                       | 63.165.762,36  | 210.679.625,37   | 85.363.443,20  | 1.573.866.112,77                                      |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nettovermögensaufstellung per 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Emerging Stars<br>Equity Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Emerging Stars Local<br>Bond Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Emerging Wealth<br>Equity Fund<br>(Anmerkung 1b)<br>(in EUR) |
|--|---|---|--|
| <b>Aktiva</b>  |   |   |  |
| Aktien zum Marktwert (Anmerkung 2)   | 5.739.519.647,94  | -   | 134.003.929,48   |
| Fonds zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -   | -   | -  |
| Anleihen zum Marktwert (Anmerkung 2)   | -   | 60.882.410,97   | -  |
| Gekaufte Optionen zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -   | -   | -  |
| Bankguthaben   | 112.950.606,63  | 1.964.683,84  | 6.358.720,65   |
| Dividenden- und Zinsforderungen  | 12.614.037,71   | 1.101.215,23  | 13.648,03  |
| Forderungen aus Anteilsverkäufen   | 13.146.443,25   | -   | -  |
| Forderungen aus Anteilszeichnungen   | 20.985.553,56   | 6.716,14  | 77.693,70  |
| Forderungen aus Devisenterminkontrakten  | 27.251.447,23   | 26.547,67   | 4.803,52   |
| Sonstige Nettoforderungen (Anmerkung 2p)   | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)   | -   | -   | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)                      | -   | -   | -  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                 | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                           | -   | -   | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)        | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswaps (Anmerkung 2)  | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                              | 807.810,65  | 244.968,89  | 83,35  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2)  | -   | 7.337,50  | -  |
|  | <b>5.927.275.546,97</b>                                 | <b>64.233.880,24</b>  | <b>140.458.878,73</b>  |
| <b>Passiva</b>   |   |   |  |
| Aufwandsabgrenzung   | 20.046.505,37   | 96.489,60   | 291.540,26   |
| Verbindlichkeiten aus Zinsforderungen  | -   | -   | -  |
| Verbindlichkeiten aus Devisenterminkontrakten  | 27.274.147,53   | 26.559,27   | 4.804,46   |
| Verbindlichkeiten aus Anteilskäufen  | -   | -   | 575.057,61   |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen  | 19.492.780,01   | 78.223,17   | 8.469,77   |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)   | -   | -   | -  |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten (Anmerkung 2p)   | 20.503.645,99   | -   | 150.310,29   |
| Nicht realisierter Verlust aus Equity Swaps (Anmerkung 2)  | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)                                  | -   | -   | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)               | -   | -   | -  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                          | -   | 1.250,08  | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)       | -   | 21.875,00   | -  |
| Zinsswaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)   | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswaps (Anmerkung 2)   | -   | 142.923,65  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)                                  | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                             | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2) | 44.540,22   | -   | 59,75  |
|  | <b>87.361.619,12</b>                                    | <b>367.320,77</b>   | <b>1.030.242,14</b>  |
| <b>Summe Nettovermögen - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>  | <b>5.839.913.927,85</b>                                 | <b>63.866.559,47</b>  | <b>139.428.636,59</b>  |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung  | -   | -   | -  |
| <b>Summe Nettovermögen - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>   | <b>5.839.913.927,85</b>                                 | <b>63.866.559,47</b>  | <b>139.428.636,59</b>  |
| Wertpapiere zum Anschaffungspreis  | 4.794.997.611,95  | 67.090.239,06   | 132.311.145,42   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>European Corporate<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>European Corporate<br>Stars Bond Fund | Nordea 1 -<br>European Covered<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>European Covered Bond<br>Opportunities Fund | Nordea 1 -<br>European Cross<br>Credit Fund |
|---|---|---|---|---|
| (in EUR)                                      | (in EUR)  | (in EUR)                                    | (in EUR)  | (in EUR)                                    |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| 538.769.416,89                                | 1.237.206.085,82                                    | 5.560.505.908,07                            | 1.188.851.898,08  | 955.377.780,94                              |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| 2.237.768,67                                  | 7.183.470,97  | 144.589.962,63                              | 29.112.762,66   | 158.590,68                                  |
| 3.358.452,58                                  | 7.629.592,01  | 24.283.392,02                               | 3.755.868,94  | 8.496.996,55                                |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| 2.940.133,06                                  | 5.726.316,18  | 14.263.422,76                               | 3.761.405,00  | 670.751,33                                  |
| -   | -   | -   | 3.770.863,96  | -   |
| -   | -   | 406.348,30                                  | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| 1.631.689,79                                  | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| 4.325,00                                      | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | 9.796.360,95                                | 6.408.330,25  | -   |
| -   | -   | 7.270.085,51                                | 3.600.913,76  | -   |
| -   | 1.958.337,20  | -   | -   | -   |
| -   | 3,16  | 10.441,18                                   | 43,42   | -   |
| <b>548.941.785,99</b>                         | <b>1.259.703.805,34</b>                             | <b>5.761.125.921,42</b>                     | <b>1.239.262.086,07</b>                                   | <b>964.704.119,50</b>                       |
| 517.494,72                                    | 351.890,35  | 9.369.649,38                                | 690.182,18  | 2.130.077,83                                |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | 3.777.573,77  | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| 381.299,65                                    | 441.925,86  | 33.638.568,00                               | 1.214.638,93  | 1.243.747,17                                |
| -   | -   | -   | 536.916.463,35  | -   |
| -   | -   | -   | 2.380.553,31  | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | 6.419.243,39                                | 1.452.616,02  | -   |
| 46.645,95                                     | -   | 1.241.974,24                                | 281.548,36  | -   |
| -   | -   | 625.179,24                                  | 148.972,25  | -   |
| 135.680,27                                    | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | 304.000,00                                  | 80.000,00   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | 84.335,91   | -   |
| 1.992.905,36                                  | -   | 2.855.375,06                                | 337.289,17  | 652.042,35                                  |
| 19,85   | -   | -   | -   | 0,01  |
| <b>3.074.045,80</b>                           | <b>793.816,21</b>                                   | <b>54.453.989,31</b>                        | <b>547.364.173,25</b>                                     | <b>4.025.867,36</b>                         |
| <b>545.867.740,19</b>                         | <b>1.258.909.989,13</b>                             | <b>5.706.671.932,11</b>                     | <b>691.897.912,82</b>                                     | <b>960.678.252,14</b>                       |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| <b>545.867.740,19</b>                         | <b>1.258.909.989,13</b>                             | <b>5.706.671.932,11</b>                     | <b>691.897.912,82</b>                                     | <b>960.678.252,14</b>                       |
| 542.187.971,57                                | 1.252.329.703,36                                    | 5.575.268.769,36                            | 1.201.287.945,45  | 943.633.970,54                              |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nettovermögensaufstellung per 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>European Financial<br>Debt Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European High Yield<br>Bond Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European High Yield<br>Credit Fund<br>(in EUR) |
|--|---|--|--|
| <b>Aktiva</b>  |   |  |  |
| Aktien zum Marktwert (Anmerkung 2)   | -   | -  | -  |
| Fonds zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -   | -  | -  |
| Anleihen zum Marktwert (Anmerkung 2)   | 1.230.433.796,16  | 4.157.960.510,63   | 260.409.736,70   |
| Gekaufte Optionen zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -   | -  | -  |
| Bankguthaben   | 73.482.863,32   | 161.159.003,67   | 8.561.447,35   |
| Dividenden- und Zinsforderungen  | 15.574.618,61   | 46.546.332,45  | 2.858.948,60   |
| Forderungen aus Anteilsverkäufen   | -   | -  | -  |
| Forderungen aus Anteilszeichnungen   | 1.748.353,35  | 28.639.091,98  | 12.900.556,70  |
| Forderungen aus Devisenterminkontrakten  | -   | 68.872,72  | 12.774.144,73  |
| Sonstige Nettoforderungen (Anmerkung 2p)   | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)   | -   | -  | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)                      | -   | -  | -  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | 2.896.989,74  | 14.904.035,54  | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                 | -   | 532.012,02   | 1.174.499,86   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                           | -   | -  | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)        | 166.315,23  | -  | 62.084,33  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswaps (Anmerkung 2)  | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                              | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2)  | -   | -  | 4.395,11   |
|  | <b>1.324.302.936,41</b>                                   | <b>4.409.809.859,01</b>                                    | <b>298.745.813,38</b>  |
| <b>Passiva</b>   |   |  |  |
| Aufwandsabgrenzung   | 2.677.873,51  | 9.472.795,13   | 227.761,83   |
| Verbindlichkeiten aus Zinsforderungen  | -   | -  | -  |
| Verbindlichkeiten aus Devisenterminkontrakten  | -   | 68.810,81  | 12.779.914,86  |
| Verbindlichkeiten aus Anteilskäufen  | -   | -  | 2.922.334,11   |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen  | 2.475.946,32  | 19.026.175,01  | 63.266,43  |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)   | -   | -  | -  |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten (Anmerkung 2p)   | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Equity Swaps (Anmerkung 2)  | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)                                  | -   | -  | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)               | -   | -  | -  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -   | -  | 3.730.705,74   |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                | 3.902.052,99  | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                          | 296.080,05  | -  | 11.784,11  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)       | -   | -  | -  |
| Zinsswaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)   | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswaps (Anmerkung 2)   | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)                                  | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                             | 12.815.707,42   | 13.630.825,68  | 145.708,59   |
| Nicht realisierter Verlust aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2) | 11.057,30   | 2,86   | -  |
|  | <b>22.178.717,59</b>                                      | <b>42.198.609,49</b>                                       | <b>19.881.475,67</b>   |
| <b>Summe Nettovermögen - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>  | <b>1.302.124.218,82</b>                                   | <b>4.367.611.249,52</b>                                    | <b>278.864.337,71</b>  |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung  | -   | -  | -  |
| <b>Summe Nettovermögen - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>   | <b>1.302.124.218,82</b>                                   | <b>4.367.611.249,52</b>                                    | <b>278.864.337,71</b>  |
| Wertpapiere zum Anschaffungspreis  | 1.207.160.648,08  | 4.149.143.797,24   | 258.696.657,57   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>European High Yield<br>Stars Bond Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European Inflation<br>Linked Bond Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European Small and<br>Mid Cap Equity Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European Stars<br>Equity Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Flexible Credit Fund<br>(Anmerkung 1b)<br>(in EUR) |
|--|--|---|---|--|
| -  | -  | 499.817.261,37  | 772.690.529,00  | -  |
| -  | -  | 27.708.286,40   | -   | -  |
| 608.224.640,14   | 17.043.522,33  | -   | -   | 79.342.844,45  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| 16.713.590,25  | 37.823,02  | 10.664.109,09   | 2.371.003,26  | 792.620,83   |
| 6.972.958,17   | 54.968,23  | -   | -   | 892.993,55   |
| 731.720,62   | -  | -   | -   | -  |
| 1.343.206,06   | -  | 272.451,68  | 696.023,01  | 492,31   |
| -  | -  | 201.909,93  | 382.871,43  | -  |
| -  | -  | 3.025,13  | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| 358.750,84   | -  | -   | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | 594.822,50   |
| -  | -  | -   | 415,93  | -  |
| -  | -  | -   | 473,04  | -  |
| <b>634.344.866,08</b>  | <b>17.136.313,58</b>   | <b>538.667.043,60</b>   | <b>776.141.315,67</b>                                   | <b>81.623.773,64</b>   |
| 331.263,73   | 5.092,31   | 2.099.586,79  | 2.503.692,18  | 57.171,23  |
| -  | -  | 7.813,39  | 6.531,76  | -  |
| -  | -  | 201.771,82  | 383.622,64  | -  |
| 418.463,38   | -  | -   | -   | -  |
| 168.763,14   | -  | 400.061,66  | 1.099.858,29  | 17.575,73  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| 1.723.232,66   | -  | -   | -   | -  |
| 57.849,75  | -  | -   | -   | -  |
| 22.383,75  | -  | -   | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| 1.752.130,76   | -  | -   | -   | 478.606,68   |
| 207,92   | -  | 46,16   | -   | -  |
| <b>4.474.295,09</b>  | <b>5.092,31</b>  | <b>2.709.279,82</b>   | <b>3.993.704,87</b>                                     | <b>553.353,64</b>  |
| <b>629.870.570,99</b>  | <b>17.131.221,27</b>   | <b>535.957.763,78</b>   | <b>772.147.610,80</b>                                   | <b>81.070.420,00</b>   |
| -  | -  | -   | -   | -  |
| <b>629.870.570,99</b>  | <b>17.131.221,27</b>   | <b>535.957.763,78</b>   | <b>772.147.610,80</b>                                   | <b>81.070.420,00</b>   |
| 610.576.110,18   | 16.277.239,37  | 372.543.440,99  | 691.976.882,89  | 74.887.069,75  |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nettovermögensaufstellung per 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Flexible Fixed<br>Income Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Flexible Fixed<br>Income Plus Fund<br>(Anmerkung 1a)<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>GBP Diversified<br>Return Fund<br>(in GBP) |
|--|---|--|--|
| <b>Aktiva</b>  |   |  |  |
| Aktien zum Marktwert (Anmerkung 2)   | -   | -  | 2.568.987.144,42   |
| Fonds zum Marktwert (Anmerkung 2)  | 74.851.908,11   | 3.166.584,19   | -  |
| Anleihen zum Marktwert (Anmerkung 2)   | 3.127.024.095,98  | 61.156.362,82  | 422.749.855,06   |
| Gekaufte Optionen zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -   | -  | -  |
| Bankguthaben   | 109.077.372,44  | 3.403.884,10   | 144.683.437,86   |
| Dividenden- und Zinsforderungen  | 12.315.616,49   | 207.969,44   | 4.427.451,34   |
| Forderungen aus Anteilsverkäufen   | -   | -  | 478.216,05   |
| Forderungen aus Anteilszeichnungen   | 15.227.967,30   | -  | 660.741,64   |
| Forderungen aus Devisenterminkontrakten  | 362.644,96  | -  | -  |
| Sonstige Nettoforderungen (Anmerkung 2p)   | 217.285,74  | 9.974,81   | 1.736.188,80   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)   | -   | -  | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)                      | -   | -  | -  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | 110.917.161,19  | 4.595.264,39   | 12.037.801,51  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                 | 1.034.888,78  | 3.639,20   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                           | -   | -  | 947.017,13   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)        | 5.371.584,05  | 253.934,24   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswaps (Anmerkung 2)  | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                              | -   | 251.905,34   | 34.330.146,98  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2)  | 784,48  | -  | 17.316,86  |
|  | <b>3.456.401.309,52</b>                                 | <b>73.049.518,53</b>   | <b>3.191.055.317,65</b>                                  |
| <b>Passiva</b>   |   |  |  |
| Aufwandsabgrenzung   | 4.177.933,91  | 52.703,98  | 6.256.573,52   |
| Verbindlichkeiten aus Zinsforderungen  | -   | -  | -  |
| Verbindlichkeiten aus Devisenterminkontrakten  | 362.593,07  | -  | -  |
| Verbindlichkeiten aus Anteilskäufen  | -   | -  | -  |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen  | 3.733.976,01  | -  | 1.309.654,36   |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)   | -   | -  | -  |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten (Anmerkung 2p)   | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Equity Swaps (Anmerkung 2)  | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)                                  | -   | -  | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)               | -   | -  | -  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                | -   | -  | 4.318,08   |
| Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                          | 1.324.152,07  | 45.845,96  | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)       | -   | -  | 5.088.254,95   |
| Zinsswaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)   | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswaps (Anmerkung 2)   | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)                                  | -   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                             | 33.689.034,83   | -  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2) | -   | 6,07   | -  |
|  | <b>43.287.689,89</b>                                    | <b>98.556,01</b>   | <b>12.658.800,91</b>                                     |
| <b>Summe Nettovermögen - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>  | <b>3.413.113.619,63</b>                                 | <b>72.950.962,52</b>   | <b>3.178.396.516,74</b>                                  |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung  | -   | -  | -  |
| <b>Summe Nettovermögen - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>   | <b>3.413.113.619,63</b>                                 | <b>72.950.962,52</b>   | <b>3.178.396.516,74</b>                                  |
| Wertpapiere zum Anschaffungspreis  | 3.150.687.818,94  | 64.040.726,34  | 2.440.436.883,53   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Global<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>Global Climate and<br>Environment Fund | Nordea 1 -<br>Global Climate and<br>Social Impact Fund<br>(Anmerkung 1a) | Nordea 1 -<br>Global<br>Disruption Fund | Nordea 1 -<br>Global Equity Market<br>Neutral Fund |
|-----------------------------------|--|--|---|--|
| (in EUR)                          | (in EUR)   | (in USD)   | (in USD)                                | (in EUR)   |
| -                                 | 11.152.574.781,18                                    | 210.991.015,20   | 247.792.951,39                          | 19.731.104,65                                      |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| 54.688.172,44                     | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| 1.196.089,72                      | 219.010.703,26                                       | 4.069.666,18   | 3.128.018,02                            | 8.352.691,49                                       |
| 272.754,46                        | 9.123.215,35   | 87.736,92  | 78.087,49                               | 9.260,21   |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| 19.242,07                         | 20.945.837,47  | 777.670,55   | 169.882,13                              | -  |
| 3.743,11                          | 2.212.895,85   | 259.888,18   | 369.978,91                              | -  |
| 262,14                            | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | 333.695,87   |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| 4.947,81                          | -  | -  | -                                       | 4.408,93   |
| 246.918,58                        | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| 29.910,64                         | -  | -  | -                                       | -  |
| 76.049,73                         | 459.867,77   | 34.558,11  | -                                       | -  |
| -                                 | 57.186,41  | 628,36   | 360,70                                  | -  |
| <b>56.538.090,70</b>              | <b>11.404.384.487,29</b>                             | <b>216.221.163,50</b>  | <b>251.539.278,64</b>                   | <b>28.431.161,15</b>                               |
| 119.526,32                        | 37.012.202,47  | 407.950,78   | 1.006.091,14                            | 3.539,54   |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| 3.743,10                          | 2.212.961,79   | 259.630,10   | 370.137,08                              | -  |
| -                                 | -  | 2.083.012,77   | -                                       | -  |
| 286.861,84                        | 5.990.311,23   | 29.078,24  | 481.071,63                              | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | 596.185,11   |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | 35.729,85  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| -                                 | -  | -  | -                                       | 245.978,79   |
| 0,31                              | -  | -  | -                                       | 44,01  |
| <b>410.131,57</b>                 | <b>45.215.475,49</b>                                 | <b>2.779.671,89</b>  | <b>1.857.299,85</b>                     | <b>881.477,30</b>                                  |
| <b>56.127.959,13</b>              | <b>11.359.169.011,80</b>                             | <b>213.441.491,61</b>  | <b>249.681.978,79</b>                   | <b>27.549.683,85</b>                               |
| -                                 | -  | -  | -                                       | -  |
| <b>56.127.959,13</b>              | <b>11.359.169.011,80</b>                             | <b>213.441.491,61</b>  | <b>249.681.978,79</b>                   | <b>27.549.683,85</b>                               |
| 55.283.697,56                     | 8.464.025.354,62                                     | 211.620.640,10   | 218.675.954,70                          | 17.751.207,26                                      |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nettovermögensaufstellung per 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Global Gender<br>Diversity Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Global Green<br>Bond Fund<br>(Anmerkung 1a)<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Global High Yield<br>Bond Fund<br>(in USD) |
|--|---|---|--|
| <b>Aktiva</b>  |   |   |  |
| Aktien zum Marktwert (Anmerkung 2)   | 234.559.742,30  | -   | -  |
| Fonds zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -   | -   | -  |
| Anleihen zum Marktwert (Anmerkung 2)   | -   | 60.307.917,44   | 657.596.064,21   |
| Gekaufte Optionen zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -   | -   | -  |
| Bankguthaben   | 3.996.402,02  | 1.487.446,47  | 24.677.586,71  |
| Dividenden- und Zinsforderungen  | 92.238,86   | 316.319,40  | 9.147.642,30   |
| Forderungen aus Anteilsverkäufen   | -   | -   | 399.429,97   |
| Forderungen aus Anteilszeichnungen   | 502.487,96  | 222,05  | 51.843,96  |
| Forderungen aus Devisenterminkontrakten  | 251.344,14  | -   | 1.639,64   |
| Sonstige Nettoforderungen (Anmerkung 2p)   | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)   | -   | -   | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)                      | -   | -   | -  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -   | 198.688,01  | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                 | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                           | -   | 5.332,71  | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)        | -   | 188.166,42  | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswaps (Anmerkung 2)  | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                              | -   | -   | 1.301.329,68   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2)  | 854,12  | -   | -  |
|  | <b>239.403.069,40</b>                                     | <b>62.504.092,50</b>  | <b>693.175.536,47</b>                                    |
| <b>Passiva</b>   |   |   |  |
| Aufwandsabgrenzung   | 163.811,83  | 16.679,64   | 302.403,91   |
| Verbindlichkeiten aus Zinsforderungen  | -   | -   | -  |
| Verbindlichkeiten aus Devisenterminkontrakten  | 250.965,14  | -   | 1.641,92   |
| Verbindlichkeiten aus Anteilskäufen  | -   | -   | -  |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen  | 56.006,05   | 1.453,41  | 12.391,36  |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)   | -   | -   | -  |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten (Anmerkung 2p)   | -   | 349,46  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Equity Swaps (Anmerkung 2)  | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)                                  | -   | -   | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)               | -   | -   | -  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                | -   | 53.871,99   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                          | -   | -   | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)       | -   | -   | -  |
| Zinsswaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)   | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswaps (Anmerkung 2)   | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)                                  | -   | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                             | -   | 429.342,04  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2) | -   | 0,55  | 23,67  |
|  | <b>470.783,02</b>   | <b>501.697,09</b>   | <b>316.460,86</b>  |
| <b>Summe Nettovermögen - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>  | <b>238.932.286,38</b>                                     | <b>62.002.395,41</b>  | <b>692.859.075,61</b>                                    |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung  | -   | -   | -  |
| <b>Summe Nettovermögen - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>   | <b>238.932.286,38</b>                                     | <b>62.002.395,41</b>  | <b>692.859.075,61</b>                                    |
| Wertpapiere zum Anschaffungspreis  | 187.895.638,12  | 60.311.392,82   | 646.384.948,35   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



| Nordea 1 -<br>Global Listed<br>Infrastructure Fund | Nordea 1 -<br>Global<br>Opportunity Fund | Nordea 1 -<br>Global<br>Portfolio Fund | Nordea 1 -<br>Global Real<br>Estate Fund | Nordea 1 -<br>Global Small<br>Cap Fund |
|--|--|--|--|--|
| (in USD)   | (in EUR)                                 | (in EUR)                               | (in USD)                                 | (in USD)                               |
| 475.063.854,60                                     | 486.402.973,50                           | 466.170.027,42                         | 1.132.611.703,87                         | 266.104.713,17                         |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| 1.285.958,72                                       | 5.661.354,33                             | 2.756.153,85                           | 32.992.463,10                            | 6.394.570,30                           |
| 531.650,89   | 79.967,39                                | 384.421,17                             | 1.971.905,08                             | 232.967,34                             |
| 894.102,03   | -  | -                                      | -  | -                                      |
| 449.735,78   | 272.385,56                               | 6.004.926,67                           | 1.157.420,06                             | 165.036,57                             |
| 258.665,69   | 4.310,20                                 | -                                      | 174.047,91                               | 342.841,09                             |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| 123.665,79   | 8.256,62                                 | -                                      | -  | -                                      |
| 5.370,26   | -  | -                                      | -  | 376,66                                 |
| <b>478.613.003,76</b>                              | <b>492.429.247,60</b>                    | <b>475.315.529,11</b>                  | <b>1.168.907.540,02</b>                  | <b>273.240.505,13</b>                  |
| 1.604.452,17                                       | 1.382.604,40                             | 947.020,20                             | 3.944.350,26                             | 1.194.405,24                           |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| 258.456,20   | 4.311,05                                 | -                                      | 174.127,30                               | 342.744,78                             |
| -  | -  | 620.400,41                             | 6.096.818,01                             | -                                      |
| 120.962,22   | 69.557,36                                | 539.868,50                             | 1.301.283,04                             | 383.042,95                             |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| -  | 82,26                                    | 394,26                                 | 1.385,93                                 | -                                      |
| <b>1.983.870,59</b>                                | <b>1.456.555,07</b>                      | <b>2.107.683,37</b>                    | <b>11.517.964,54</b>                     | <b>1.920.192,97</b>                    |
| <b>476.629.133,17</b>                              | <b>490.972.692,53</b>                    | <b>473.207.845,74</b>                  | <b>1.157.389.575,48</b>                  | <b>271.320.312,16</b>                  |
| -  | -  | -                                      | -  | -                                      |
| <b>476.629.133,17</b>                              | <b>490.972.692,53</b>                    | <b>473.207.845,74</b>                  | <b>1.157.389.575,48</b>                  | <b>271.320.312,16</b>                  |
| 432.630.871,17                                     | 312.998.881,00                           | 361.340.621,34                         | 894.182.234,41                           | 199.623.145,63                         |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nettovermögensaufstellung per 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Global Social<br>Empowerment Fund<br>(Anmerkung 1c)<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Global Stable<br>Equity Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Global Stable<br>Equity Fund -<br>Euro Hedged<br>(in EUR) |
|--|---|--|---|
| <b>Aktiva</b>  |   |  |   |
| Aktien zum Marktwert (Anmerkung 2)   | 349.346.876,99  | 2.563.810.456,58                                       | 566.959.900,00  |
| Fonds zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -   | -  | -   |
| Anleihen zum Marktwert (Anmerkung 2)   | -   | -  | -   |
| Gekaufte Optionen zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -   | -  | -   |
| Bankguthaben   | 5.896.164,04  | 13.719.622,32  | 4.858.770,01  |
| Dividenden- und Zinsforderungen  | 154.857,23  | 3.375.775,04   | 759.781,98  |
| Forderungen aus Anteilsverkäufen   | -   | 566.444,57   | 126.053,23  |
| Forderungen aus Anteilszeichnungen   | 148.153,33  | 198.067,35   | 262.860,31  |
| Forderungen aus Devisenterminkontrakten  | 130.696,98  | 13.469,50  | -   |
| Sonstige Nettoforderungen (Anmerkung 2p)   | -   | -  | 0,04  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)   | -   | -  | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)                      | -   | -  | -   |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                 | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                           | -   | -  | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)        | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswaps (Anmerkung 2)  | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                              | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2)  | 561,42  | 10.525,69  | 3.170,93  |
|  | <b>355.677.309,99</b>   | <b>2.581.694.361,05</b>                                | <b>572.970.536,50</b>   |
| <b>Passiva</b>   |   |  |   |
| Aufwandsabgrenzung   | 140.976,38  | 7.725.854,05   | 2.213.872,16  |
| Verbindlichkeiten aus Zinsforderungen  | -   | -  | -   |
| Verbindlichkeiten aus Devisenterminkontrakten  | 130.412,53  | 13.472,13  | -   |
| Verbindlichkeiten aus Anteilskäufen  | -   | 901.019,26   | 194.337,49  |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen  | 30.035,88   | 224.459,67   | 365.276,18  |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)   | -   | -  | -   |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten (Anmerkung 2p)   | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Equity Swaps (Anmerkung 2)  | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)                                  | -   | -  | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)               | -   | -  | -   |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                          | -   | -  | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)       | -   | -  | -   |
| Zinsswaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)   | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswaps (Anmerkung 2)   | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)                                  | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                             | -   | 9.437,58   | 4.740.367,28  |
| Nicht realisierter Verlust aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2) | -   | -  | -   |
|  | <b>301.424,79</b>   | <b>8.874.242,69</b>                                    | <b>7.513.853,11</b>   |
| <b>Summe Nettovermögen - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>  | <b>355.375.885,20</b>   | <b>2.572.820.118,36</b>                                | <b>565.456.683,39</b>   |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung  | -   | -  | -   |
| <b>Summe Nettovermögen - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>   | <b>355.375.885,20</b>   | <b>2.572.820.118,36</b>                                | <b>565.456.683,39</b>   |
| Wertpapiere zum Anschaffungspreis  | 342.036.954,20  | 2.117.213.698,63                                       | 469.193.672,93  |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Global Stars<br>Equity Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Indian<br>Equity Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>International High Yield<br>Bond Fund -<br>USD Hedged<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Latin American<br>Equity Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Long Duration<br>US Bond Fund<br>(in USD) |
|---|---|---|---|---|
| 2.128.460.220,15                                      | 329.750.564,42                                  | 943.438,01  | 33.881.681,46   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | 77.379.475,72   | -   | 4.258.393,41  |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| 59.744.786,95   | 24.682.255,10                                   | 2.021.679,48  | 369.993,50  | 103.916,92  |
| 1.698.408,79  | -   | 1.073.550,19  | 80.496,87   | 17.828,25   |
| -   | 7.627.327,73                                    | -   | -   | 178.038,18  |
| 2.463.513,82  | 202.018,95                                      | 83.681,81   | 92.595,45   | 82.041,87   |
| 4.467.988,97  | 4.114.671,13                                    | 33.709,47   | 85.077,24   | 189.957,59  |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | 398.675,51  | 9.314,38  | -   |
| -   | -   | 21,27   | 835,64  | -   |
| <b>2.196.834.918,68</b>                               | <b>366.376.837,33</b>                           | <b>81.934.231,46</b>  | <b>34.519.994,54</b>                                    | <b>4.830.176,22</b>                                     |
| 5.101.897,38  | 225.001,09                                      | 146.129,98  | 177.128,61  | 9.469,42  |
| -   | 22,44   | -   | -   | -   |
| 4.472.855,41  | 4.120.285,28                                    | 33.700,83   | 85.022,36   | 189.844,51  |
| -   | 15.460.588,25                                   | -   | 42.102,51   | -   |
| 4.691.399,45  | 4.378.261,03                                    | 76.608,14   | 176.460,54  | 223.550,23  |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | 3.439.192,19                                    | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| 2.075.307,67  | -   | -   | -   | -   |
| 14.985,16   | 22.890,56                                       | -   | -   | 117,92  |
| <b>16.356.445,07</b>                                  | <b>27.646.240,84</b>                            | <b>256.438,95</b>   | <b>480.714,02</b>                                       | <b>422.982,08</b>                                       |
| <b>2.180.478.473,61</b>                               | <b>338.730.596,49</b>                           | <b>81.677.792,51</b>  | <b>34.039.280,52</b>                                    | <b>4.407.194,14</b>                                     |
| -   | -   | -   | -   | -   |
| <b>2.180.478.473,61</b>                               | <b>338.730.596,49</b>                           | <b>81.677.792,51</b>  | <b>34.039.280,52</b>                                    | <b>4.407.194,14</b>                                     |
| 1.728.532.113,20                                      | 282.665.011,54                                  | 77.452.895,27   | 36.513.082,57   | 4.333.751,94  |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nettovermögensaufstellung per 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Low Duration<br>European Covered<br>Bond Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Low Duration US<br>High Yield<br>Bond Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Nordic<br>Equity Fund<br>(in EUR) |
|--|---|--|---|
| <b>Aktiva</b>  |   |  |   |
| Aktien zum Marktwert (Anmerkung 2)   | -   | -  | 245.877.585,50                                  |
| Fonds zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -   | -  | -   |
| Anleihen zum Marktwert (Anmerkung 2)   | 7.245.691.095,34  | 117.963.772,80   | -   |
| Gekaufte Optionen zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -   | -  | -   |
| Bankguthaben   | 206.470.777,26  | 11.986.136,25  | 6.563.035,24                                    |
| Dividenden- und Zinsforderungen  | 33.654.485,72   | 1.450.862,57   | -   |
| Forderungen aus Anteilsverkäufen   | -   | -  | -   |
| Forderungen aus Anteilszeichnungen   | 148.665.673,22  | 99.986,50  | 247.476,49                                      |
| Forderungen aus Devisenterminkontrakten  | 2.744.231,87  | 150.796,15   | 7.015,32  |
| Sonstige Nettoforderungen (Anmerkung 2p)   | 682.537,91  | -  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)   | -   | -  | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)                      | -   | -  | -   |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                 | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                           | -   | -  | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)        | 46.915.867,04   | 31.875,04  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswaps (Anmerkung 2)  | 20.301.896,35   | -  | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                              | -   | 333.185,07   | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2)  | 136,64  | -  | -   |
|  | <b>7.705.126.701,35</b>   | <b>132.016.614,38</b>  | <b>252.695.112,55</b>                           |
| <b>Passiva</b>   |   |  |   |
| Aufwandsabgrenzung   | 8.046.695,84  | 340.429,25   | 1.023.354,26                                    |
| Verbindlichkeiten aus Zinsforderungen  | -   | -  | 2.338,74  |
| Verbindlichkeiten aus Devisenterminkontrakten  | 2.745.681,35  | 150.928,48   | 7.013,33  |
| Verbindlichkeiten aus Anteilskäufen  | -   | -  | -   |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen  | 32.039.764,77   | 134.967,20   | 389.100,99                                      |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)   | -   | -  | -   |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten (Anmerkung 2p)   | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Equity Swaps (Anmerkung 2)  | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)                                  | -   | -  | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)               | -   | -  | -   |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | 7.956.866,83  | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                | 1.542.212,69  | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                          | 734.723,18  | 3.749,60   | -   |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)       | -   | -  | -   |
| Zinsswaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)   | 368.000,00  | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswaps (Anmerkung 2)   | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)                                  | -   | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                             | 5.634.405,97  | -  | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2) | -   | 414,09   | 5,30  |
|  | <b>59.068.350,63</b>  | <b>630.488,62</b>  | <b>1.421.812,62</b>                             |
| <b>Summe Nettovermögen - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>  | <b>7.646.058.350,72</b>   | <b>131.386.125,76</b>  | <b>251.273.299,93</b>                           |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung  | -   | -  | -   |
| <b>Summe Nettovermögen - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>   | <b>7.646.058.350,72</b>   | <b>131.386.125,76</b>  | <b>251.273.299,93</b>                           |
| Wertpapiere zum Anschaffungspreis  | 7.323.516.589,97  | 118.274.488,26   | 192.034.363,32                                  |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Nordic Equity<br>Small Cap Fund | Nordea 1 -<br>Nordic Ideas<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Nordic Stars<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>North American<br>High Yield Bond Fund | Nordea 1 -<br>North American High<br>Yield Stars Bond Fund<br>(Anmerkung 1a) |
|---|---|---|--|--|
| (in EUR)                                      | (in EUR)                                  | (in EUR)                                  | (in USD)   | (in USD)   |
| 174.260.323,90                                | 76.992.222,53                             | 245.030.845,17                            | 5.657.931,81   | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | 732.035.229,52                                       | 719.865.575,75   |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| 5.446.046,83                                  | 1.756.784,73                              | 6.629.296,46                              | 20.760.969,41  | 39.741.211,20  |
| -   | -   | -   | 10.828.592,71  | 10.100.332,21  |
| -   | 78.072,41                                 | -   | -  | -  |
| 416.842,85                                    | 130.628,54                                | 398.778,77                                | 30.836,58  | 1.565.190,42   |
| 20.133,72                                     | 115.479,59                                | 213.018,22                                | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| 4.521,16                                      | -   | -   | -  | -  |
| 111.220,63                                    | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | 1.486.628,00   | 3.411.375,25   |
| 41,28   | -   | 77,63                                     | -  | -  |
| <b>180.259.130,37</b>                         | <b>79.073.187,80</b>                      | <b>252.272.016,25</b>                     | <b>770.800.188,03</b>                                | <b>774.683.684,83</b>  |
| 746.739,10                                    | 353.089,24                                | 694.951,17                                | 1.053.449,36   | 167.267,87   |
| 2.246,53                                      | 816,29                                    | 2.061,40                                  | -  | -  |
| 20.189,14                                     | 115.552,06                                | 213.180,92                                | -  | -  |
| 24.342,20                                     | -   | -   | -  | -  |
| 556.441,91                                    | 176.895,90                                | 116.684,33                                | 5.826,00   | 278.971,24   |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| 1.253,90                                      | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| -   | 43,92                                     | -   | 0,88   | 1,73   |
| <b>1.351.212,78</b>                           | <b>646.397,41</b>                         | <b>1.026.877,82</b>                       | <b>1.059.276,24</b>                                  | <b>446.240,84</b>  |
| <b>178.907.917,59</b>                         | <b>78.426.790,39</b>                      | <b>251.245.138,43</b>                     | <b>769.740.911,79</b>                                | <b>774.237.443,99</b>  |
| -   | -   | -   | -  | -  |
| <b>178.907.917,59</b>                         | <b>78.426.790,39</b>                      | <b>251.245.138,43</b>                     | <b>769.740.911,79</b>                                | <b>774.237.443,99</b>  |
| 105.095.102,51                                | 59.696.898,29                             | 200.504.680,63                            | 712.779.067,71                                       | 717.481.611,67   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nettovermögensaufstellung per 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>North American<br>Small Cap Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>North American<br>Stars Equity Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>North American<br>Value Fund<br>(in USD) |
|--|--|---|--|
| <b>Aktiva</b>  |  |   |  |
| Aktien zum Marktwert (Anmerkung 2)   | 48.746.914,17  | 2.032.507.097,20  | 343.894.116,30   |
| Fonds zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -  | -   | -  |
| Anleihen zum Marktwert (Anmerkung 2)   | -  | -   | -  |
| Gekaufte Optionen zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -  | -   | -  |
| Bankguthaben   | 2.495.242,46   | 19.739.199,54   | 1.190.344,90   |
| Dividenden- und Zinsforderungen  | 24.414,65  | 829.632,49  | 23.575,33  |
| Forderungen aus Anteilsverkäufen   | 7.341,41   | -   | -  |
| Forderungen aus Anteilszeichnungen   | 77.007,49  | 1.732.397,93  | 42.776,54  |
| Forderungen aus Devisenterminkontrakten  | 145.913,32   | 1.768.313,79  | 26.802,19  |
| Sonstige Nettoforderungen (Anmerkung 2p)   | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)   | -  | -   | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)                      | -  | -   | -  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                 | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                           | -  | -   | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)        | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswaps (Anmerkung 2)  | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                              | 14.181,02  | 227.505,13  | 52.112,89  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2)  | 399,96   | 2.200,31  | -  |
|  | <b>51.511.414,48</b>                                       | <b>2.056.806.346,39</b>                                       | <b>345.229.728,15</b>                                  |
| <b>Passiva</b>   |  |   |  |
| Aufwandsabgrenzung   | 218.969,39   | 4.233.741,98  | 1.472.458,04   |
| Verbindlichkeiten aus Zinsforderungen  | -  | -   | -  |
| Verbindlichkeiten aus Devisenterminkontrakten  | 145.958,08   | 1.768.341,03  | 26.795,16  |
| Verbindlichkeiten aus Anteilskäufen  | -  | -   | -  |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen  | 267.272,95   | 2.114.340,01  | 259.469,62   |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)   | -  | -   | -  |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten (Anmerkung 2p)   | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Equity Swaps (Anmerkung 2)  | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)                                  | -  | -   | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)               | -  | -   | -  |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                          | -  | -   | -  |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)       | -  | -   | -  |
| Zinsswaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)   | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswaps (Anmerkung 2)   | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)                                  | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                             | -  | -   | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2) | -  | -   | 176,28   |
|  | <b>632.200,42</b>  | <b>8.116.423,02</b>   | <b>1.758.899,10</b>                                    |
| <b>Summe Nettovermögen - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>  | <b>50.879.214,06</b>                                       | <b>2.048.689.923,37</b>                                       | <b>343.470.829,05</b>                                  |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung  | -  | -   | -  |
| <b>Summe Nettovermögen - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>   | <b>50.879.214,06</b>                                       | <b>2.048.689.923,37</b>                                       | <b>343.470.829,05</b>                                  |
| Wertpapiere zum Anschaffungspreis  | 40.527.056,26  | 1.623.618.834,54  | 296.264.122,14   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Norwegian<br>Bond Fund<br>(in NOK) | Nordea 1 -<br>Norwegian<br>Equity Fund<br>(in NOK) | Nordea 1 -<br>Norwegian Short-Term<br>Bond Fund<br>(in NOK) | Nordea 1 -<br>Stable Emerging<br>Markets Equity Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Stable<br>Return Fund<br>(in EUR) |
|--|--|---|--|---|
| -  | 1.046.912.890,32                                   | -   | 457.385.094,20   | 6.245.621.716,70                                |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| 4.907.947.274,75                                 | -  | 4.325.594.649,70  | -  | 1.109.771.135,90                                |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| 57.413.932,41                                    | 9.118.013,34                                       | 27.347.307,62   | 3.693.150,84   | 353.857.435,52                                  |
| 46.296.366,93                                    | 1.015,18   | 8.326.992,29  | 1.963.716,22   | 11.494.374,87                                   |
| -  | -  | -   | -  | 1.157.191,31                                    |
| 4.189.475,56                                     | 1.802.879,96                                       | 498.462,88  | 2.964.900,42   | 10.175.194,69                                   |
| 418.950,56                                       | 1.119.902,09                                       | 2.239.246,38  | 3.127.363,67   | 4.435.438,89                                    |
| -  | -  | 611.908,89  | -  | 5.878.707,16                                    |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | 28.935.007,62                                   |
| -  | -  | -   | -  | 518.104,77                                      |
| -  | -  | -   | -  | 2.332.821,09                                    |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| 318.388,75                                       | -  | 1.465,90  | -  | 7.507,17  |
| <b>5.016.584.388,96</b>                          | <b>1.058.954.700,89</b>                            | <b>4.364.620.033,66</b>                                     | <b>469.134.225,35</b>  | <b>7.774.184.635,69</b>                         |
| 8.725.618,04                                     | 4.606.644,36                                       | 3.626.848,07  | 1.049.697,97   | 28.256.921,01                                   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| 418.782,28                                       | 1.118.018,39                                       | 2.241.234,22  | 3.125.656,24   | 4.416.180,90                                    |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| 43.301.136,76                                    | 1.776.350,96                                       | 5.495.097,81  | 353.016,67   | 11.705.343,85                                   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | 1.735.150,92   | -   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | 12.982.425,57                                   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| 39.561.771,26                                    | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| -  | -  | -   | -  | 30.399.050,34                                   |
| -  | 1.340,63   | -   | 9.227,21   | -   |
| <b>92.007.308,34</b>                             | <b>7.502.354,34</b>                                | <b>11.363.180,10</b>  | <b>6.272.749,01</b>  | <b>87.759.921,67</b>                            |
| <b>4.924.577.080,62</b>                          | <b>1.051.452.346,55</b>                            | <b>4.353.256.853,56</b>                                     | <b>462.861.476,34</b>  | <b>7.686.424.714,02</b>                         |
| -  | -  | -   | -  | -   |
| <b>4.924.577.080,62</b>                          | <b>1.051.452.346,55</b>                            | <b>4.353.256.853,56</b>                                     | <b>462.861.476,34</b>  | <b>7.686.424.714,02</b>                         |
| 4.910.549.879,24                                 | 761.500.695,71                                     | 4.320.469.244,76  | 478.410.417,49   | 5.715.072.145,22                                |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nettovermögensaufstellung per 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Swedish<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>Swedish Short-Term<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>US Corporate<br>Bond Fund |
|--|------------------------------------|---|---|
|  | (in SEK)                           | (in SEK)                                      | (in USD)                                |
| <b>Aktiva</b>  |                                    |   |   |
| Aktien zum Marktwert (Anmerkung 2)   | -                                  | -   | -                                       |
| Fonds zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -                                  | -   | -                                       |
| Anleihen zum Marktwert (Anmerkung 2)   | 698.123.470,00                     | 1.186.382.110,00                              | 2.195.561.412,42                        |
| Gekaufte Optionen zum Marktwert (Anmerkung 2)  | -                                  | -   | -                                       |
| Bankguthaben   | 7.462.185,81                       | 2.344.380,00                                  | 33.935.963,97                           |
| Dividenden- und Zinsforderungen  | 3.646.927,56                       | 2.649.318,04                                  | 18.893.729,42                           |
| Forderungen aus Anteilsverkäufen   | -                                  | -   | -                                       |
| Forderungen aus Anteilszeichnungen   | 642.436,06                         | 378.668,40                                    | 460.971,89                              |
| Forderungen aus Devisenterminkontrakten  | 539.002,47                         | 640.402,68                                    | 47.589,83                               |
| Sonstige Nettoforderungen (Anmerkung 2p)   | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)   | -                                  | -   | -                                       |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps (Anmerkung 2)                      | -                                  | -   | -                                       |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                 | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                           | -                                  | -   | 68.856,54                               |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)        | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswaps (Anmerkung 2)  | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                              | -                                  | -   | 2.455.915,56                            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2)  | -                                  | 434,29  | -                                       |
|  | <b>710.414.021,90</b>              | <b>1.192.395.313,41</b>                       | <b>2.251.424.439,63</b>                 |
| <b>Passiva</b>   |                                    |   |   |
| Aufwandsabgrenzung   | 1.509.171,06                       | 1.083.265,51                                  | 3.968.317,92                            |
| Verbindlichkeiten aus Zinsforderungen  | -                                  | -   | -                                       |
| Verbindlichkeiten aus Devisenterminkontrakten  | 538.136,66                         | 640.698,54                                    | 47.631,23                               |
| Verbindlichkeiten aus Anteilskäufen  | -                                  | -   | -                                       |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen  | 344.005,49                         | 1.320.481,35                                  | 1.083.244,62                            |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)   | -                                  | -   | -                                       |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten (Anmerkung 2p)   | 93.303,50                          | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Equity Swaps (Anmerkung 2)  | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)                                  | -                                  | -   | -                                       |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps (Anmerkung 2)               | -                                  | -   | -                                       |
| Credit Default Swaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)  | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swaps (Anmerkung 2)                                | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)                          | 167.086,50                         | -   | -                                       |
| Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) (Anmerkung 2)       | 124.835,50                         | -   | 1.712.390,64                            |
| Zinsswaps zum Einstandspreis (Anmerkung 2)   | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswaps (Anmerkung 2)   | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)                                  | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (Anmerkung 2)                             | -                                  | -   | -                                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Forderungen und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (Anmerkung 2) | 476,35                             | -   | 173,17                                  |
|  | <b>2.777.015,06</b>                | <b>3.044.445,40</b>                           | <b>6.811.757,58</b>                     |
| <b>Summe Nettovermögen - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>  | <b>707.637.006,84</b>              | <b>1.189.350.868,01</b>                       | <b>2.244.612.682,05</b>                 |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung  | -                                  | -   | -                                       |
| <b>Summe Nettovermögen - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>   | <b>707.637.006,84</b>              | <b>1.189.350.868,01</b>                       | <b>2.244.612.682,05</b>                 |
| Wertpapiere zum Anschaffungspreis  | 698.710.004,37                     | 1.190.180.658,07                              | 2.135.505.476,75                        |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



| Nordea 1 -<br>US Corporate Stars<br>Bond Fund<br>(Anmerkung 1a)<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>US High Yield<br>Bond Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>US Total Return<br>Bond Fund<br>(in USD) |
|---|--|--|
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| 1.423.121.898,76  | 637.988.318,09                                       | 678.100.913,89   |
| -   | -  | -  |
| 45.420.033,83   | 20.643.384,50  | 26.322.326,06  |
| 11.060.816,98   | 9.442.490,41   | 2.612.464,00   |
| -   | -  | -  |
| 5.144.994,23  | 95.526,29  | 275,32   |
| -   | -  | 30.712,31  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| 10.170.997,98   | 1.095.036,13   | 894.524,45   |
| -   | 0,52   | -  |
| <b>1.494.918.741,78</b>   | <b>669.264.755,94</b>                                | <b>707.961.216,03</b>                                  |
| 368.350,25  | 758.565,92   | 1.672.995,65   |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | 30.723,65  |
| -   | -  | -  |
| 459.703,32  | 50.931,82  | 313.167,53   |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| 78.203,12   | -  | -  |
| 675.390,63  | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| -   | -  | -  |
| 78,37   | -  | 30,71  |
| <b>1.581.725,69</b>   | <b>809.497,74</b>                                    | <b>2.016.917,54</b>                                    |
| <b>1.493.337.016,09</b>   | <b>668.455.258,20</b>                                | <b>705.944.298,49</b>                                  |
| -   | -  | -  |
| <b>1.493.337.016,09</b>   | <b>668.455.258,20</b>                                | <b>705.944.298,49</b>                                  |
| 1.445.261.256,01  | 628.658.818,71                                       | 704.175.765,00   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021

|  | Konsolidierte<br>Aufstellung | Nordea 1 -<br>Alpha 7 MA Fund | Nordea 1 -<br>Alpha 10 MA Fund |
|--|------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
|  | (in EUR)                     | (in EUR)                      | (in EUR)                       |
| <b>Summe Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>                                 | <b>75.569.551.058,55</b>     | <b>334.878.776,85</b>         | <b>3.694.239.157,70</b>        |
| <b>Bewertungsdifferenz zum gesamten Nettoanfangsvermögen (Anmerkung 2)</b>               | <b>1.857.387.384,18</b>      | -                             | -                              |
| <b>Konsolidiertes gesamtes Nettoanfangsvermögen zum Kurs am Jahresende</b>               | <b>77.426.938.442,74</b>     | -                             | -                              |
| <b>Erträge</b>   |                              |                               |                                |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | 711.662.182,96               | 4.212.138,77                  | 64.159.089,85                  |
| Nettozinsen aus Anleihen (Anmerkung 2)   | 926.596.443,65               | 1.584.373,94                  | 18.270.905,03                  |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 2.292,56                     | -                             | -                              |
| Nettozinsen aus Derivaten  | 62.228.985,58                | 348.590,70                    | 321.471,36                     |
| Nettozinsen aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 4)   | 1.853.854,63                 | -                             | -                              |
| Andere Erträge   | 28.372,53                    | 2,19                          | 14,90                          |
|  | <b>1.702.372.131,91</b>      | <b>6.145.105,60</b>           | <b>82.751.481,14</b>           |
| <b>Aufwendungen</b>  |                              |                               |                                |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | 3.817,98                     | -                             | -                              |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 18.418.362,12                | 363.568,43                    | 4.588.316,65                   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | 10.623.958,26                | -                             | -                              |
| Rechnungsprüfungs-, Rechts-, Registrierungs-, Verwaltungsrats- sowie andere Kosten       | 7.252.715,76                 | 35.968,83                     | 367.150,03                     |
| Honorar für die zentrale Verwaltung (Anmerkung 3b)                                       | 118.074.847,64               | 278.109,56                    | 5.724.638,93                   |
| Verwahrstellengebühr (Anmerkung 3b)  | 10.540.775,26                | 36.842,94                     | 377.496,04                     |
| Vertriebsgebühren E- und HE-Anteile (Anmerkung 3c)                                       | 16.929.262,27                | 81.107,84                     | 772.423,67                     |
| Verwaltungsgebühr (Anmerkung 3a)   | 636.760.987,53               | 1.440.694,46                  | 40.622.193,86                  |
| Kosten für Druck, Veröffentlichung und Internet (Anmerkung 3b)                           | 5.534.626,10                 | 9.920,51                      | 290.460,14                     |
| Taxe d'abonnement (Anmerkung 3b)   | 22.096.153,17                | 72.975,79                     | 1.170.735,11                   |
| Transaktionsbezogene Kosten (Anmerkung 11)   | 12.501.988,95                | 178.064,00                    | 2.059.446,62                   |
|  | <b>858.737.495,05</b>        | <b>2.497.252,36</b>           | <b>55.972.861,05</b>           |
| <b>Nettoertrag/(-verlust)</b>  | <b>843.634.636,86</b>        | <b>3.647.853,24</b>           | <b>26.778.620,09</b>           |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren                                     | 3.751.100.795,65             | 9.874.076,70                  | 138.196.353,80                 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps                                     | 402.056.830,98               | -                             | 205.768.595,98                 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps                             | (16.292.478,92)              | (938.216,00)                  | (13.832.006,63)                |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures)                       | (935.264.099,08)             | (22.625.470,34)               | (183.570.996,24)               |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps  | 51.064.422,71                | -                             | -                              |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen   | 223.624,74                   | 6.865,56                      | 86.321,12                      |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten                          | (932.320.233,90)             | (15.000.863,95)               | (99.922.162,90)                |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen                                   | 22.217.224,25                | 2.440.671,13                  | 9.357.213,05                   |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>   | <b>3.186.420.723,28</b>      | <b>(22.595.083,66)</b>        | <b>82.861.938,27</b>           |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren                 | 3.404.041.436,34             | 66.609.419,70                 | 514.955.876,75                 |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps                 | 119.721.614,59               | -                             | 9.228.783,09                   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps         | (31.761.245,37)              | 188.228,74                    | 2.514.467,37                   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Terminkontrakten (Futures)   | 65.506.566,39                | (1.447.875,13)                | (16.532.346,54)                |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps                    | 27.219.032,17                | -                             | -                              |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen                     | 9.273,73                     | 270,71                        | 3.877,07                       |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Devisenterminkontrakten      | (580.808.723,06)             | (12.506.201,60)               | (104.955.920,06)               |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen               | (218.830,07)                 | (250,60)                      | (10.092,07)                    |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Pensionsgeschäften           | (73.656,60)                  | -                             | -                              |
| <b>Nettoerhöhung/(-minderung) des Nettovermögens gemäß Ertrags- und Aufwandsrechnung</b> | <b>6.190.056.191,40</b>      | <b>30.248.508,16</b>          | <b>488.066.583,88</b>          |
| Auflösung der Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                                      | (343.342,93)                 | -                             | -                              |
| <b>Veränderungen im gezeichneten Kapital</b>   |                              |                               |                                |
| Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen  | 42.813.353.091,26            | 243.187.001,60                | 2.293.367.585,52               |
| Zahlungen durch Rücknahme von Anteilen   | (33.691.248.444,26)          | (76.892.755,35)               | (1.379.695.648,72)             |
| Gezahlte Dividenden (Anmerkung 12)   | (134.398.130,10)             | (31,07)                       | (2.481.548,67)                 |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>                   | <b>92.604.357.808,11</b>     | <b>531.421.500,19</b>         | <b>5.093.496.129,71</b>        |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                               | -                            | -                             | -                              |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>                  | <b>92.604.357.808,11</b>     | <b>531.421.500,19</b>         | <b>5.093.496.129,71</b>        |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Alpha 15 MA Fund<br><br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Asia ex Japan<br>Equity Fund<br><br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Asian Stars<br>Equity Fund<br><br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Balanced<br>Income Fund<br><br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Chinese Bond Fund<br>(Anmerkung 1c)<br><br>(in CNH) |
|--|--|--|---|---|
| <b>2.801.545.792,43</b>                        | <b>116.314.246,28</b>                                      | <b>214.838.594,64</b>                                    | <b>552.844.557,60</b>                                 | <b>105.480.166,89</b>   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| 86.278.129,22                                  | 2.338.315,03   | 3.919.844,08   | 801.078,98  | -   |
| 13.980.492,02                                  | -  | -  | 3.694.277,16  | 9.089.830,88  |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| -  | -  | -  | 6.331.271,24  | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| 12,48  | 2,75   | 0,05   | 2,91  | 2,39  |
| <b>100.258.633,72</b>                          | <b>2.338.317,78</b>  | <b>3.919.844,13</b>                                      | <b>10.826.630,29</b>                                  | <b>9.089.833,27</b>   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| 4.618.515,29                                   | 109,33   | 108,45   | 118.982,35  | 765,83  |
| 431.263,38                                     | -  | -  | -   | -   |
| 336.199,46                                     | 10.490,36  | 20.692,41  | 49.866,86   | 22.513,66   |
| 4.955.999,67                                   | 232.549,67   | 375.707,42   | 503.244,66  | 371.485,74  |
| 403.231,29                                     | 58.448,83  | 73.495,93  | 79.837,64   | 26.169,02   |
| 1.873.356,54                                   | 35.434,65  | 230,63   | 87.043,30   | 48.210,81   |
| 40.449.209,30                                  | 1.642.402,90   | 3.023.968,59   | 2.639.296,31  | 1.094.580,61  |
| 146.564,21                                     | 15.887,25  | 2.935,89   | 46.181,07   | 4.999,89  |
| 814.126,06                                     | 48.481,32  | 100.382,46   | 169.347,99  | 43.360,72   |
| 2.311.587,10                                   | 46.782,34  | 28.050,25  | 187.595,89  | 65.493,08   |
| <b>56.340.052,30</b>                           | <b>2.090.586,65</b>  | <b>3.625.572,03</b>                                      | <b>3.881.396,07</b>                                   | <b>1.677.579,36</b>   |
| <b>43.918.581,42</b>                           | <b>247.731,13</b>  | <b>294.272,10</b>  | <b>6.945.234,22</b>                                   | <b>7.412.253,91</b>   |
| 89.666.621,62                                  | 13.121.838,34  | 10.938.688,97  | (507.430,63)  | 461.195,86  |
| 199.904.846,06                                 | -  | -  | -   | -   |
| (18.716.464,47)                                | -  | -  | 2.221.526,17  | -   |
| (80.706.982,83)                                | -  | -  | 23.049.077,50   | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| 130.438,06                                     | -  | -  | -   | -   |
| (119.908.931,11)                               | (121.923,13)   | 33.384,16  | (15.168.499,39)                                       | (8.823.688,40)  |
| 16.462.798,57                                  | (70.784,62)  | (61.702,02)  | 909.316,31  | (276.770,78)  |
| <b>130.750.907,32</b>                          | <b>13.176.861,72</b>                                       | <b>11.204.643,21</b>                                     | <b>17.449.224,18</b>                                  | <b>(1.227.009,41)</b>   |
| 547.397.599,42                                 | (18.293.265,51)  | (34.108.309,64)  | 8.223.527,22  | 7.664.850,40  |
| 109.171.845,21                                 | -  | -  | -   | -   |
| 3.627.080,85                                   | -  | -  | (3.114.621,09)  | -   |
| (33.870.589,88)                                | -  | -  | 2.014.296,98  | -   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| 5.125,95                                       | -  | -  | -   | -   |
| (79.261.805,56)                                | 19.663,24  | -  | (12.821.527,31)                                       | (1.434.597,97)  |
| (10.189,63)                                    | (2.291,33)   | (192,20)   | 181,26  | 390,77  |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| <b>677.809.973,68</b>                          | <b>(5.099.031,88)</b>                                      | <b>(22.903.858,63)</b>                                   | <b>11.751.081,24</b>                                  | <b>5.003.633,79</b>   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| 2.545.807.342,50                               | 68.972.791,29  | 113.159.036,46   | 175.046.844,10  | 284.906.028,89  |
| (1.054.740.148,62)                             | (79.663.198,61)  | (67.158.891,76)  | (136.509.238,56)                                      | (50.049.671,40)   |
| (1.767.296,33)                                 | (25.767,61)  | -  | (14.775,81)   | (754,68)  |
| <b>4.968.655.663,66</b>                        | <b>100.499.039,47</b>                                      | <b>237.934.880,71</b>                                    | <b>603.118.468,57</b>                                 | <b>345.339.403,49</b>   |
| -  | -  | -  | -   | -   |
| <b>4.968.655.663,66</b>                        | <b>100.499.039,47</b>                                      | <b>237.934.880,71</b>                                    | <b>603.118.468,57</b>                                 | <b>345.339.403,49</b>   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Chinese<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Conservative Fixed<br>Income Fund | Nordea 1 -<br>Danish Covered<br>Bond Fund |
|--|--------------------------------------|---|---|
|  | (in USD)                             | (in EUR)  | (in DKK)                                  |
| <b>Summe Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>                                 | <b>344.614.085,03</b>                | <b>120.900.763,38</b>                           | <b>8.156.540.148,18</b>                   |
| <b>Bewertungsdifferenz zum gesamten Nettoanfangsvermögen (Anmerkung 2)</b>               | -                                    | -   | -   |
| <b>Konsolidiertes gesamtes Nettoanfangsvermögen zum Kurs am Jahresende</b>               | -                                    | -   | -   |
| <b>Erträge</b>   |                                      |   |   |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | 4.204.600,68                         | 103.803,95                                      | -   |
| Nettozinsen aus Anleihen (Anmerkung 2)   | -                                    | 398.136,40                                      | 97.394.013,67                             |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | -                                    | -   | -   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -                                    | 655.908,06                                      | -   |
| Nettozinsen aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 4)   | -                                    | -   | -   |
| Andere Erträge   | 2,03                                 | 0,01  | 13,16                                     |
|  | <b>4.204.602,71</b>                  | <b>1.157.848,42</b>                             | <b>97.394.026,83</b>                      |
| <b>Aufwendungen</b>  |                                      |   |   |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | -                                    | -   | -   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 334,65                               | 22.807,86                                       | 2.429.296,02                              |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -                                    | -   | 4.915.885,75                              |
| Rechnungsprüfungs-, Rechts-, Registrierungs-, Verwaltungsrats- sowie andere Kosten       | 30.213,22                            | 10.825,18                                       | 729.148,97                                |
| Honorar für die zentrale Verwaltung (Anmerkung 3b)                                       | 124.611,30                           | 31.691,03                                       | 8.900.370,67                              |
| Verwahrstellengebühr (Anmerkung 3b)  | 34.876,84                            | 12.102,17                                       | 959.140,47                                |
| Vertriebsgebühren E- und HE-Anteile (Anmerkung 3c)                                       | 35.297,62                            | -   | 200.613,30                                |
| Verwaltungsgebühr (Anmerkung 3a)   | 258.721,08                           | 803,95  | 28.392.193,83                             |
| Kosten für Druck, Veröffentlichung und Internet (Anmerkung 3b)                           | 2.872,50                             | 0,76  | 227.024,40                                |
| Taxe d'abonnement (Anmerkung 3b)   | 40.838,11                            | 12.649,00                                       | 1.367.780,02                              |
| Transaktionsbezogene Kosten (Anmerkung 11)   | 57.152,01                            | 14.508,04                                       | 2.092.478,74                              |
|  | <b>584.917,33</b>                    | <b>105.387,99</b>                               | <b>50.213.932,17</b>                      |
| <b>Nettoertrag/(-verlust)</b>  | <b>3.619.685,38</b>                  | <b>1.052.460,43</b>                             | <b>47.180.094,66</b>                      |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren                                     | 18.390.999,96                        | (526.740,26)                                    | (905.000,41)                              |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps                                     | -                                    | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps                             | -                                    | 418.871,07                                      | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures)                       | -                                    | (77.863,69)                                     | (24.835.832,48)                           |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps  | -                                    | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen   | -                                    | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten                          | 7.845,98                             | (647.664,92)                                    | (28.441.752,75)                           |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen                                   | (128.867,62)                         | 34.207,13                                       | 14.180.649,76                             |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>   | <b>21.889.663,70</b>                 | <b>253.269,76</b>                               | <b>7.178.158,78</b>                       |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren                 | (98.037.750,49)                      | 273.575,55                                      | (388.392.728,86)                          |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps                 | -                                    | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps         | -                                    | (358.761,42)                                    | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Terminkontrakten (Futures)   | -                                    | 404.637,80                                      | (13.834.474,82)                           |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps                    | -                                    | -   | 47.152.342,74                             |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen                     | -                                    | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Devisenterminkontrakten      | -                                    | (94.710,43)                                     | 7.916.032,96                              |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen               | (228,13)                             | (13,17)   | (15.213,77)                               |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Pensionsgeschäften           | -                                    | -   | -   |
| <b>Nettoerhöhung/(-minderung) des Nettovermögens gemäß Ertrags- und Aufwandsrechnung</b> | <b>(76.148.314,92)</b>               | <b>477.998,09</b>                               | <b>(339.995.882,97)</b>                   |
| Auflösung der Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                                      | -                                    | -   | -   |
| <b>Veränderungen im gezeichneten Kapital</b>   |                                      |   |   |
| Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen  | 153.177.539,67                       | 64.609.498,04                                   | 2.555.927.371,34                          |
| Zahlungen durch Rücknahme von Anteilen   | (146.489.077,04)                     | (60.064.737,02)                                 | (2.062.444.167,53)                        |
| Gezahlte Dividenden (Anmerkung 12)   | -                                    | -   | (52.828.952,50)                           |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>                   | <b>275.154.232,74</b>                | <b>125.923.522,49</b>                           | <b>8.257.198.516,52</b>                   |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                               | -                                    | -   | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>                  | <b>275.154.232,74</b>                | <b>125.923.522,49</b>                           | <b>8.257.198.516,52</b>                   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Emerging Market<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Market Bond<br>Opportunities Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Market<br>Corporate Bond Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Markets Debt<br>Total Return Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Markets<br>Small Cap Fund<br>(Anmerkung 1b) |
|--|--|--|--|--|
| (in USD)                                   | (in USD)   | (in USD)   | (in USD)   | (in USD)   |
| 1.947.056.158,81                           | 111.078.304,13   | 216.329.408,53                                       | 72.567.478,94  | 21.354.870,52  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | -  | 278.105,79   |
| 80.332.007,29                              | 4.526.017,69   | 11.641.526,72  | 4.452.106,29   | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | 1.235.268,40   | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| 6,00                                       | 0,08   | 2,25   | 0,07   | 0,19   |
| <b>80.332.013,29</b>                       | <b>4.526.017,77</b>                                      | <b>11.641.528,97</b>                                 | <b>5.687.374,76</b>                                      | <b>278.105,98</b>  |
| -  | -  | -  | 4.324,44   | -  |
| 22.014,53                                  | 911,25   | 10.743,52  | 12.095,78  | 651,57   |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| 135.241,41                                 | 7.562,64   | 19.217,38  | 8.574,48   | 1.429,89   |
| 2.748.226,22                               | 139.131,06   | 307.169,18   | 37.445,72  | 32.612,12  |
| 109.527,91                                 | 22.978,15  | 19.924,82  | 31.621,01  | 8.953,67   |
| 192.156,56                                 | 9.120,39   | 45.873,89  | 2.244,40   | 3.583,77   |
| 9.699.093,61                               | 610.365,99   | 1.401.783,68   | 75.221,53  | 191.412,73   |
| 59.792,34                                  | 575,92   | 13.322,27  | 385,35   | 1.033,20   |
| 282.994,15                                 | 9.166,74   | 55.381,14  | 11.121,91  | 3.386,62   |
| 397.119,78                                 | 27.393,23  | 82.089,58  | 53.433,93  | 33.667,10  |
| <b>13.646.166,51</b>                       | <b>827.205,37</b>  | <b>1.955.505,46</b>                                  | <b>236.468,55</b>  | <b>276.730,67</b>  |
| <b>66.685.846,78</b>                       | <b>3.698.812,40</b>                                      | <b>9.686.023,51</b>                                  | <b>5.450.906,21</b>                                      | <b>1.375,31</b>  |
| (47.346.093,89)                            | (5.076.372,34)   | 8.401.264,37   | (4.999.149,74)   | 5.853.269,48   |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | 122.106,25   | -  |
| -  | -  | -  | 10.776,38  | -  |
| -  | -  | -  | (1.254.062,30)   | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| (33.654.659,78)                            | (867.485,93)   | (10.011.922,62)                                      | (2.131.957,25)   | 312,24   |
| (6.544.692,59)                             | (129.185,47)   | (1.203.912,56)                                       | (530.671,63)   | 87.379,09  |
| <b>(20.859.599,48)</b>                     | <b>(2.374.231,34)</b>                                    | <b>6.871.452,70</b>                                  | <b>(3.332.052,08)</b>                                    | <b>5.942.336,12</b>  |
| (65.349.541,53)                            | (3.801.559,90)   | (16.380.030,10)                                      | (3.997.285,96)   | (4.287.011,46)   |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | (339.328,77)   | -  |
| -  | -  | -  | (104.204,57)   | -  |
| -  | -  | -  | (2.890.009,80)   | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| (35.515.715,73)                            | (1.207.888,63)   | (4.750.231,96)                                       | 577.979,77   | -  |
| (518,00)                                   | (135,99)   | 794,69   | 17.846,55  | (531,49)   |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| <b>(121.725.374,74)</b>                    | <b>(7.383.815,86)</b>                                    | <b>(14.258.014,67)</b>                               | <b>(10.067.054,86)</b>                                   | <b>1.654.793,17</b>  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| 434.889.449,67                             | 917.862,26   | 118.982.339,91                                       | 82.658.995,38  | 9.536.779,36   |
| (1.050.934.322,76)                         | (42.351.243,58)  | (97.836.507,33)                                      | (54.092.258,91)  | (32.546.443,05)  |
| (17.642.340,11)                            | -  | (77.929,64)  | -  | -  |
| <b>1.191.643.570,87</b>                    | <b>62.261.106,95</b>                                     | <b>223.139.296,80</b>                                | <b>91.067.160,55</b>                                     | <b>-</b>   |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| <b>1.191.643.570,87</b>                    | <b>62.261.106,95</b>                                     | <b>223.139.296,80</b>                                | <b>91.067.160,55</b>                                     | <b>-</b>   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Emerging Stars<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Stars<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Stars<br>Local Bond Fund |
|--|---|---|---|
|  | (in USD)                                  | (in USD)                                    | (in USD)  |
| <b>Summe Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>                                 | <b>1.098.501.306,61</b>                   | <b>6.042.784.402,27</b>                     | <b>60.168.951,30</b>                            |
| <b>Bewertungsdifferenz zum gesamten Nettoanfangsvermögen (Anmerkung 2)</b>               | -   | -   | -   |
| <b>Konsolidiertes gesamtes Nettoanfangsvermögen zum Kurs am Jahresende</b>               | -   | -   | -   |
| <b>Erträge</b>   |   |   |   |
| Nett dividenden (Anmerkung 2)  | -   | 108.237.461,33                              | -   |
| Nettozinsen aus Anleihen (Anmerkung 2)   | 60.639.434,48                             | -   | 3.233.608,05                                    |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | -   | -   | 2.596,67  |
| Nettozinsen aus Derivaten  | 396.549,60                                | -   | 32.069,33                                       |
| Nettozinsen aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 4)   | -   | -   | -   |
| Andere Erträge   | 2,28                                      | 18,00                                       | 0,06  |
|  | <b>61.035.986,36</b>                      | <b>108.237.479,33</b>                       | <b>3.268.274,11</b>                             |
| <b>Aufwendungen</b>  |   |   |   |
| Nett dividenden (Anmerkung 2)  | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 45.157,80                                 | 6.143,97                                    | -   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -   | -   | -   |
| Rechnungsprüfungs-, Rechts-, Registrierungs-, Verwaltungsrats- sowie andere Kosten       | 115.293,76                                | 538.199,60                                  | 5.794,39  |
| Honorar für die zentrale Verwaltung (Anmerkung 3b)                                       | 1.630.270,86                              | 10.708.231,59                               | 67.588,21                                       |
| Verwahrstellengebühr (Anmerkung 3b)  | 165.914,50                                | 1.799.563,65                                | 36.907,67                                       |
| Vertriebsgebühren E- und HE-Anteile (Anmerkung 3c)                                       | 5.609,65                                  | 388.638,23                                  | 2.258,34  |
| Verwaltungsgebühr (Anmerkung 3a)   | 5.451.375,28                              | 68.017.508,20                               | 249.229,25                                      |
| Kosten für Druck, Veröffentlichung und Internet (Anmerkung 3b)                           | 25.342,63                                 | 520.653,70                                  | 765,89  |
| Taxe d'abonnement (Anmerkung 3b)   | 211.352,27                                | 1.856.761,38                                | 8.809,37  |
| Transaktionsbezogene Kosten (Anmerkung 11)   | 299.226,74                                | 271.541,34                                  | 15.475,73                                       |
|  | <b>7.949.543,49</b>                       | <b>84.107.241,66</b>                        | <b>386.828,85</b>                               |
| <b>Nettoertrag/(-verlust)</b>  | <b>53.086.442,87</b>                      | <b>24.130.237,67</b>                        | <b>2.881.445,26</b>                             |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren                                     | (14.878.197,97)                           | 346.284.608,06                              | (2.440.275,12)                                  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps                                     | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps                             | 472.014,19                                | -   | 103.195,79                                      |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures)                       | (570.947,29)                              | (10.471.825,66)                             | 67.142,21                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps  | (781.012,12)                              | -   | (79.396,35)                                     |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen   | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten                          | (43.201.605,00)                           | (7.502.019,86)                              | (402.285,50)                                    |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen                                   | (3.459.310,87)                            | (1.299.566,14)                              | (244.693,32)                                    |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>   | <b>(9.332.616,19)</b>                     | <b>351.141.434,07</b>                       | <b>(114.867,03)</b>                             |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren                 | (68.405.234,24)                           | (1.029.967.168,46)                          | (6.577.813,25)                                  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps                 | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps         | (326.423,40)                              | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Terminkontrakten (Futures)   | (1.012.813,10)                            | -   | (19.188,77)                                     |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps                    | (373.178,92)                              | -   | (233.472,85)                                    |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen                     | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Devisenterminkontrakten      | (7.350.335,98)                            | (1.065.248,48)                              | 136.418,99                                      |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen               | 166,32                                    | (36.477,75)                                 | 16.557,11                                       |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Pensionsgeschäften           | -   | -   | -   |
| <b>Nettoerhöhung/(-minderung) des Nettovermögens gemäß Ertrags- und Aufwandsrechnung</b> | <b>(86.800.435,51)</b>                    | <b>(679.927.460,62)</b>                     | <b>(6.792.365,80)</b>                           |
| Auflösung der Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                                      | -   | -   | -   |
| <b>Veränderungen im gezeichneten Kapital</b>   |   |   |   |
| Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen  | 1.012.105.100,05                          | 2.780.199.196,96                            | 26.008.250,26                                   |
| Zahlungen durch Rücknahme von Anteilen   | (452.035.095,99)                          | (2.301.030.678,22)                          | (15.518.276,29)                                 |
| Gezahlte Dividenden (Anmerkung 12)   | (548,91)                                  | (2.111.532,54)                              | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>                   | <b>1.571.770.326,25</b>                   | <b>5.839.913.927,85</b>                     | <b>63.866.559,47</b>                            |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                               | -   | -   | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>                  | <b>1.571.770.326,25</b>                   | <b>5.839.913.927,85</b>                     | <b>63.866.559,47</b>                            |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Emerging Wealth<br>Equity Fund<br>(Anmerkung 1b)<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European Corporate<br>Bond Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European Corporate<br>Bond Fund Plus<br>(Anmerkung 1b)<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European Corporate<br>Stars Bond Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European Covered<br>Bond Fund<br>(in EUR) |
|--|---|--|---|---|
| 142.857.697,16   | 592.754.401,21  | 93.564.042,08  | 563.876.499,76  | 7.512.639.694,36  |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| 1.151.486,86   | -   | -  | -   | -   |
| -  | 6.382.451,02  | 770.295,54   | 9.925.675,13  | 53.849.336,44   |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| -  | 317.435,17  | 66.649,35  | -   | -   |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| 1,49   | 2,14  | -  | 3,13  | 22,10   |
| <b>1.151.488,35</b>  | <b>6.699.888,33</b>                                       | <b>836.944,89</b>  | <b>9.925.678,26</b>   | <b>53.849.358,54</b>                                    |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| 15.458,70  | 94.800,42   | 14.651,31  | 217.456,74  | 783.969,13  |
| -  | -   | -  | -   | 1.127.585,30  |
| 12.383,19  | 47.590,11   | 5.822,32   | 74.976,75   | 575.794,54  |
| 143.142,51   | 481.261,14  | 26.733,28  | 359.949,86  | 7.808.250,39  |
| 29.141,37  | 45.180,92   | 5.263,96   | 64.174,40   | 1.845.032,69  |
| 28.319,84  | 36.315,88   | -  | 944,11  | 3.696.534,97  |
| 860.772,56   | 1.443.634,65  | 54.382,70  | 598.704,92  | 27.026.038,01   |
| 7.660,69   | 27.360,30   | 0,25   | 7.745,34  | 499.696,64  |
| 34.986,86  | 117.772,52  | 6.033,64   | 131.288,14  | 1.750.804,98  |
| 34.022,70  | 135.600,52  | 8.218,92   | 73.143,45   | 596.900,90  |
| <b>1.165.888,42</b>  | <b>2.429.516,46</b>                                       | <b>121.106,38</b>  | <b>1.528.383,71</b>   | <b>45.710.607,55</b>                                    |
| <b>(14.400,07)</b>   | <b>4.270.371,87</b>                                       | <b>715.838,51</b>  | <b>8.397.294,55</b>   | <b>8.138.750,99</b>                                     |
| 9.920.357,19   | 10.437.386,83   | 1.655.628,76   | 3.053.177,42  | 62.460.656,90   |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| -  | 227.181,56  | 51.232,00  | -   | (1.577.321,49)  |
| -  | 307.635,04  | 2.838,11   | -   | (12.547.653,38)   |
| -  | -   | -  | -   | 21.392.003,37   |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| (10.260,68)  | 3.054.637,24  | -  | 8.068.476,71  | (22.028.732,98)   |
| 37.243,11  | 5.978,58  | (119,42)   | (1.329.321,99)  | 3.031.154,35  |
| <b>9.932.939,55</b>  | <b>18.303.191,12</b>                                      | <b>2.425.417,96</b>  | <b>18.189.626,69</b>  | <b>58.868.857,76</b>                                    |
| (19.654.383,73)  | (22.068.370,15)   | (2.777.123,39)   | (26.922.919,59)   | (211.314.909,33)  |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| -  | (67.484,60)   | (25.927,86)  | -   | (1.241.974,24)  |
| -  | (131.355,27)  | (3.020,00)   | -   | 14.326.169,21   |
| -  | -   | -  | -   | (2.046.903,43)  |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| 152,71   | (4.634.830,99)  | -  | 1.304.027,56  | 1.312.275,16  |
| (44,54)  | (23,85)   | -  | 3,21  | 5.637,24  |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| <b>(9.721.336,01)</b>  | <b>(8.598.873,74)</b>                                     | <b>(380.653,29)</b>  | <b>(7.429.262,13)</b>   | <b>(140.090.847,63)</b>                                 |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| 82.103.572,73  | 140.124.450,29  | 275.017,00   | 839.881.073,46  | 1.968.256.102,08  |
| (75.808.973,81)  | (178.412.237,57)  | (93.458.405,79)  | (137.417.989,89)  | (3.628.757.128,15)                                      |
| (2.323,48)   | -   | -  | (332,07)  | (5.375.888,55)  |
| <b>139.428.636,59</b>  | <b>545.867.740,19</b>                                     | <b>-</b>   | <b>1.258.909.989,13</b>   | <b>5.706.671.932,11</b>                                 |
| -  | -   | -  | -   | -   |
| <b>139.428.636,59</b>  | <b>545.867.740,19</b>                                     | <b>-</b>   | <b>1.258.909.989,13</b>   | <b>5.706.671.932,11</b>                                 |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>European Covered Bond<br>Opportunities Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European Cross<br>Credit Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European Financial<br>Debt Fund<br>(in EUR) |
|--|---|---|---|
| <b>Summe Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>                                 | <b>153.607.704,56</b>   | <b>1.161.707.472,33</b>                                 | <b>1.118.875.899,90</b>                                   |
| <b>Bewertungsdifferenz zum gesamten Nettoanfangsvermögen (Anmerkung 2)</b>               | -   | -   | -   |
| <b>Konsolidiertes gesamtes Nettoanfangsvermögen zum Kurs am Jahresende</b>               | -   | -   | -   |
| <b>Erträge</b>   |   |   |   |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Anleihen (Anmerkung 2)   | 5.233.476,89  | 28.320.777,54   | 50.766.598,14   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 4)   | 1.853.854,63  | -   | -   |
| Andere Erträge   | 4,82  | 5,48  | 8,59  |
|  | <b>7.087.336,34</b>   | <b>28.320.783,02</b>                                    | <b>50.766.606,73</b>                                      |
| <b>Aufwendungen</b>  |   |   |   |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 116.662,09  | 97.895,01   | 242.110,13  |
| Nettozinsen aus Derivaten  | 1.368.739,10  | -   | 147.452,78  |
| Rechnungsprüfungs-, Rechts-, Registrierungs-, Verwaltungsrats- sowie andere Kosten       | 34.773,01   | 89.479,56   | 111.921,14  |
| Honorar für die zentrale Verwaltung (Anmerkung 3b)                                       | 216.763,63  | 1.214.721,91  | 1.424.070,32  |
| Verwahrstellengebühr (Anmerkung 3b)  | 164.402,78  | 82.180,82   | 101.368,50  |
| Vertriebsgebühren E- und HE-Anteile (Anmerkung 3c)                                       | 116.844,76  | 227.761,39  | 764.956,97  |
| Verwaltungsgebühr (Anmerkung 3a)   | 1.080.231,36  | 7.046.826,92  | 7.808.289,71  |
| Kosten für Druck, Veröffentlichung und Internet (Anmerkung 3b)                           | 20.034,30   | 71.934,28   | 57.961,32   |
| Taxe d'abonnement (Anmerkung 3b)   | 103.864,64  | 266.568,47  | 270.823,49  |
| Transaktionsbezogene Kosten (Anmerkung 11)   | 174.160,98  | 44.638,60   | 136.326,27  |
|  | <b>3.396.476,65</b>   | <b>9.142.006,96</b>                                     | <b>11.065.280,63</b>                                      |
| <b>Nettoertrag/(-verlust)</b>  | <b>3.690.859,69</b>   | <b>19.178.776,06</b>                                    | <b>39.701.326,10</b>                                      |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren                                     | 7.701.987,24  | 25.040.891,14   | 22.333.504,52   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps                                     | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps                             | (133.859,20)  | -   | (80.997,38)   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures)                       | (11.808.230,67)   | -   | 10.562.472,76   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps  | 4.458.679,92  | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen   | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten                          | (980.219,58)  | (3.909.169,64)  | (1.245.836,12)  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen                                   | 154.582,06  | 768.990,57  | 5.374.407,35  |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>   | <b>3.083.799,46</b>   | <b>41.079.488,13</b>                                    | <b>76.644.877,23</b>                                      |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren                 | (19.593.073,79)   | (27.321.757,14)   | (6.848.987,15)  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps                 | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps         | (281.548,36)  | -   | (143.666,93)  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Terminkontrakten (Futures)   | 7.033.217,93  | -   | 203.426,56  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps                    | 4.657.241,87  | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen                     | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Devisenterminkontrakten      | 339.517,96  | (2.614.944,58)  | (15.070.374,88)   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen               | 43,44   | (0,19)  | (10.999,85)   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Pensionsgeschäften           | (73.656,60)   | -   | -   |
| <b>Nettoerhöhung/(-minderung) des Nettovermögens gemäß Ertrags- und Aufwandsrechnung</b> | <b>(4.834.458,09)</b>   | <b>11.142.786,22</b>                                    | <b>54.774.274,98</b>                                      |
| Auflösung der Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                                      | -   | -   | -   |
| <b>Veränderungen im gezeichneten Kapital</b>   |   |   |   |
| Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen  | 636.840.253,80  | 200.082.318,37  | 746.385.586,52  |
| Zahlungen durch Rücknahme von Anteilen   | (93.316.501,09)   | (406.323.839,76)  | (610.167.954,95)  |
| Gezahlte Dividenden (Anmerkung 12)   | (399.086,36)  | (5.930.485,02)  | (7.743.587,63)  |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>                   | <b>691.897.912,82</b>   | <b>960.678.252,14</b>                                   | <b>1.302.124.218,82</b>                                   |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                               | -   | -   | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>                  | <b>691.897.912,82</b>   | <b>960.678.252,14</b>                                   | <b>1.302.124.218,82</b>                                   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



| Nordea 1 -<br>European High Yield<br>Bond Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European High Yield<br>Credit Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European High Yield<br>Stars Bond Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European Inflation<br>Linked Bond Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>European Small and<br>Mid Cap Equity Fund<br>(in EUR) |
|--|--|--|--|---|
| 5.136.098.333,15   | 428.134.590,08   | 213.279.954,55   | 15.060.071,65  | 509.740.148,22  |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | 10.725.178,39   |
| 183.375.799,15   | 12.594.243,02  | 17.885.491,99  | 144.970,34   | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| 9.687.680,71   | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| 11,97  | 0,51   | 2,98   | -  | 1,78  |
| <b>193.063.491,83</b>                                      | <b>12.594.243,53</b>   | <b>17.885.494,97</b>   | <b>144.970,34</b>  | <b>10.725.180,17</b>  |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| 1.304.381,02   | 56.309,40  | 73.888,13  | 401,94   | 66.522,95   |
| -  | 1.070.467,72   | 181.250,00   | -  | -   |
| 411.433,70   | 25.747,30  | 37.578,43  | 1.353,01   | 45.480,05   |
| 9.018.774,78   | 226.161,54   | 263.293,66   | 4.288,18   | 1.044.972,74  |
| 420.869,75   | 19.304,44  | 31.816,36  | 1.575,24   | 45.382,32   |
| 321.427,07   | 68,76  | 452,17   | 1.589,29   | 20.116,08   |
| 28.147.105,47  | 676.139,73   | 672.145,94   | 1.668,90   | 6.752.062,15  |
| 187.533,06   | 3.879,83   | 4.435,59   | 44,72  | 85.464,43   |
| 902.591,11   | 36.425,25  | 66.878,74  | 1.787,07   | 255.390,58  |
| 307.979,01   | 42.106,05  | 68.794,67  | 429,80   | 8.853,50  |
| <b>41.022.094,97</b>                                       | <b>2.156.610,02</b>  | <b>1.400.533,69</b>  | <b>13.138,15</b>   | <b>8.324.244,80</b>   |
| <b>152.041.396,86</b>                                      | <b>10.437.633,51</b>   | <b>16.484.961,28</b>   | <b>131.832,19</b>  | <b>2.400.935,37</b>   |
| 105.539.967,77   | 5.970.816,04   | 4.118.842,64   | 83.112,05  | 44.421.963,79   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| 3.864.215,09   | 307.817,15   | -  | -  | -   |
| -  | 462.608,46   | 71.252,68  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| (40.989.814,41)  | (627.245,73)   | (4.541.721,85)   | -  | 26.595,50   |
| (2.420.248,52)   | 251.321,82   | 206.610,72   | -  | 208.145,92  |
| <b>218.035.516,79</b>                                      | <b>16.802.951,25</b>   | <b>16.339.945,47</b>   | <b>214.944,24</b>  | <b>47.057.640,58</b>  |
| (49.554.196,18)  | (3.094.405,43)   | (6.895.821,97)   | 722.934,42   | 68.292.277,01   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| (8.586.353,46)   | (46.543,31)  | (57.849,75)  | -  | -   |
| -  | 48.518,48  | 336.367,09   | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| (5.716.140,83)   | (3.351.596,08)   | (2.442.654,55)   | -  | -   |
| (72,50)  | 4.361,76   | (207,60)   | -  | 508,78  |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| <b>154.178.753,82</b>                                      | <b>10.363.286,67</b>   | <b>7.279.778,69</b>  | <b>937.878,66</b>  | <b>115.350.426,37</b>   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| 2.673.032.819,40   | 58.751.450,19  | 461.574.265,69   | 1.326.480,47   | 38.494.735,81   |
| (3.558.492.157,06)   | (218.384.989,23)   | (52.263.054,27)  | (193.209,51)   | (127.617.217,38)  |
| (37.206.499,79)  | -  | (373,67)   | -  | (10.329,24)   |
| <b>4.367.611.249,52</b>                                    | <b>278.864.337,71</b>  | <b>629.870.570,99</b>  | <b>17.131.221,27</b>   | <b>535.957.763,78</b>   |
| -  | -  | -  | -  | -   |
| <b>4.367.611.249,52</b>                                    | <b>278.864.337,71</b>  | <b>629.870.570,99</b>  | <b>17.131.221,27</b>   | <b>535.957.763,78</b>   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>European Stars<br>Equity Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Flexible<br>Credit Fund<br>(Anmerkung 1b)<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Flexible Fixed<br>Income Fund<br>(in EUR) |
|--|---|---|---|
| <b>Summe Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>                                 | <b>600.142.860,60</b>                                   | <b>69.878.630,28</b>  | <b>3.722.242.509,72</b>                                 |
| <b>Bewertungsdifferenz zum gesamten Nettoanfangsvermögen (Anmerkung 2)</b>               | -   | -   | -   |
| <b>Konsolidiertes gesamtes Nettoanfangsvermögen zum Kurs am Jahresende</b>               | -   | -   | -   |
| <b>Erträge</b>   |   |   |   |
| Nett dividenden (Anmerkung 2)  | 13.885.992,46   | -   | 5.414.281,91  |
| Nettozinsen aus Anleihen (Anmerkung 2)   | -   | 3.344.530,36  | 27.874.362,52   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -   | 76.891,37   | 37.211.209,94   |
| Nettozinsen aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 4)   | -   | -   | -   |
| Andere Erträge   | 5,00  | 0,02  | 6,61  |
|  | <b>13.885.997,46</b>                                    | <b>3.421.421,75</b>   | <b>70.499.860,98</b>                                    |
| <b>Aufwendungen</b>  |   |   |   |
| Nett dividenden (Anmerkung 2)  | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 73.823,56   | 24.819,51   | 480.153,27  |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -   | -   | -   |
| Rechnungsprüfungs-, Rechts-, Registrierungs-, Verwaltungsrats- sowie andere Kosten       | 65.393,82   | 6.546,07  | 299.689,12  |
| Honorar für die zentrale Verwaltung (Anmerkung 3b)                                       | 1.259.407,97  | 41.504,22   | 3.384.524,09  |
| Verwahrstellengebühr (Anmerkung 3b)  | 70.913,16   | 7.203,41  | 341.801,44  |
| Vertriebsgebühren E- und HE-Anteile (Anmerkung 3c)                                       | 29.730,66   | 4.742,20  | 231.000,87  |
| Verwaltungsgebühr (Anmerkung 3a)   | 8.320.973,32  | 120.641,49  | 13.818.454,81   |
| Kosten für Druck, Veröffentlichung und Internet (Anmerkung 3b)                           | 73.491,25   | 1.120,47  | 126.160,35  |
| Taxe d'abonnement (Anmerkung 3b)   | 255.011,51  | 12.828,49   | 622.285,79  |
| Transaktionsbezogene Kosten (Anmerkung 11)   | 17.480,24   | 29.615,57   | 709.217,55  |
|  | <b>10.166.225,49</b>                                    | <b>249.021,43</b>   | <b>20.013.287,29</b>                                    |
| <b>Nettoertrag/(-verlust)</b>  | <b>3.719.771,97</b>                                     | <b>3.172.400,32</b>   | <b>50.486.573,69</b>                                    |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren                                     | 89.675.771,56   | 5.787.501,49  | 8.239.934,46  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps                                     | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps                             | -   | 178.662,31  | 17.835.686,03   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures)                       | -   | -   | 23.371.843,03   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps  | -   | 20.462,86   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen   | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten                          | (2.420,29)  | (461.945,84)  | (69.414.555,53)   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen                                   | (156.314,57)  | 66.505,16   | 3.077.174,22  |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>   | <b>93.236.808,67</b>                                    | <b>8.763.586,30</b>   | <b>33.596.655,90</b>                                    |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren                 | 44.646.777,60   | (4.547.503,07)  | 40.127.562,81   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps                 | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps         | -   | (186.488,29)  | (22.379.038,05)   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Terminkontrakten (Futures)   | -   | -   | 8.008.033,86  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps                    | -   | 653.756,34  | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen                     | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Devisenterminkontrakten      | 9.031,73  | (744.010,21)  | (46.873.062,38)   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen               | 1.354,16  | -   | 147,15  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Pensionsgeschäften           | -   | -   | -   |
| <b>Nettoerhöhung/(-minderung) des Nettovermögens gemäß Ertrags- und Aufwandsrechnung</b> | <b>137.893.972,16</b>                                   | <b>3.939.341,07</b>   | <b>12.480.299,29</b>                                    |
| Auflösung der Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                                      | -   | -   | -   |
| <b>Veränderungen im gezeichneten Kapital</b>   |   |   |   |
| Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen  | 507.732.805,41  | 20.703.007,19   | 1.259.356.534,40  |
| Zahlungen durch Rücknahme von Anteilen   | (473.606.769,44)  | (13.450.558,54)   | (1.578.848.566,89)                                      |
| Gezahlte Dividenden (Anmerkung 12)   | (15.257,93)   | -   | (2.117.156,89)  |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>                   | <b>772.147.610,80</b>                                   | <b>81.070.420,00</b>  | <b>3.413.113.619,63</b>                                 |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                               | -   | -   | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>                  | <b>772.147.610,80</b>                                   | <b>81.070.420,00</b>  | <b>3.413.113.619,63</b>                                 |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Flexible Fixed Income<br>Plus Fund<br>(Anmerkung 1a)<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>GBP Diversified<br>Return Fund<br>(in GBP) | Nordea 1 -<br>Global<br>Bond Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Global Climate and<br>Environment Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Global Climate and<br>Social Impact Fund<br>(Anmerkung 1a)<br>(in USD) |
|--|--|---|--|--|
| -  | 2.747.972.377,19   | 110.488.082,06                                | 5.519.679.482,81   | -  |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| 57.602,78  | 42.500.046,23  | -   | 80.083.711,34  | 253.399,67   |
| 220.410,02   | 6.134.687,66   | 1.204.816,89                                  | -  | -  |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| 1.215.792,20   | 455.373,56   | -   | -  | -  |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| 0,01   | 3,69   | 2,00  | 31,89  | 0,21   |
| <b>1.493.805,01</b>  | <b>49.090.111,14</b>                                     | <b>1.204.818,89</b>                           | <b>80.083.743,23</b>   | <b>253.399,88</b>  |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| 12.743,65  | 287.452,72   | 7.536,53                                      | 744.407,95   | 577,79   |
| -  | -  | 701,13  | -  | -  |
| 4.180,25   | 257.762,56   | 6.641,31                                      | 744.260,92   | 3.766,95   |
| 21.480,92  | 3.331.657,60   | 104.672,71                                    | 15.388.652,80  | 70.389,44  |
| 7.547,04   | 243.068,88   | 8.578,24                                      | 592.003,36   | 3.513,81   |
| 6,88   | -  | 44.637,20                                     | 2.203.694,16   | 130,66   |
| 57.377,85  | 20.233.973,13  | 389.251,49                                    | 97.607.126,05  | 366.343,53   |
| -  | 28.770,86  | 9.820,44                                      | 757.084,19   | 580,18   |
| 5.414,60   | 377.495,95   | 28.921,13                                     | 2.873.799,14   | 14.157,80  |
| 16.619,58  | 350.977,90   | 10.334,64                                     | 94.031,37  | 10.600,62  |
| <b>125.370,77</b>  | <b>25.111.159,60</b>                                     | <b>611.094,82</b>                             | <b>121.005.059,94</b>  | <b>470.060,78</b>  |
| <b>1.368.434,24</b>  | <b>23.978.951,54</b>                                     | <b>593.724,07</b>                             | <b>(40.921.316,71)</b>   | <b>(216.660,90)</b>  |
| 741.144,30   | 123.140.706,34   | (872.196,58)                                  | 954.624.502,28   | 826.188,73   |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| (76.821,87)  | (1.372.593,12)   | -   | -  | -  |
| (98.270,91)  | (162.797.871,05)   | 175.920,82                                    | -  | -  |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| (1.974.381,46)   | 16.983.260,57  | (285.698,23)                                  | 11.448.411,08  | (358.402,91)   |
| (20.843,52)  | (2.442.031,18)   | 69.323,39                                     | (525.482,97)   | (176.239,34)   |
| <b>(60.739,22)</b>   | <b>(2.509.576,90)</b>                                    | <b>(318.926,53)</b>                           | <b>924.626.113,68</b>  | <b>74.885,58</b>   |
| 282.220,67   | 350.605.903,91   | (1.090.581,94)                                | 1.590.624.101,35   | (629.624,90)   |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| 3.639,20   | 7.292,47   | -   | -  | -  |
| 208.088,28   | 8.605.131,23   | 289.889,19                                    | -  | -  |
| -  | -  | 29.910,64                                     | -  | -  |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| 251.905,34   | (3.036.506,27)   | 606.546,26                                    | 1.409.265,24   | 34.558,11  |
| (6,07)   | 47.543,30  | (10,63)                                       | 64.411,53  | 628,36   |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| <b>685.108,20</b>  | <b>353.719.787,74</b>                                    | <b>(483.173,01)</b>                           | <b>2.516.723.891,80</b>  | <b>(519.552,85)</b>  |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| 72.491.174,86  | 586.636.885,52   | 16.271.125,04                                 | 5.484.411.415,95   | 215.021.753,96   |
| (225.320,54)   | (506.884.396,28)   | (69.995.243,96)                               | (2.158.262.461,86)   | (1.060.709,50)   |
| -  | (3.048.137,43)   | (152.831,00)                                  | (3.383.316,90)   | -  |
| <b>72.950.962,52</b>   | <b>3.178.396.516,74</b>                                  | <b>56.127.959,13</b>                          | <b>11.359.169.011,80</b>   | <b>213.441.491,61</b>  |
| -  | -  | -   | -  | -  |
| <b>72.950.962,52</b>   | <b>3.178.396.516,74</b>                                  | <b>56.127.959,13</b>                          | <b>11.359.169.011,80</b>   | <b>213.441.491,61</b>  |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Global<br>Disruption Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Global Equity<br>Market Neutral Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Global Gender<br>Diversity Fund<br>(in USD) |
|--|---|--|---|
| <b>Summe Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>                                 | <b>188.821.934,58</b>                               | <b>27.354.313,88</b>   | <b>147.426.327,81</b>                                     |
| <b>Bewertungsdifferenz zum gesamten Nettoanfangsvermögen (Anmerkung 2)</b>               | -   | -  | -   |
| <b>Konsolidiertes gesamtes Nettoanfangsvermögen zum Kurs am Jahresende</b>               | -   | -  | -   |
| <b>Erträge</b>   |   |  |   |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | 1.301.115,04  | 41.562,97  | 3.113.133,38  |
| Nettozinsen aus Anleihen (Anmerkung 2)   | -   | -  | -   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | -   | -  | -   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -   | -  | -   |
| Nettozinsen aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 4)   | -   | -  | -   |
| Andere Erträge   | 1,88  | -  | 1,41  |
|  | <b>1.301.116,92</b>                                 | <b>41.562,97</b>   | <b>3.113.134,79</b>                                       |
| <b>Aufwendungen</b>  |   |  |   |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | -   | -  | -   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 697,49  | 34.227,81  | 7.100,50  |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -   | 88.050,33  | -   |
| Rechnungsprüfungs-, Rechts-, Registrierungs-, Verwaltungsrats- sowie andere Kosten       | 20.546,11   | 2.358,70   | 16.251,96   |
| Honorar für die zentrale Verwaltung (Anmerkung 3b)                                       | 476.243,41  | 6.873,64   | 87.497,77   |
| Verwahrstellengebühr (Anmerkung 3b)  | 18.535,87   | 3.996,46   | 22.607,78   |
| Vertriebsgebühren E- und HE-Anteile (Anmerkung 3c)                                       | 16.988,37   | 7,30   | 4.735,07  |
| Verwaltungsgebühr (Anmerkung 3a)   | 3.488.406,68  | 147,05   | 270.255,80  |
| Kosten für Druck, Veröffentlichung und Internet (Anmerkung 3b)                           | 36.928,69   | 0,55   | 1.320,56  |
| Taxe d'abonnement (Anmerkung 3b)   | 120.856,10  | 2.757,16   | 24.297,54   |
| Transaktionsbezogene Kosten (Anmerkung 11)   | 30.918,38   | 9.109,52   | 17.501,84   |
|  | <b>4.210.121,10</b>                                 | <b>147.528,52</b>  | <b>451.568,82</b>   |
| <b>Nettoertrag/(-verlust)</b>  | <b>(2.909.004,18)</b>                               | <b>(105.965,55)</b>  | <b>2.661.565,97</b>                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren                                     | 12.420.078,31                                       | 2.959.117,28   | 9.276.292,49  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps                                     | -   | (3.616.611,06)   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps                             | -   | -  | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures)                       | -   | (563.068,91)   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps  | -   | -  | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen   | -   | -  | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten                          | 12.145,06   | (412.693,47)   | (48.007,22)   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen                                   | (25.204,95)   | 97.997,82  | 9.674,48  |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>   | <b>9.498.014,24</b>                                 | <b>(1.641.223,89)</b>  | <b>11.899.525,72</b>                                      |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren                 | 3.505.081,36  | 1.187.382,63   | 35.016.984,99   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps                 | -   | 1.320.986,29   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps         | -   | -  | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Terminkontrakten (Futures)   | -   | (29.076,34)  | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps                    | -   | -  | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen                     | -   | -  | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Devisenterminkontrakten      | -   | (642.899,37)   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen               | (614,19)  | 49,24  | 516,00  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Pensionsgeschäften           | -   | -  | -   |
| <b>Nettoerhöhung/(-minderung) des Nettovermögens gemäß Ertrags- und Aufwandsrechnung</b> | <b>13.002.481,41</b>                                | <b>195.218,56</b>  | <b>46.917.026,71</b>                                      |
| Auflösung der Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                                      | -   | -  | -   |
| <b>Veränderungen im gezeichneten Kapital</b>   |   |  |   |
| Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen  | 192.405.917,64                                      | 2.634,16   | 104.149.413,58  |
| Zahlungen durch Rücknahme von Anteilen   | (144.548.343,12)                                    | (2.482,75)   | (59.560.457,08)   |
| Gezahlte Dividenden (Anmerkung 12)   | (11,72)   | -  | (24,64)   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>                   | <b>249.681.978,79</b>                               | <b>27.549.683,85</b>   | <b>238.932.286,38</b>                                     |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                               | -   | -  | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>                  | <b>249.681.978,79</b>                               | <b>27.549.683,85</b>   | <b>238.932.286,38</b>                                     |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Global Green Bond Fund<br>(Anmerkung 1a)<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Global High Yield<br>Bond Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Global Listed<br>Infrastructure Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Global<br>Opportunity Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Global<br>Portfolio Fund<br>(in EUR) |
|--|--|--|--|--|
| -  | 707.317.059,13   | 373.067.766,65   | 341.230.866,52                                       | 238.502.275,80                                     |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | 11.429.797,28  | 2.085.348,00   | 3.833.294,17                                       |
| 599.516,36   | 37.717.470,67  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| -  | 0,17   | 4,77   | 3,27   | 3,58   |
| <b>599.516,36</b>  | <b>37.717.470,84</b>                                     | <b>11.429.802,05</b>   | <b>2.085.351,27</b>                                  | <b>3.833.297,75</b>                                |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| 5.223,68   | 12.998,64  | 3.144,74   | 1.652,45   | 28.257,90  |
| 6.007,54   | -  | -  | -  | -  |
| 3.315,84   | 61.080,61  | 35.638,46  | 33.906,56  | 29.054,73  |
| 13.648,34  | 351.158,26   | 878.525,69   | 752.023,88   | 605.762,18   |
| 3.046,46   | 36.766,22  | 34.945,43  | 28.083,90  | 18.554,85  |
| 5,06   | 39.937,00  | 92.320,35  | 81.447,88  | 46.515,77  |
| 14.942,19  | 634.216,16   | 5.157.712,80   | 3.858.512,54   | 2.169.103,63                                       |
| 41,50  | 10.103,19  | 38.320,29  | 12.624,18  | 31.238,00  |
| 4.838,53   | 96.382,79  | 156.468,56   | 74.310,99  | 115.257,24   |
| 2.467,36   | 36.976,80  | 22.522,01  | 17.106,36  | 7.129,91   |
| <b>53.536,50</b>   | <b>1.279.619,67</b>                                      | <b>6.419.598,33</b>  | <b>4.859.668,74</b>                                  | <b>3.050.874,21</b>                                |
| <b>545.979,86</b>  | <b>36.437.851,17</b>                                     | <b>5.010.203,72</b>  | <b>(2.774.317,47)</b>                                | <b>782.423,54</b>                                  |
| 27.152,15  | 13.305.858,05  | 28.242.422,75  | 24.844.038,84  | 8.314.339,61                                       |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| (6.361,42)   | -  | -  | -  | -  |
| (267.949,22)   | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| (623.220,84)   | (7.593.956,11)   | (402.517,12)   | 37.556,98  | (21.593,67)  |
| 51.645,55  | (39.905,92)  | 59.078,94  | 391.031,15   | (83.411,72)  |
| <b>(272.753,92)</b>  | <b>42.109.847,19</b>                                     | <b>32.909.188,29</b>   | <b>22.498.309,50</b>                                 | <b>8.991.757,76</b>                                |
| (3.475,38)   | (27.719.126,71)  | 14.049.886,46  | 91.065.399,12  | 67.532.002,96                                      |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| (53.871,99)  | -  | -  | -  | -  |
| 193.499,13   | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| (429.342,04)   | (4.571.754,39)   | 123.443,38   | 8.216,65   | -  |
| (0,55)   | (23,24)  | (5.234,79)   | 132,21   | (149,42)   |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| <b>(565.944,75)</b>  | <b>9.818.942,85</b>                                      | <b>47.077.283,34</b>   | <b>113.572.057,48</b>                                | <b>76.523.611,30</b>                               |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| 62.750.779,65  | 81.640.263,61  | 362.335.190,03   | 93.412.678,76  | 186.979.119,74                                     |
| (182.439,49)   | (105.917.144,91)   | (304.636.684,45)   | (57.242.910,23)                                      | (28.797.161,10)                                    |
| -  | (45,07)  | (1.214.422,40)   | -  | -  |
| <b>62.002.395,41</b>   | <b>692.859.075,61</b>                                    | <b>476.629.133,17</b>  | <b>490.972.692,53</b>                                | <b>473.207.845,74</b>                              |
| -  | -  | -  | -  | -  |
| <b>62.002.395,41</b>   | <b>692.859.075,61</b>                                    | <b>476.629.133,17</b>  | <b>490.972.692,53</b>                                | <b>473.207.845,74</b>                              |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Global Real<br>Estate Fund<br><br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Global Small<br>Cap Fund<br><br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Global Social<br>Empowerment Fund<br>(Anmerkung 1c)<br>(in USD) |
|--|--|--|---|
| <b>Summe Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>                                 | <b>816.898.388,20</b>                                    | <b>250.977.881,64</b>                                  | <b>143.112.665,65</b>   |
| <b>Bewertungsdifferenz zum gesamten Nettoanfangsvermögen (Anmerkung 2)</b>               | -  | -  | -   |
| <b>Konsolidiertes gesamtes Nettoanfangsvermögen zum Kurs am Jahresende</b>               | -  | -  | -   |
| <b>Erträge</b>   |  |  |   |
| Nett dividenden (Anmerkung 2)  | 20.673.037,02  | 2.969.303,13   | 3.202.375,83  |
| Nettozinsen aus Anleihen (Anmerkung 2)   | -  | -  | -   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | -  | -  | -   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -  | -  | -   |
| Nettozinsen aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 4)   | -  | -  | -   |
| Andere Erträge   | 3,64   | 0,77   | 0,62  |
|  | <b>20.673.040,66</b>                                     | <b>2.969.303,90</b>                                    | <b>3.202.376,45</b>   |
| <b>Aufwendungen</b>  |  |  |   |
| Nett dividenden (Anmerkung 2)  | -  | -  | -   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 998,57   | 689,90   | 4.589,63  |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -  | -  | -   |
| Rechnungsprüfungs-, Rechts-, Registrierungs-, Verwaltungsrats- sowie andere Kosten       | 82.053,26  | 23.717,74  | 26.080,82   |
| Honorar für die zentrale Verwaltung (Anmerkung 3b)                                       | 2.281.455,91   | 629.628,45   | 109.453,01  |
| Verwahrstellengebühr (Anmerkung 3b)  | 65.398,11  | 22.703,54  | 42.277,06   |
| Vertriebsgebühren E- und HE-Anteile (Anmerkung 3c)                                       | 46.367,21  | 4.784,62   | 830,14  |
| Verwaltungsgebühr (Anmerkung 3a)   | 12.536.782,65  | 3.995.319,10   | 229.545,49  |
| Kosten für Druck, Veröffentlichung und Internet (Anmerkung 3b)                           | 108.807,07   | 41.305,45  | 1.316,62  |
| Taxe d'abonnement (Anmerkung 3b)   | 387.548,80   | 127.012,92   | 41.166,26   |
| Transaktionsbezogene Kosten (Anmerkung 11)   | 14.712,86  | 11.142,54  | 18.944,50   |
|  | <b>15.524.124,44</b>                                     | <b>4.856.304,26</b>                                    | <b>474.203,53</b>   |
| <b>Nettoertrag/(-verlust)</b>  | <b>5.148.916,22</b>                                      | <b>(1.887.000,36)</b>                                  | <b>2.728.172,92</b>   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren                                     | 32.997.795,53  | 34.943.683,59  | (2.943.274,22)  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps                                     | -  | -  | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps                             | -  | -  | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures)                       | -  | -  | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps  | -  | -  | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen   | -  | -  | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten                          | (26.079,58)  | 3.697,77   | 12.678,84   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen                                   | 188.210,34   | (29.096,84)  | (117.438,76)  |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>   | <b>38.308.842,51</b>                                     | <b>33.031.284,16</b>                                   | <b>(319.861,22)</b>   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren                 | 215.941.882,63   | 3.136.979,59   | 86.965,66   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps                 | -  | -  | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps         | -  | -  | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Terminkontrakten (Futures)   | -  | -  | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps                    | -  | -  | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen                     | -  | -  | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Devisenterminkontrakten      | -  | -  | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen               | (22.161,83)  | (127,84)   | 295,46  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Pensionsgeschäften           | -  | -  | -   |
| <b>Nettoerhöhung/(-minderung) des Nettovermögens gemäß Ertrags- und Aufwandsrechnung</b> | <b>254.228.563,31</b>                                    | <b>36.168.135,91</b>                                   | <b>(232.600,10)</b>   |
| Auflösung der Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                                      | -  | -  | -   |
| <b>Veränderungen im gezeichneten Kapital</b>   |  |  |   |
| Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen  | 637.731.200,10   | 45.247.776,89  | 279.013.537,51  |
| Zahlungen durch Rücknahme von Anteilen   | (551.415.995,55)   | (61.073.482,28)  | (66.517.717,86)   |
| Gezahlte Dividenden (Anmerkung 12)   | (52.580,58)  | -  | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>                   | <b>1.157.389.575,48</b>                                  | <b>271.320.312,16</b>                                  | <b>355.375.885,20</b>   |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                               | -  | -  | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>                  | <b>1.157.389.575,48</b>                                  | <b>271.320.312,16</b>                                  | <b>355.375.885,20</b>   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Global Stable<br>Equity Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Global Stable<br>Equity Fund -<br>Euro Hedged<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Global Stars<br>Equity Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Indian<br>Equity Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>International High Yield<br>Bond Fund -<br>USD Hedged<br>(in USD) |
|--|---|---|---|---|
| 2.503.804.676,43                                       | 510.883.278,50  | 1.689.752.657,02                                      | 183.454.370,15                                  | 193.460.546,96  |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| 49.639.253,22  | 10.872.074,16   | 23.388.209,31   | 4.824.466,75                                    | 7.437,04  |
| -  | -   | -   | -   | 7.225.866,62  |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| 7,09   | 4,74  | 2.600,37  | 1,75  | 0,41  |
| <b>49.639.260,31</b>                                   | <b>10.872.078,90</b>  | <b>23.390.809,68</b>                                  | <b>4.824.468,50</b>                             | <b>7.233.304,07</b>   |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| 171.427,45   | 16.945,09   | 11.608,65   | 1.018,61  | 1.059,09  |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| 221.529,20   | 47.817,13   | 166.032,95  | 23.668,30                                       | 12.181,40   |
| 3.725.803,26   | 1.030.069,49  | 2.536.294,05  | 111.175,04                                      | 136.475,98  |
| 162.256,92   | 35.603,05   | 165.010,89  | 135.281,28                                      | 7.151,90  |
| 273.007,02   | 192.488,76  | 132.834,23  | 17.755,29                                       | 3.907,80  |
| 25.277.975,97  | 7.311.500,67  | 15.039.159,51   | 246.666,78                                      | 441.307,84  |
| 250.514,52   | 70.370,78   | 107.085,98  | 2.063,98  | 4.036,65  |
| 841.833,67   | 216.873,00  | 489.655,32  | 36.551,13                                       | 21.729,78   |
| 51.075,38  | 105.461,09  | 30.361,80   | 83.089,39                                       | 54.945,02   |
| <b>30.975.423,39</b>                                   | <b>9.027.129,06</b>   | <b>18.678.043,38</b>                                  | <b>657.269,80</b>                               | <b>682.795,46</b>   |
| <b>18.663.836,92</b>                                   | <b>1.844.949,84</b>   | <b>4.712.766,30</b>                                   | <b>4.167.198,70</b>                             | <b>6.550.508,61</b>   |
| 312.252.872,43   | 57.738.954,83   | 192.789.424,08  | 27.246.411,70                                   | 4.580.966,39  |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| 291.519,79   | (20.881.362,35)   | (1.908.412,54)  | 15.992,23                                       | (2.405.437,39)  |
| 612.101,31   | 1.525.068,20  | (224.421,62)  | (197.056,59)                                    | (1.041.054,47)  |
| <b>331.820.330,45</b>                                  | <b>40.227.610,52</b>  | <b>195.369.356,22</b>                                 | <b>31.232.546,04</b>                            | <b>7.684.983,14</b>   |
| 324.224.426,56   | 77.326.001,66   | 55.296.630,06   | 39.279.630,77                                   | (4.302.101,68)  |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| 26.126,40  | (19.258.207,77)   | (4.415.625,34)  | -   | (3.724.719,43)  |
| 12.981,61  | 5.774,64  | (16.355,07)   | (22.934,37)                                     | 19,42   |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| <b>656.083.865,02</b>                                  | <b>98.301.179,05</b>  | <b>246.234.005,87</b>                                 | <b>70.489.242,44</b>                            | <b>(341.818,55)</b>   |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| 494.622.823,79<br>(1.081.181.123,59)<br>(510.123,29)   | 135.405.719,92<br>(177.820.568,80)<br>(1.312.925,28)                    | 1.028.232.036,41<br>(783.723.821,86)<br>(16.403,83)   | 269.239.568,62<br>(184.452.584,72)<br>-         | 21.938.853,31<br>(133.379.789,21)<br>-  |
| <b>2.572.820.118,36</b>                                | <b>565.456.683,39</b>   | <b>2.180.478.473,61</b>                               | <b>338.730.596,49</b>                           | <b>81.677.792,51</b>  |
| -  | -   | -   | -   | -   |
| <b>2.572.820.118,36</b>                                | <b>565.456.683,39</b>   | <b>2.180.478.473,61</b>                               | <b>338.730.596,49</b>                           | <b>81.677.792,51</b>  |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Latin American<br>Corporate Bond Fund<br>(Anmerkung 1b)<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>Latin American<br>Equity Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 -<br>Long Duration<br>US Bond Fund<br>(in USD) |
|--|---|---|---|
| <b>Summe Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>                                 | <b>78.166.341,06</b>  | <b>89.354.837,92</b>                                    | <b>18.152.910,46</b>                                    |
| <b>Bewertungsdifferenz zum gesamten Nettoanfangsvermögen (Anmerkung 2)</b>               | -   | -   | -   |
| <b>Konsolidiertes gesamtes Nettoanfangsvermögen zum Kurs am Jahresende</b>               | -   | -   | -   |
| <b>Erträge</b>   |   |   |   |
| Nett dividenden (Anmerkung 2)  | -   | 3.613.891,40  | -   |
| Nettozinsen aus Anleihen (Anmerkung 2)   | 592.647,77  | -   | 124.896,28  |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 4)   | -   | -   | -   |
| Andere Erträge   | 0,06  | 2,59  | 0,05  |
|  | <b>592.647,83</b>   | <b>3.613.893,99</b>                                     | <b>124.896,33</b>                                       |
| <b>Aufwendungen</b>  |   |   |   |
| Nett dividenden (Anmerkung 2)  | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 2,90  | 561,66  | 43,32   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -   | -   | -   |
| Rechnungsprüfungs-, Rechts-, Registrierungs-, Verwaltungsrats- sowie andere Kosten       | 1.245,31  | 5.499,25  | 503,43  |
| Honorar für die zentrale Verwaltung (Anmerkung 3b)                                       | 26.219,18   | 132.715,03  | 8.155,20  |
| Verwahrstellengebühr (Anmerkung 3b)  | 622,40  | 27.541,85   | 415,41  |
| Vertriebsgebühren E- und HE-Anteile (Anmerkung 3c)                                       | 85,78   | 15.189,70   | -   |
| Verwaltungsgebühr (Anmerkung 3a)   | 122.283,54  | 862.517,97  | 25.924,07   |
| Kosten für Druck, Veröffentlichung und Internet (Anmerkung 3b)                           | 591,37  | 6.773,51  | 720,56  |
| Taxe d'abonnement (Anmerkung 3b)   | -   | 21.546,49   | 2.181,29  |
| Transaktionsbezogene Kosten (Anmerkung 11)   | 1.312,36  | 72.954,79   | 10.306,53   |
|  | <b>152.362,84</b>   | <b>1.145.300,25</b>                                     | <b>48.249,81</b>  |
| <b>Nettoertrag/(-verlust)</b>  | <b>440.284,99</b>   | <b>2.468.593,74</b>                                     | <b>76.646,52</b>  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren                                     | 5.014.006,69  | 1.859.344,72  | (868.826,10)  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps                                     | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps                             | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures)                       | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps  | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen   | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten                          | (28,31)   | (50.730,02)   | (8.043,24)  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen                                   | 8,61  | 223.618,19  | (15.383,48)   |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>   | <b>5.454.271,98</b>   | <b>4.500.826,63</b>                                     | <b>(815.606,30)</b>                                     |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren                 | (6.884.958,08)  | (5.720.917,67)  | (227.220,76)  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps                 | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps         | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Terminkontrakten (Futures)   | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps                    | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen                     | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Devisenterminkontrakten      | -   | 18.392,45   | (548,77)  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen               | (0,01)  | 5.843,37  | (33,51)   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Pensionsgeschäften           | -   | -   | -   |
| <b>Nettoerhöhung/(-minderung) des Nettovermögens gemäß Ertrags- und Aufwandsrechnung</b> | <b>(1.430.686,11)</b>   | <b>(1.195.855,22)</b>                                   | <b>(1.043.409,34)</b>                                   |
| Auflösung der Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                                      | (388.887,37)  | -   | -   |
| <b>Veränderungen im gezeichneten Kapital</b>   |   |   |   |
| Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen  | 1.696.349,13  | 24.816.249,94   | 7.741.581,52  |
| Zahlungen durch Rücknahme von Anteilen   | (78.043.116,71)   | (78.928.142,01)   | (20.443.888,50)   |
| Gezahlte Dividenden (Anmerkung 12)   | -   | (7.810,11)  | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>                   | -   | <b>34.039.280,52</b>                                    | <b>4.407.194,14</b>                                     |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                               | -   | -   | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>                  | -   | <b>34.039.280,52</b>                                    | <b>4.407.194,14</b>                                     |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



| Nordea 1 -<br>Low Duration European<br>Covered Bond Fund | Nordea 1 -<br>Low Duration US<br>High Yield Bond Fund | Nordea 1 -<br>Nordic<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Nordic Equity<br>Small Cap Fund | Nordea 1 -<br>Nordic Ideas<br>Equity Fund |
|--|---|-------------------------------------|---|---|
| (in EUR)   | (in USD)  | (in EUR)                            | (in EUR)                                      | (in EUR)                                  |
| 3.858.339.168,16   | 180.403.191,50  | 206.501.925,04                      | 149.826.771,43                                | 86.981.795,48                             |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| -  | -   | 6.856.186,47                        | 2.651.797,77                                  | 1.874.981,61                              |
| 45.673.094,67  | 7.412.183,80  | -                                   | -   | -   |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| 13,50  | 0,99  | 4,06                                | 4,51  | 1,38                                      |
| <b>45.673.108,17</b>                                     | <b>7.412.184,79</b>                                   | <b>6.856.190,53</b>                 | <b>2.651.802,28</b>                           | <b>1.874.982,99</b>                       |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| 1.245.826,24   | 635,98  | 36.757,73                           | 34.457,70                                     | 11.937,22                                 |
| 5.541.374,92   | -   | -                                   | -   | -   |
| 501.315,60   | 12.527,43   | 21.576,44                           | 13.829,82                                     | 6.674,16                                  |
| 4.029.704,97   | 275.027,99  | 464.788,33                          | 304.987,59                                    | 149.241,49                                |
| 1.340.225,57   | 6.692,13  | 14.471,21                           | 12.209,89                                     | 5.064,86                                  |
| 31.462,51  | 41.238,85   | 53.586,28                           | 118.713,33                                    | 19.562,42                                 |
| 19.600.974,01  | 1.044.724,12  | 3.237.707,71                        | 2.228.040,13                                  | 1.102.268,62                              |
| 360.934,21   | 10.096,51   | 29.641,81                           | 21.344,82                                     | 11.127,57                                 |
| 1.514.337,61   | 36.712,69   | 97.317,44                           | 67.076,00                                     | 34.381,46                                 |
| 620.164,21   | 28.693,29   | 7.831,20                            | 14.529,37                                     | 7.156,00                                  |
| <b>34.786.319,85</b>                                     | <b>1.456.348,99</b>                                   | <b>3.963.678,15</b>                 | <b>2.815.188,65</b>                           | <b>1.347.413,80</b>                       |
| <b>10.886.788,32</b>                                     | <b>5.955.835,80</b>                                   | <b>2.892.512,38</b>                 | <b>(163.386,37)</b>                           | <b>527.569,19</b>                         |
| 32.569.580,79  | 926.738,95  | 45.633.735,16                       | 20.185.676,35                                 | 17.785.392,67                             |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| (1.078.095,01)   | -   | -                                   | -   | -   |
| (43.090.986,55)  | (25.781,10)   | -                                   | 359.292,08                                    | -   |
| 26.000.211,83  | -   | -                                   | -   | -   |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| 4.858.578,68   | (1.570.776,63)  | (1.408,53)                          | 60,00   | (824,13)                                  |
| 1.002.519,27   | (267.451,04)  | 20.215,51                           | (17.118,67)                                   | (19.035,85)                               |
| <b>31.148.597,33</b>                                     | <b>5.018.565,98</b>                                   | <b>48.545.054,52</b>                | <b>20.364.523,39</b>                          | <b>18.293.101,88</b>                      |
| (145.587.250,29)   | (3.418.961,26)  | 10.420.699,91                       | 19.513.238,64                                 | (396.270,15)                              |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| (1.542.212,69)   | -   | -                                   | -   | -   |
| 50.131.499,92  | 56.249,54   | -                                   | 134.803,97                                    | -   |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| 32.215.780,11  | -   | -                                   | -   | -   |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| 3.685.894,26   | (1.674.740,51)  | -                                   | -   | -   |
| (39.969,30)  | (280,33)  | 126,57                              | 651,69  | (109,00)                                  |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| <b>(29.987.660,66)</b>                                   | <b>(19.166,58)</b>                                    | <b>58.965.881,00</b>                | <b>40.013.217,69</b>                          | <b>17.896.722,73</b>                      |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| 6.670.279.995,67   | 38.094.954,85   | 97.643.722,29                       | 54.677.954,38                                 | 26.032.083,81                             |
| (2.851.950.625,37)                                       | (86.919.569,93)                                       | (111.750.106,53)                    | (65.579.708,90)                               | (52.482.205,66)                           |
| (622.527,08)   | (173.284,08)  | (88.121,87)                         | (30.317,01)                                   | (1.605,97)                                |
| <b>7.646.058.350,72</b>                                  | <b>131.386.125,76</b>                                 | <b>251.273.299,93</b>               | <b>178.907.917,59</b>                         | <b>78.426.790,39</b>                      |
| -  | -   | -                                   | -   | -   |
| <b>7.646.058.350,72</b>                                  | <b>131.386.125,76</b>                                 | <b>251.273.299,93</b>               | <b>178.907.917,59</b>                         | <b>78.426.790,39</b>                      |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Nordic Stars<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>North American<br>High Yield<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>North American High<br>Yield Stars<br>Bond Fund<br>(Anmerkung 1a) |
|--|---|---|---|
|  | (in EUR)                                  | (in USD)  | (in USD)  |
| <b>Summe Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>                                 | <b>141.578.521,51</b>                     | <b>975.287.049,54</b>                                   | -   |
| <b>Bewertungsdifferenz zum gesamten Nettoanfangsvermögen (Anmerkung 2)</b>               | -   | -   | -   |
| <b>Konsolidiertes gesamtes Nettoanfangsvermögen zum Kurs am Jahresende</b>               | -   | -   | -   |
| <b>Erträge</b>   |   |   |   |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | 4.726.087,85                              | 56.984,26   | -   |
| Nettozinsen aus Anleihen (Anmerkung 2)   | -   | 42.011.723,49   | 4.394.051,31  |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 4)   | -   | -   | -   |
| Andere Erträge   | 2,62                                      | 0,04  | 0,25  |
|  | <b>4.726.090,47</b>                       | <b>42.068.707,79</b>                                    | <b>4.394.051,56</b>   |
| <b>Aufwendungen</b>  |   |   |   |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | -   | -   | -   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 26.309,34                                 | 218,61  | 18,90   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -   | -   | -   |
| Rechnungsprüfungs-, Rechts-, Registrierungs-, Verwaltungsrats- sowie andere Kosten       | 17.183,36                                 | 67.772,22   | 7.099,80  |
| Honorar für die zentrale Verwaltung (Anmerkung 3b)                                       | 330.961,57                                | 1.047.458,75  | 45.466,12   |
| Verwahrstellengebühr (Anmerkung 3b)  | 12.174,66                                 | 37.771,09   | 3.875,16  |
| Vertriebsgebühren E- und HE-Anteile (Anmerkung 3c)                                       | 5.006,10                                  | 5.838,94  | -   |
| Verwaltungsgebühr (Anmerkung 3a)   | 1.919.282,49                              | 3.388.775,32  | 88.168,67   |
| Kosten für Druck, Veröffentlichung und Internet (Anmerkung 3b)                           | 9.440,55                                  | 8.986,70  | 127,42  |
| Taxe d'abonnement (Anmerkung 3b)   | 46.381,54                                 | 86.252,98   | 22.530,70   |
| Transaktionsbezogene Kosten (Anmerkung 11)   | 9.420,00                                  | 111.700,80  | 17.185,10   |
|  | <b>2.376.159,61</b>                       | <b>4.754.775,41</b>                                     | <b>184.471,87</b>   |
| <b>Nettoertrag/(-verlust)</b>  | <b>2.349.930,86</b>                       | <b>37.313.932,38</b>                                    | <b>4.209.579,69</b>   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren                                     | 12.255.028,45                             | 22.027.292,98   | 68.840,37   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps                                     | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps                             | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures)                       | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps  | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen   | -   | -   | -   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten                          | (13.291,22)                               | (13.144.499,20)   | (10.044.057,49)   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen                                   | (29.475,04)                               | (1.691.232,61)  | (785.253,65)  |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>   | <b>14.562.193,05</b>                      | <b>44.505.493,55</b>                                    | <b>(6.550.891,08)</b>   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren                 | 25.345.143,51                             | (11.616.919,41)   | 2.383.964,08  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps                 | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps         | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Terminkontrakten (Futures)   | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps                    | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen                     | -   | -   | -   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Devisenterminkontrakten      | -   | (14.748.214,38)   | 3.411.375,25  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen               | 375,81                                    | (0,57)  | (1,73)  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Pensionsgeschäften           | -   | -   | -   |
| <b>Nettoerhöhung/(-minderung) des Nettovermögens gemäß Ertrags- und Aufwandsrechnung</b> | <b>39.907.712,37</b>                      | <b>18.140.359,19</b>                                    | <b>(755.553,48)</b>   |
| Auflösung der Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                                      | -   | -   | -   |
| <b>Veränderungen im gezeichneten Kapital</b>   |   |   |   |
| Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen  | 109.735.471,49                            | 120.868.450,28  | 778.308.233,16  |
| Zahlungen durch Rücknahme von Anteilen   | (39.976.566,94)                           | (343.492.647,43)  | (3.315.235,69)  |
| Gezahlte Dividenden (Anmerkung 12)   | -   | (1.062.299,79)  | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>                   | <b>251.245.138,43</b>                     | <b>769.740.911,79</b>                                   | <b>774.237.443,99</b>   |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                               | -   | -   | -   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>                  | <b>251.245.138,43</b>                     | <b>769.740.911,79</b>                                   | <b>774.237.443,99</b>   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>North American<br>Small Cap Fund | Nordea 1 -<br>North American<br>Stars Equity Fund | Nordea 1 -<br>North American<br>Value Fund | Nordea 1 -<br>Norwegian<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>Norwegian<br>Equity Fund |
|--|---|--|--------------------------------------|--|
| (in USD)                                       | (in USD)  | (in USD)                                   | (in NOK)                             | (in NOK)                               |
| <b>43.667.610,62</b>                           | <b>933.106.913,10</b>                             | <b>410.848.924,57</b>                      | <b>4.791.955.216,63</b>              | <b>969.806.278,83</b>                  |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| 339.085,77                                     | 13.135.616,29                                     | 4.212.426,18                               | -                                    | 44.106.439,21                          |
| -  | -   | -  | 67.823.875,34                        | -                                      |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| -  | -   | -  | 31.033.415,95                        | -                                      |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| 0,66   | 6,02  | 1,95                                       | 15,01                                | 10,89                                  |
| <b>339.086,43</b>                              | <b>13.135.622,31</b>                              | <b>4.212.428,13</b>                        | <b>98.857.306,30</b>                 | <b>44.106.450,10</b>                   |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| 63,42  | 610,23  | 37,07                                      | 174.160,56                           | 32.265,82                              |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| 4.688,84                                       | 132.600,68  | 34.543,29                                  | 379.833,78                           | 88.658,60                              |
| 122.300,86                                     | 2.078.381,61                                      | 873.197,70                                 | 6.470.975,99                         | 2.067.823,91                           |
| 1.851,89                                       | 76.201,31   | 19.194,93                                  | 183.274,55                           | 65.164,77                              |
| 6.113,79                                       | 19.746,30   | 13.854,59                                  | 916.153,96                           | 184.889,11                             |
| 761.749,10                                     | 12.657.853,92                                     | 5.295.142,32                               | 24.725.727,76                        | 14.880.074,11                          |
| 7.425,90                                       | 100.736,24  | 48.041,07                                  | 680.132,12                           | 170.160,81                             |
| 24.262,06                                      | 432.796,14  | 154.828,80                                 | 2.095.640,53                         | 509.291,14                             |
| 14.635,50                                      | 34.511,25   | 34.559,97                                  | 87.346,35                            | 51.739,12                              |
| <b>943.091,36</b>                              | <b>15.533.437,68</b>                              | <b>6.473.399,74</b>                        | <b>35.713.245,60</b>                 | <b>18.050.067,39</b>                   |
| <b>(604.004,93)</b>                            | <b>(2.397.815,37)</b>                             | <b>(2.260.971,61)</b>                      | <b>63.144.060,70</b>                 | <b>26.056.382,71</b>                   |
| 5.410.506,44                                   | 95.109.586,56                                     | 76.444.519,46                              | 12.224.573,04                        | 101.251.265,43                         |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| -  | -   | -  | 10.594.486,12                        | -                                      |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| (172.142,14)                                   | (2.396.160,48)                                    | (517.519,61)                               | (138.686,29)                         | (117.804,43)                           |
| (19.702,85)                                    | (1.434.348,04)                                    | 160.476,28                                 | 2.387.761,96                         | 179.046,18                             |
| <b>4.614.656,52</b>                            | <b>88.881.262,67</b>                              | <b>73.826.504,52</b>                       | <b>88.212.195,53</b>                 | <b>127.368.889,89</b>                  |
| 5.124.097,56                                   | 218.020.964,25                                    | (16.414.087,47)                            | (74.830.875,21)                      | 79.323.957,34                          |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| -  | -   | -  | (115.259.955,47)                     | -                                      |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| (58.047,40)                                    | (553.477,99)                                      | (276.709,38)                               | -                                    | -                                      |
| 358,03   | 1.092,71  | (562,90)                                   | (2.326.010,64)                       | (237,04)                               |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| <b>9.681.064,71</b>                            | <b>306.349.841,64</b>                             | <b>57.135.144,77</b>                       | <b>(104.204.645,79)</b>              | <b>206.692.610,19</b>                  |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| 37.307.352,32                                  | 1.384.630.915,94                                  | 74.484.457,61                              | 1.350.673.882,24                     | 306.550.595,91                         |
| (39.776.780,56)                                | (575.354.702,07)                                  | (198.962.814,92)                           | (1.097.514.548,03)                   | (430.057.227,15)                       |
| (33,03)  | (43.045,24)                                       | (34.882,98)                                | (16.332.824,43)                      | (1.539.911,23)                         |
| <b>50.879.214,06</b>                           | <b>2.048.689.923,37</b>                           | <b>343.470.829,05</b>                      | <b>4.924.577.080,62</b>              | <b>1.051.452.346,55</b>                |
| -  | -   | -  | -                                    | -                                      |
| <b>50.879.214,06</b>                           | <b>2.048.689.923,37</b>                           | <b>343.470.829,05</b>                      | <b>4.924.577.080,62</b>              | <b>1.051.452.346,55</b>                |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>Norwegian<br>Short-Term<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>Stable Emerging<br>Markets<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Stable<br>Return Fund |
|--|--|---|-------------------------------------|
|  | (in NOK)   | (in USD)  | (in EUR)                            |
| <b>Summe Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>                                 | <b>4.346.103.906,64</b>                            | <b>566.043.315,98</b>                                   | <b>7.650.691.014,59</b>             |
| <b>Bewertungsdifferenz zum gesamten Nettoanfangsvermögen (Anmerkung 2)</b>               | -  | -   | -                                   |
| <b>Konsolidiertes gesamtes Nettoanfangsvermögen zum Kurs am Jahresende</b>               | -  | -   | -                                   |
| <b>Erträge</b>   |  |   |                                     |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | -  | 16.724.182,27   | 105.281.815,72                      |
| Nettozinsen aus Anleihen (Anmerkung 2)   | 45.610.290,21                                      | -   | 14.697.518,62                       |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | -  | -   | -                                   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -  | -   | 876.590,42                          |
| Nettozinsen aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 4)   | -  | -   | -                                   |
| Andere Erträge   | 8,07   | 0,37  | 25.817,25                           |
|  | <b>45.610.298,28</b>                               | <b>16.724.182,64</b>                                    | <b>120.881.742,01</b>               |
| <b>Aufwendungen</b>  |  |   |                                     |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | -  | -   | -                                   |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 62.377,69  | 1.221,71  | 1.822.216,82                        |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -  | -   | -                                   |
| Rechnungsprüfungs-, Rechts-, Registrierungs-, Verwaltungsrats- sowie andere Kosten       | 317.493,76   | 40.086,86   | 633.458,65                          |
| Honorar für die zentrale Verwaltung (Anmerkung 3b)                                       | 5.207.220,34                                       | 513.579,57  | 13.065.478,54                       |
| Verwahrstellengebühr (Anmerkung 3b)  | 204.472,16   | 130.184,08  | 584.737,15                          |
| Vertriebsgebühren E- und HE-Anteile (Anmerkung 3c)                                       | 888.141,76   | 33.886,97   | 4.104.696,61                        |
| Verwaltungsgebühr (Anmerkung 3a)   | 4.667.162,21                                       | 3.342.736,34  | 90.145.803,11                       |
| Kosten für Druck, Veröffentlichung und Internet (Anmerkung 3b)                           | 495.688,91   | 774,91  | 837.211,74                          |
| Taxe d'abonnement (Anmerkung 3b)   | 1.602.252,82                                       | 63.798,67   | 2.714.080,90                        |
| Transaktionsbezogene Kosten (Anmerkung 11)   | 44.589,55  | 77.031,62   | 982.030,30                          |
|  | <b>13.489.399,20</b>                               | <b>4.210.273,73</b>                                     | <b>114.889.713,82</b>               |
| <b>Nettoertrag/(-verlust)</b>  | <b>32.120.899,08</b>                               | <b>12.513.908,91</b>                                    | <b>5.992.028,19</b>                 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren                                     | 4.112.155,44                                       | 19.500.163,28   | 581.715.861,87                      |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps                                     | -  | -   | -                                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps                             | -  | -   | (3.939.250,16)                      |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures)                       | -  | -   | (432.179.031,86)                    |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps  | -  | -   | -                                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen   | -  | -   | -                                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten                          | (3.429.536,64)                                     | 9.337,10  | (304.927.713,71)                    |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen                                   | 5.450.046,59                                       | (112.911,15)  | 10.713.068,86                       |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>   | <b>38.253.564,47</b>                               | <b>31.910.498,14</b>                                    | <b>(142.625.036,81)</b>             |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren                 | (6.566.308,84)                                     | 10.078.596,82   | 1.055.022.678,74                    |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps                 | -  | -   | -                                   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps         | -  | -   | 570.782,38                          |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Terminkontrakten (Futures)   | -  | -   | 28.145.877,61                       |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps                    | -  | -   | -                                   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen                     | -  | -   | -                                   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Devisenterminkontrakten      | -  | -   | (126.953.821,97)                    |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen               | 542,20   | (14.946,30)   | 3.990,40                            |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Pensionsgeschäften           | -  | -   | -                                   |
| <b>Nettoerhöhung/(-minderung) des Nettovermögens gemäß Ertrags- und Aufwandsrechnung</b> | <b>31.687.797,83</b>                               | <b>41.974.148,66</b>                                    | <b>814.164.470,35</b>               |
| Auflösung der Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                                      | -  | -   | -                                   |
| <b>Veränderungen im gezeichneten Kapital</b>   |  |   |                                     |
| Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen  | 2.071.233.614,92                                   | 87.068.068,21   | 1.425.738.565,09                    |
| Zahlungen durch Rücknahme von Anteilen   | (2.090.114.615,70)                                 | (231.417.955,82)  | (2.179.618.486,48)                  |
| Gezahlte Dividenden (Anmerkung 12)   | (5.653.850,13)                                     | (806.100,69)  | (24.550.849,53)                     |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>                   | <b>4.353.256.853,56</b>                            | <b>462.861.476,34</b>                                   | <b>7.686.424.714,02</b>             |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                               | -  | -   | -                                   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>                  | <b>4.353.256.853,56</b>                            | <b>462.861.476,34</b>                                   | <b>7.686.424.714,02</b>             |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

| Nordea 1 -<br>Swedish<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>Swedish Short-Term<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>Unconstrained<br>Bond Fund -<br>USD Hedged<br>(Anmerkung 1b) | Nordea 1 -<br>US Corporate<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>US Corporate Stars<br>Bond Fund<br>(Anmerkung 1a) |
|------------------------------------|---|--|---|---|
| (in SEK)                           | (in SEK)                                      | (in USD)   | (in USD)                                | (in USD)  |
| 884.623.870,73                     | 1.313.875.228,23                              | 51.163.085,68  | 3.476.537.278,45                        | -   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| 8.480.307,96                       | 13.064.965,31                                 | 644.539,17   | 91.334.972,26                           | 6.348.586,43  |
| 951,11                             | -   | -  | -                                       | -   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| 0,79                               | 8,66  | 0,01   | 4,65                                    | 0,32  |
| <b>8.481.259,86</b>                | <b>13.064.973,97</b>                          | <b>644.539,18</b>  | <b>91.334.976,91</b>                    | <b>6.348.586,75</b>   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| 76.183,90                          | 54.321,16                                     | 465,13   | 4.740,07                                | 246,53  |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| 65.620,96                          | 108.010,85                                    | 1.755,23   | 234.311,96                              | 16.053,42   |
| 1.089.493,84                       | 1.625.043,98                                  | 10.712,25  | 4.935.639,72                            | 126.518,66  |
| 44.940,06                          | 70.823,06                                     | 884,51   | 129.647,44                              | 26.253,93   |
| 567.751,99                         | 474.216,14                                    | 1.806,18   | 29.325,00                               | -   |
| 4.180.510,24                       | 1.560.908,04                                  | 28.405,41  | 11.756.973,94                           | 172.604,90  |
| 113.621,07                         | 128.566,06                                    | 281,61   | 156.176,14                              | 299,23  |
| 335.131,42                         | 417.289,97                                    | 1.495,00   | 617.464,67                              | 44.339,11   |
| 70.328,30                          | 42.285,49                                     | 3.245,55   | 636.633,83                              | 34.199,53   |
| <b>6.543.581,78</b>                | <b>4.481.464,75</b>                           | <b>49.050,87</b>   | <b>18.500.912,77</b>                    | <b>420.515,31</b>   |
| <b>1.937.678,08</b>                | <b>8.583.509,22</b>                           | <b>595.488,31</b>  | <b>72.834.064,14</b>                    | <b>5.928.071,44</b>   |
| 2.790.757,39                       | (11.521.306,91)                               | 2.402.616,45   | 69.337.554,28                           | (821.771,68)  |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| (1.907.206,50)                     | -   | 698.284,71   | 238.263,96                              | 119.562,50  |
| (12.751,11)                        | -   | -  | -                                       | -   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| (34.746,60)                        | (10.979,11)                                   | 230.661,45   | (67.681.885,45)                         | (40.923.436,09)   |
| (100.598,31)                       | 16.864,68                                     | (13.769,03)  | (8.414.858,38)                          | (2.287.766,08)  |
| <b>2.673.132,95</b>                | <b>(2.931.912,12)</b>                         | <b>3.913.281,89</b>  | <b>66.313.138,55</b>                    | <b>(37.985.339,91)</b>  |
| (20.553.621,55)                    | 3.055.944,91                                  | (3.208.531,50)   | (190.756.754,51)                        | (22.139.357,25)   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| 111.094,70                         | -   | (47.904,35)  | (781.896,63)                            | (753.593,75)  |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| -                                  | -   | (255.398,63)   | (69.648.245,00)                         | 10.170.997,98   |
| 609,53                             | 6.438,57                                      | (3,49)   | (165,38)                                | (78,37)   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| <b>(17.768.784,37)</b>             | <b>130.471,36</b>                             | <b>401.443,92</b>  | <b>(194.873.922,97)</b>                 | <b>(50.707.371,30)</b>  |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| 133.069.348,08                     | 204.723.401,35                                | 260.377,31   | 407.496.567,87                          | 1.571.694.513,01  |
| (291.817.694,33)                   | (329.319.867,63)                              | (51.824.906,91)  | (1.441.619.967,33)                      | (27.650.125,62)   |
| (469.733,27)                       | (58.365,30)                                   | -  | (2.927.273,97)                          | -   |
| <b>707.637.006,84</b>              | <b>1.189.350.868,01</b>                       | <b>-</b>   | <b>2.244.612.682,05</b>                 | <b>1.493.337.016,09</b>   |
| -                                  | -   | -  | -                                       | -   |
| <b>707.637.006,84</b>              | <b>1.189.350.868,01</b>                       | <b>-</b>   | <b>2.244.612.682,05</b>                 | <b>1.493.337.016,09</b>   |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31.12.2021

|  | Nordea 1 -<br>US High Yield<br>Bond Fund<br>(in USD) | Nordea 1 -<br>US Total Return<br>Bond Fund<br>(in USD) |
|--|--|--|
| <b>Summe Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>                                 | <b>989.344.264,79</b>                                | <b>945.580.727,40</b>                                  |
| <b>Bewertungsdifferenz zum gesamten Nettoanfangsvermögen (Anmerkung 2)</b>               | -  | -  |
| <b>Konsolidiertes gesamtes Nettoanfangsvermögen zum Kurs am Jahresende</b>               | -  | -  |
| <b>Erträge</b>   |  |  |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | -  | -  |
| Nettozinsen aus Anleihen (Anmerkung 2)   | 42.548.345,76  | 37.323.897,17  |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | -  | -  |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -  | -  |
| Nettozinsen aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 4)   | -  | -  |
| Andere Erträge   | 0,15   | 1,10   |
|  | <b>42.548.345,91</b>                                 | <b>37.323.898,27</b>                                   |
| <b>Aufwendungen</b>  |  |  |
| Nettodividenden (Anmerkung 2)  | -  | -  |
| Nettozinsen aus Bankguthaben   | 110,75   | 330,25   |
| Nettozinsen aus Derivaten  | -  | -  |
| Rechnungsprüfungs-, Rechts-, Registrierungs-, Verwaltungsrats- sowie andere Kosten       | 64.980,90  | 68.723,93  |
| Honorar für die zentrale Verwaltung (Anmerkung 3b)                                       | 762.060,19   | 2.118.961,97   |
| Verwahrstellengebühr (Anmerkung 3b)  | 36.017,71  | 35.652,39  |
| Vertriebsgebühren E- und HE-Anteile (Anmerkung 3c)                                       | 12.787,11  | 11.467,88  |
| Verwaltungsgebühr (Anmerkung 3a)   | 2.562.362,33   | 5.077.643,80   |
| Kosten für Druck, Veröffentlichung und Internet (Anmerkung 3b)                           | 28.664,99  | 33.376,97  |
| Taxe d'abonnement (Anmerkung 3b)   | 137.574,87   | 152.465,42   |
| Transaktionsbezogene Kosten (Anmerkung 11)   | 221.097,91   | 74.107,87  |
|  | <b>3.825.656,76</b>                                  | <b>7.572.730,48</b>                                    |
| <b>Nettoertrag/(-verlust)</b>  | <b>38.722.689,15</b>                                 | <b>29.751.167,79</b>                                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren                                     | 24.152.655,67  | (6.323.609,99)   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps                                     | -  | -  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps                             | -  | -  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures)                       | -  | -  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps  | -  | -  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen   | -  | -  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten                          | (29.824.994,39)                                      | (7.527.352,21)   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen                                   | (2.776.785,49)                                       | (1.175.792,74)   |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>   | <b>30.273.564,94</b>                                 | <b>14.724.412,85</b>                                   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren                 | (33.017.561,59)                                      | (20.449.153,98)  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps                 | -  | -  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps         | -  | -  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Terminkontrakten (Futures)   | -  | -  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps                    | -  | -  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen                     | -  | -  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Devisenterminkontrakten      | (26.822.089,62)                                      | (6.213.790,57)   |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen               | (110,60)   | 90,94  |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Pensionsgeschäften           | -  | -  |
| <b>Nettoerhöhung/(-minderung) des Nettovermögens gemäß Ertrags- und Aufwandsrechnung</b> | <b>(29.566.196,87)</b>                               | <b>(11.938.440,76)</b>                                 |
| Auflösung der Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                                      | -  | -  |
| <b>Veränderungen im gezeichneten Kapital</b>   |  |  |
| Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen  | 110.549.734,33                                       | 269.356.294,81   |
| Zahlungen durch Rücknahme von Anteilen   | (401.854.194,82)                                     | (492.077.032,59)                                       |
| Gezahlte Dividenden (Anmerkung 12)   | (18.349,23)  | (4.977.250,37)   |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - vor Swing-Faktor-Anpassung</b>                   | <b>668.455.258,20</b>                                | <b>705.944.298,49</b>                                  |
| Erhöhung/(Minderung) Swing-Faktor-Anpassung (Anmerkung 10)                               | -  | -  |
| <b>Summe Nettovermögen zum Jahresende - nach Swing-Faktor-Anpassung</b>                  | <b>668.455.258,20</b>                                | <b>705.944.298,49</b>                                  |

Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|--|------------|--|------------------|------------------|--|
|  |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund</b>          | <b>EUR</b> | 531.421.500,19   | 334.878.776,85   | 263.774.580,09   | 4.496.100,582                                  |
| AC-Anteile                                 | EUR        | 110,42   | 105,03           | 102,54           | 10,000   |
| AI-Anteile                                 | EUR        | 116,14   | -                | -                | 18.165,000                                     |
| AP-Anteile                                 | EUR        | 108,56   | 103,95           | 102,04           | 84,829   |
| BC-Anteile                                 | EUR        | 115,10   | 107,87           | 103,27           | 44.050,105                                     |
| BF-Anteile                                 | EUR        | 113,84   | 106,43           | -                | 9,573  |
| BI-Anteile                                 | EUR        | 116,13   | 108,59           | 103,74           | 698.471,619                                    |
| BP-Anteile                                 | EUR        | 112,64   | 106,19           | 102,28           | 719.855,590                                    |
| E-Anteile                                  | EUR        | 109,63   | 104,12           | 101,04           | 173.366,038                                    |
| HB SEK-Anteile                             | SEK        | 1.169,01   | 1.098,35         | 1.056,11         | 60,947   |
| HBI USD-Anteile                            | USD        | 134,99   | 118,62           | -                | 7.054,742                                      |
| HY NOK-Anteile                             | NOK        | 1.185,10   | 1.086,92         | 1.019,48         | 131.482,214                                    |
| HY SEK-Anteile                             | SEK        | 1.244,67   | 1.148,78         | 1.084,22         | 1.022.563,968                                  |
| Y-Anteile                                  | EUR        | 120,42   | 111,45           | 105,38           | 1.680.925,957                                  |
| <b>Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund</b>         | <b>EUR</b> | 5.093.496.129,71   | 3.694.239.157,70 | 2.769.141.931,55 | 332.858.162,368                                |
| AC-Anteile                                 | EUR        | 14,07  | 12,94            | 12,25            | 12.306,000                                     |
| AP-Anteile                                 | EUR        | 13,81  | 12,79            | 12,19            | 438.866,139                                    |
| BV-Anteile                                 | EUR        | 15,62  | 13,50            | -                | 890.678,549                                    |
| BC-Anteile                                 | EUR        | 14,83  | 13,41            | 12,45            | 814.955,404                                    |
| BF-Anteile                                 | EUR        | 14,63  | 13,20            | -                | 3.917.523,564                                  |
| BI-Anteile                                 | EUR        | 15,33  | 13,84            | 12,82            | 53.114.780,713                                 |
| BP-Anteile                                 | EUR        | 14,46  | 13,16            | 12,29            | 82.214.331,138                                 |
| E-Anteile                                  | EUR        | 13,90  | 12,74            | 11,99            | 11.010.265,405                                 |
| HAC SEK-Anteile                            | SEK        | -  | 136,68           | 129,14           | -  |
| HAX GBP-Anteile                            | GBP        | 13,64  | 12,30            | 11,43            | 9.809.308,775                                  |
| HB CHF-Anteile                             | CHF        | 15,16  | 13,84            | 12,97            | 116.917,000                                    |
| HB NOK-Anteile                             | NOK        | 140,08   | 126,15           | 117,00           | 2.567.602,043                                  |
| HB SEK-Anteile                             | SEK        | 149,06   | 135,28           | 126,22           | 20.031.055,362                                 |
| HB USD-Anteile                             | USD        | 17,92  | 16,20            | 14,91            | 1.695.206,133                                  |
| HBC CHF-Anteile                            | CHF        | 15,83  | 14,37            | -                | 15.493,978                                     |
| HBC GBP-Anteile                            | GBP        | 13,62  | 12,24            | 11,30            | 37.703,000                                     |
| HBC SEK-Anteile                            | SEK        | 144,96   | 130,66           | 121,20           | 21.619.329,815                                 |
| HBC USD-Anteile                            | USD        | 18,92  | 16,98            | 15,54            | 177.862,854                                    |
| HBF NOK-Anteile                            | NOK        | 160,84   | 143,74           | -                | 43.218,824                                     |
| HBF SEK-Anteile                            | SEK        | 153,57   | 138,28           | -                | 16.657,611                                     |
| HBI CHF-Anteile                            | CHF        | 17,04  | 15,43            | 14,35            | 9.773.119,646                                  |
| HBI GBP-Anteile                            | GBP        | 13,62  | 12,20            | 11,24            | 380.380,241                                    |
| HBI JPY-Anteile                            | JPY        | 1.946,00   | -                | -                | 6.418.059,956                                  |
| HBI NOK-Anteile                            | NOK        | -  | 167,61           | -                | -  |
| HBI SEK-Anteile                            | SEK        | 158,29   | 142,50           | 131,86           | 7.503.852,319                                  |
| HBI SGD-Anteile                            | SGD        | 24,00  | 21,48            | -                | 2.100.249,038                                  |
| HBI USD-Anteile                            | USD        | 18,27  | 16,38            | 14,97            | 12.877.800,567                                 |
| HE PLN-Anteile                             | PLN        | 63,16  | 57,40            | 53,51            | 525,515  |
| HM SGD-Anteile                             | SGD        | 20,39  | 18,96            | 18,09            | 2.762,431                                      |
| HX GBP-Anteile                             | GBP        | 13,95  | 12,38            | 11,27            | 8.726.468,982                                  |
| HY SEK-Anteile                             | SEK        | 164,34   | -                | -                | 18.018.136,790                                 |
| X-Anteile                                  | EUR        | 15,92  | 14,21            | 13,01            | 4.782.700,649                                  |
| Y-Anteile                                  | EUR        | 16,61  | 14,82            | 13,58            | 53.730.043,927                                 |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.



| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse  |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|------------------|------------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund</b>          | <b>EUR</b> | 4.968.655.663,66   | 2.801.545.792,43 | 1.836.096.313,91 | 43.820.435,607                                 |
| AC-Anteile                                  | EUR        | 93,24  | 81,92            | 74,39            | 12.897,310                                     |
| AI-Anteile                                  | EUR        | 103,59   | 90,81            | 81,61            | 576.995,426                                    |
| AP-Anteile                                  | EUR        | 91,19  | 80,69            | 73,81            | 470.996,969                                    |
| BC-Anteile                                  | EUR        | 98,94  | 85,05            | 75,66            | 515.064,499                                    |
| BF-Anteile                                  | EUR        | 97,39  | 83,58            | -                | 1.405.878,367                                  |
| BI-Anteile                                  | EUR        | 107,17   | 91,93            | 81,60            | 14.344.479,335                                 |
| BP-Anteile                                  | EUR        | 96,21  | 83,28            | 74,60            | 5.820.957,761                                  |
| E-Anteile                                   | EUR        | 91,42  | 79,73            | 71,96            | 3.782.888,822                                  |
| HAC SEK-Anteile                             | SEK        | -  | 862,39           | 781,53           | -  |
| HB CHF-Anteile                              | CHF        | 108,56   | 94,29            | 84,80            | 33.474,007                                     |
| HB NOK-Anteile                              | NOK        | 938,40   | 803,62           | 716,02           | 150.923,939                                    |
| HB SEK-Anteile                              | SEK        | 902,87   | 779,36           | 697,74           | 305.776,019                                    |
| HB USD-Anteile                              | USD        | 117,18   | -                | -                | 92.438,876                                     |
| HBC GBP-Anteile                             | GBP        | 90,60  | 77,37            | 68,57            | 9.432,859                                      |
| HBC SEK-Anteile                             | SEK        | 987,66   | 846,65           | 752,59           | 247.548,209                                    |
| HBC USD-Anteile                             | USD        | 120,58   | -                | -                | 1.685,000                                      |
| HBF SEK-Anteile                             | SEK        | 1.016,05   | 869,51           | -                | 5.455,002                                      |
| HBI GBP-Anteile                             | GBP        | 88,84  | 75,71            | -                | 3.055.872,594                                  |
| HBI JPY-Anteile                             | JPY        | 13.489,00  | 11.550,00        | -                | 914.661,135                                    |
| HBI NOK-Anteile                             | NOK        | 1.079,37   | 915,96           | 804,02           | 2.991,696                                      |
| HBI SEK-Anteile                             | SEK        | 1.067,42   | 913,13           | 809,85           | 161.664,551                                    |
| HBI SGD-Anteile                             | SGD        | 170,81   | -                | -                | 169.752,762                                    |
| HBI USD-Anteile                             | USD        | 135,10   | 115,12           | 100,70           | 3.739.803,131                                  |
| HX SEK-Anteile                              | SEK        | -  | 1.054,02         | 922,48           | -  |
| HY SEK-Anteile                              | SEK        | 2.130,12   | -                | -                | 1.403.082,321                                  |
| X-Anteile                                   | EUR        | 102,01   | 86,35            | 75,64            | 4.038.680,783                                  |
| Y-Anteile                                   | EUR        | 215,23   | 182,18           | 159,59           | 2.557.034,234                                  |
| <b>Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund</b> | <b>USD</b> | 100.499.039,47   | 116.314.246,28   | 130.055.768,96   | 2.724.602,199                                  |
| AP-Anteile                                  | USD        | 32,17  | 33,62            | 25,76            | 52.865,455                                     |
| BC-Anteile                                  | USD        | 37,84  | 38,83            | 29,10            | 97.660,968                                     |
| BI-Anteile                                  | USD        | 41,90  | 42,90            | 32,09            | 322.128,842                                    |
| BP-Anteile                                  | USD        | 36,68  | 37,84            | 28,52            | 2.111.075,210                                  |
| E-Anteile                                   | USD        | 32,09  | 33,35            | 25,33            | 99.170,198                                     |
| HE PLN-Anteile                              | PLN        | 95,81  | 100,04           | 77,06            | 41.701,526                                     |
| <b>Nordea 1 - Asian Stars Equity Fund</b>   | <b>USD</b> | 237.934.880,71   | 214.838.594,64   | -                | 1.628.964,488                                  |
| AF-Anteile                                  | USD        | 146,25   | -                | -                | 7,282  |
| BC-Anteile                                  | USD        | 146,08   | -                | -                | 501,436  |
| BF-Anteile                                  | USD        | 146,23   | -                | -                | 42.905,005                                     |
| BI-Anteile                                  | USD        | 147,29   | 159,19           | -                | 463.853,187                                    |
| BP-Anteile                                  | USD        | 145,18   | 158,25           | -                | 122.303,190                                    |
| BQ-Anteile                                  | USD        | 145,60   | 158,36           | -                | 999.288,761                                    |
| E-Anteile                                   | USD        | 143,41   | 157,51           | -                | 105,627  |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse         |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                |                | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|--|------------|--|----------------|----------------|--|
|  |            | 31.12.2021   | 31.12.2020     | 31.12.2019     | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Balanced Income Fund</b>             | <b>EUR</b> | 603.118.468,57   | 552.844.557,60 | 390.038.044,66 | 4.922.194,390                                  |
| AP-Anteile   | EUR        | 110,18   | 110,06         | 109,14         | 4.855,082                                      |
| BC-Anteile   | EUR        | 120,63   | 117,58         | 113,51         | 42.227,705                                     |
| BF-Anteile   | EUR        | 118,79   | 115,54         | -              | 228.679,902                                    |
| BI-Anteile   | EUR        | 123,91   | 120,53         | 116,10         | 157.539,678                                    |
| BP-Anteile   | EUR        | 117,80   | 115,34         | 111,85         | 578.962,259                                    |
| E-Anteile  | EUR        | 109,45   | 107,98         | 105,49         | 112.282,039                                    |
| HAC SEK-Anteile                                    | SEK        | -  | 1.177,56       | 1.156,94       | -  |
| HB NOK-Anteile                                     | NOK        | 1.294,63   | 1.256,73       | -              | 341,336  |
| HB SEK-Anteile                                     | SEK        | 1.113,45   | 1.087,62       | 1.053,71       | 38.675,743                                     |
| HBC SEK-Anteile                                    | SEK        | 1.180,39   | 1.147,78       | 1.106,68       | 1.490.328,024                                  |
| HY NOK-Anteile                                     | NOK        | 1.266,87   | 1.213,07       | 1.153,64       | 122.604,389                                    |
| HY SEK-Anteile                                     | SEK        | 1.354,26   | 1.304,92       | 1.246,59       | 874.028,147                                    |
| Y-Anteile  | EUR        | 128,54   | 124,14         | 118,71         | 1.271.670,086                                  |
| <b>Nordea 1 - Chinese Bond Fund (Anmerkung 1c)</b> | <b>CNH</b> | 345.339.403,49   | 105.480.166,89 | 96.059.676,00  | 2.656.292,647                                  |
| AP-Anteile   | CNH        | 104,89   | 103,26         | 105,98         | 32.839,083                                     |
| BI-Anteile   | CNH        | 135,67   | 128,23         | 126,25         | 783.554,547                                    |
| BP-Anteile   | CNH        | 130,22   | 123,84         | 122,67         | 251.619,571                                    |
| E-Anteile  | CNH        | 123,90   | 118,71         | 118,48         | 66.040,911                                     |
| HB NOK-Anteile                                     | NOK        | 171,05   | -              | -              | 299,459  |
| HY EUR-Anteile                                     | EUR        | 16,17  | 15,74          | 15,93          | 628.535,512                                    |
| Z-Anteile  | CNH        | 135,85   | -              | -              | 893.403,564                                    |
| <b>Nordea 1 - Chinese Equity Fund</b>              | <b>USD</b> | 275.154.232,74   | 344.614.085,03 | 224.077.867,78 | 1.348.997,947                                  |
| BC-Anteile   | USD        | 177,63   | -              | -              | 3.912,754                                      |
| BI-Anteile   | USD        | 178,20   | 220,38         | -              | 1.470,705                                      |
| BP-Anteile   | USD        | 176,71   | 220,20         | 154,20         | 71.903,926                                     |
| E-Anteile  | USD        | 165,99   | 208,41         | 147,08         | 28.866,545                                     |
| Y-Anteile  | USD        | 206,54   | 252,89         | 174,04         | 1.242.844,017                                  |
| <b>Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund</b>   | <b>EUR</b> | 125.923.522,49   | 120.900.763,38 | -              | 1.242.531,424                                  |
| BI-Anteile   | EUR        | 101,30   | 101,01         | -              | 9,882  |
| BP-Anteile   | EUR        | 101,02   | 100,95         | -              | 94,501   |
| HBF SEK-Anteile                                    | SEK        | 1.055,83   | 1.050,81       | -              | 47,558   |
| HBI NOK-Anteile                                    | NOK        | 1.130,69   | 1.119,48       | -              | 45,230   |
| HBI SEK-Anteile                                    | SEK        | 1.080,74   | 1.075,28       | -              | 47,003   |
| HY DKK-Anteile                                     | DKK        | 756,12   | 753,30         | -              | 13.734,115                                     |
| Y-Anteile  | EUR        | 101,34   | 100,99         | -              | 1.228.553,135                                  |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|------------------|------------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund</b>                | <b>DKK</b> | 8.257.198.516,52   | 8.156.540.148,18 | 6.142.636.694,83 | 38.684.409,537                                 |
| AI-Anteile  | DKK        | 200,44   | 211,12           | 210,88           | 1.712.179,125                                  |
| AP-Anteile  | DKK        | 166,50   | 176,10           | 176,63           | 2.466.468,448                                  |
| BC-Anteile  | DKK        | 248,79   | 259,12           | 254,76           | 131.162,941                                    |
| BF-Anteile  | DKK        | 235,79   | -                | -                | 79.293,788                                     |
| BI-Anteile  | DKK        | 252,88   | 262,82           | 257,85           | 2.051.990,364                                  |
| BP-Anteile  | DKK        | 234,99   | 245,23           | 241,58           | 3.248.313,181                                  |
| E-Anteile   | DKK        | 205,73   | 216,30           | 214,70           | 89.533,309                                     |
| HAC EUR-Anteile   | EUR        | 32,19  | 33,98            | 33,98            | 7.390,000                                      |
| HAI EUR-Anteile   | EUR        | 24,46  | 25,77            | 25,72            | 14.013.405,143                                 |
| HBI CHF-Anteile   | CHF        | 39,83  | 41,54            | 40,84            | 543.787,668                                    |
| HBI EUR-Anteile   | EUR        | 34,60  | 35,98            | 35,26            | 11.566.978,936                                 |
| HBI SEK-Anteile   | SEK        | 139,09   | 144,30           | 141,04           | 1.437.776,935                                  |
| HBI USD-Anteile   | USD        | 51,21  | 52,82            | 51,10            | 62.937,000                                     |
| HMX JPY-Anteile   | JPY        | 4.169,00   | 4.382,00         | 4.352,00         | 1.273.192,699                                  |
| <b>Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund</b>               | <b>USD</b> | 1.191.643.570,87   | 1.947.056.158,81 | 2.585.161.493,40 | 8.983.098,022                                  |
| AC-Anteile  | USD        | 128,78   | 138,81           | 144,76           | 15.989,591                                     |
| AI-Anteile  | USD        | 114,24   | 122,88           | 127,86           | 606.495,680                                    |
| AP-Anteile  | USD        | 111,85   | 120,88           | 126,40           | 219.982,430                                    |
| BC-Anteile  | USD        | 155,23   | 158,47           | 153,06           | 38.784,378                                     |
| BF-Anteile  | USD        | 154,11   | -                | -                | 2.449,481                                      |
| BI-Anteile  | USD        | 160,81   | 163,84           | 157,92           | 1.028.995,831                                  |
| BP-Anteile  | USD        | 153,57   | 157,19           | 152,20           | 805.041,541                                    |
| E-Anteile   | USD        | 143,09   | 147,57           | 143,96           | 163.350,822                                    |
| HA EUR-Anteile  | EUR        | 88,83  | 96,61            | 103,21           | 2.187,518                                      |
| HAC EUR-Anteile   | EUR        | 99,74  | 108,20           | 115,28           | 242.280,779                                    |
| HAI EUR-Anteile   | EUR        | 77,79  | 84,22            | 89,54            | 585.972,835                                    |
| HB EUR-Anteile  | EUR        | 120,02   | 123,97           | 122,01           | 34.147,179                                     |
| HB NOK-Anteile  | NOK        | 864,02   | 885,96           | 875,98           | 63.437,127                                     |
| HB SEK-Anteile  | SEK        | 978,61   | 1.008,95         | 995,75           | 410.055,076                                    |
| HBC EUR-Anteile   | EUR        | 102,41   | 105,51           | 103,58           | 27.040,050                                     |
| HBC NOK-Anteile   | NOK        | 1.195,72   | 1.223,08         | 1.206,27         | 434.660,212                                    |
| HBD EUR-Anteile   | EUR        | 129,35   | 132,53           | -                | 1.044.140,120                                  |
| HBI CHF-Anteile   | CHF        | 152,68   | 157,33           | 155,92           | 47,199   |
| HBI DKK-Anteile   | DKK        | 1.041,73   | 1.070,80         | 1.050,09         | 517.698,802                                    |
| HBI EUR-Anteile   | EUR        | 113,11   | 116,29           | 113,93           | 913.654,403                                    |
| HBI NOK-Anteile   | NOK        | 857,59   | 875,37           | 861,48           | 790.117,751                                    |
| HBI SEK-Anteile   | SEK        | 1.300,47   | 1.334,48         | 1.310,96         | 939.285,238                                    |
| HMX EUR-Anteile   | EUR        | -  | 110,80           | 114,55           | -  |
| X-Anteile   | USD        | 167,49   | 169,28           | 161,85           | 97.283,979                                     |
| <b>Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund</b> | <b>USD</b> | 62.261.106,95  | 111.078.304,13   | 155.980.550,99   | 586.187,602                                    |
| BC-Anteile  | USD        | -  | 120,88           | -                | -  |
| BI-Anteile  | USD        | 118,78   | 125,86           | 122,67           | 397.504,677                                    |
| BP-Anteile  | USD        | 113,26   | 120,63           | 118,13           | 16.819,777                                     |
| E-Anteile   | USD        | 105,69   | 113,41           | 111,93           | 9.240,311                                      |
| HB SEK-Anteile  | SEK        | 966,57   | 1.038,13         | 1.037,15         | 202.558  |
| HBI DKK-Anteile   | DKK        | -  | 687,89           | 682,92           | -  |
| HBI NOK-Anteile   | NOK        | 630,96   | 671,19           | 668,23           | 3.130,086                                      |
| HBI SEK-Anteile   | SEK        | 677,30   | 723,88           | 719,44           | 159.290,193                                    |
| X-Anteile   | USD        | -  | 135,50           | 130,80           | -  |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                           |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                   |                   | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|--|------------|--|-------------------|-------------------|--|
|  |            | 31.12.2021   | 31.12.2020        | 31.12.2019        | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund</b>                | <b>USD</b> | 223.139.296,80   | 216.329.408,53    | 151.102.429,90    | 1.536.299,310                                  |
| AP-Anteile   | USD        | 100,17   | 104,80            | 102,34            | 20.273,897                                     |
| BC-Anteile   | USD        | 169,80   | 168,50            | -                 | 62,431   |
| BF-Anteile   | USD        | 170,02   | 168,54            | -                 | 500,000  |
| BI-Anteile   | USD        | 178,35   | 176,68            | 160,81            | 186.053,664                                    |
| BP-Anteile   | USD        | 169,02   | 168,29            | 153,95            | 159.820,864                                    |
| E-Anteile  | USD        | 156,73   | 157,23            | 144,92            | 50.570,716                                     |
| HB CHF-Anteile   | CHF        | 130,47   | 131,31            | 122,42            | 10.737,000                                     |
| HB EUR-Anteile   | EUR        | 118,43   | 118,92            | 110,49            | 136.132,444                                    |
| HB SEK-Anteile   | SEK        | 1.029,84   | 1.031,67          | 958,91            | 198.068,069                                    |
| HBC EUR-Anteile  | EUR        | 135,55   | 135,69            | 125,68            | 2.896,673                                      |
| HBF EUR-Anteile  | EUR        | 141,80   | 141,68            | -                 | 30.402,132                                     |
| HBI CHF-Anteile  | CHF        | 157,28   | -                 | -                 | 38,499   |
| HBI EUR-Anteile  | EUR        | 124,95   | 124,82            | 115,39            | 119.956,716                                    |
| HBI NOK-Anteile  | NOK        | 952,35   | 944,75            | 872,81            | 14.045,772                                     |
| HBI SEK-Anteile  | SEK        | -  | 1.083,41          | 1.001,89          | -  |
| HX EUR-Anteile   | EUR        | 126,20   | 124,90            | 114,36            | 606.740,433                                    |
| <b>Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>            | <b>USD</b> | 91.067.160,55  | 72.567.478,94     | 34.445.295,42     | 798.229,333                                    |
| BC-Anteile   | USD        | -  | 118,78            | 112,09            | -  |
| BF-Anteile   | USD        | 106,43   | -                 | -                 | 10,648   |
| BI-Anteile   | USD        | 109,21   | 119,64            | 112,66            | 10,637   |
| BP-Anteile   | USD        | 105,98   | 116,99            | 110,96            | 16.760,560                                     |
| E-Anteile  | USD        | 102,68   | 114,21            | 109,14            | 2.671,533                                      |
| HBI EUR-Anteile  | EUR        | -  | 101,43            | -                 | -  |
| HX NOK-Anteile   | NOK        | 1.007,53   | 1.098,16          | -                 | 778.775,955                                    |
|  |            | <b>26.08.2021*</b>   | <b>31.12.2020</b> | <b>31.12.2019</b> | <b>26.08.2021*</b>                             |
| <b>Nordea 1 - Emerging Markets Small Cap Fund<br/>(Anmerkung 1b)</b> | <b>USD</b> | 25.393.190,83  | 21.354.870,52     | 175.019.327,19    | 185.518,039                                    |
| BC-Anteile   | USD        | 135,05   | 123,91            | 110,44            | 12.951,464                                     |
| BF-Anteile   | USD        | 133,53   | 122,36            | -                 | 13,022   |
| BI-Anteile   | USD        | 140,64   | 128,86            | 114,62            | 107.058,041                                    |
| BP-Anteile   | USD        | 132,53   | 122,02            | 109,36            | 52.936,951                                     |
| E-Anteile  | USD        | 125,02   | 115,68            | 104,46            | 12.558,561                                     |

(\*) Bei zusammengelegten oder liquidierten Teilfonds entsprechen die ausgewiesenen Beträge der letzten Berechnung des Nettoinventarwerts, die vor dem Datum der Zusammenlegung oder Liquidation vorgenommen wurde. Nähere Angaben sind in Anmerkung 1b zu finden.

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse       |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|--|------------|--|------------------|------------------|--|
|  |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund</b>       | <b>USD</b> | 1.571.770.326,25   | 1.098.501.306,61 | 232.536.856,47   | 13.788.777,362                                 |
| AI-Anteile                                       | USD        | 108,70   | 112,08           | -                | 13,607   |
| AP-Anteile                                       | USD        | 103,89   | 112,02           | 110,53           | 14,746   |
| BC-Anteile                                       | USD        | 115,29   | 118,49           | 110,80           | 15,000   |
| BF-Anteile                                       | USD        | 115,05   | 117,93           | -                | 9,496  |
| BI-Anteile                                       | USD        | 116,01   | 119,01           | 111,05           | 5.933.241,329                                  |
| BP-Anteile                                       | USD        | 114,26   | 117,82           | 110,50           | 11.529,371                                     |
| E-Anteile  | USD        | 111,76   | 116,11           | 109,71           | 6.475,195                                      |
| HAF SEK-Anteile                                  | SEK        | 908,55   | 941,69           | -                | 1.881,002                                      |
| HAI GBP-Anteile                                  | GBP        | 86,72  | 89,59            | -                | 51,026   |
| HB EUR-Anteile                                   | EUR        | 95,21  | 99,04            | 94,36            | 1.225.377,926                                  |
| HB NOK-Anteile                                   | NOK        | 947,06   | 978,11           | 934,04           | 9.052,051                                      |
| HB SEK-Anteile                                   | SEK        | 979,61   | 1.017,21         | 970,73           | 73.682,309                                     |
| HBF EUR-Anteile                                  | EUR        | 95,78  | 99,19            | -                | 134.187,040                                    |
| HBF NOK-Anteile                                  | NOK        | 1.051,95   | 1.081,18         | -                | 36.899,962                                     |
| HBF SEK-Anteile                                  | SEK        | 988,93   | 1.022,03         | -                | 116.201,373                                    |
| HBI CHF-Anteile                                  | CHF        | 104,35   | 108,24           | -                | 56,269   |
| HBI EUR-Anteile                                  | EUR        | 101,19   | 104,74           | -                | 492.604,423                                    |
| HBI NOK-Anteile                                  | NOK        | 961,42   | 987,67           | 938,43           | 6.875,429                                      |
| HBI SEK-Anteile                                  | SEK        | 994,54   | 1.027,42         | 975,47           | 4.887,442                                      |
| HX NOK-Anteile                                   | NOK        | 995,45   | -                | -                | 1.521.939,462                                  |
| HY DKK-Anteile                                   | DKK        | 748,13   | 769,40           | 725,49           | 1.304.105,232                                  |
| HY EUR-Anteile                                   | EUR        | 100,20   | 103,06           | 97,08            | 2.909.677,672                                  |
| X-Anteile  | USD        | -  | 117,93           | -                | -  |
| <b>Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund</b>     | <b>USD</b> | 5.839.913.927,85   | 6.042.784.402,27 | 2.771.316.614,95 | 31.954.707,769                                 |
| AC-Anteile                                       | USD        | 173,04   | 193,31           | 141,45           | 92.004,336                                     |
| AF-Anteile                                       | USD        | 170,82   | 189,32           | -                | 1.890,746                                      |
| AI-Anteile                                       | USD        | 179,21   | 199,78           | 147,71           | 1.228.133,168                                  |
| AP-Anteile                                       | USD        | 168,31   | 189,24           | 141,11           | 175.104,162                                    |
| BC-Anteile                                       | USD        | 185,21   | 205,41           | 149,29           | 504.965,011                                    |
| BF-Anteile                                       | USD        | 177,87   | 196,96           | -                | 245.928,150                                    |
| BI-Anteile                                       | USD        | 191,52   | 211,96           | 153,73           | 11.162.818,027                                 |
| BP-Anteile                                       | USD        | 175,85   | 196,30           | 143,60           | 15.219.429,178                                 |
| E-Anteile  | USD        | 161,67   | 181,84           | 134,02           | 322.743,983                                    |
| HB CHF-Anteile                                   | CHF        | 157,95   | 178,47           | -                | 101,000  |
| HBC CHF-Anteile                                  | CHF        | 166,29   | 186,69           | -                | 4.977,000                                      |
| HBC GBP-Anteile                                  | GBP        | 135,74   | 151,32           | 112,14           | 2.761,617                                      |
| HBI CHF-Anteile                                  | CHF        | 171,96   | 192,66           | -                | 87.856,748                                     |
| HBI EUR-Anteile                                  | EUR        | 143,29   | 160,23           | 118,12           | 485.915,413                                    |
| JI-Anteile                                       | USD        | 191,31   | 211,97           | -                | 54.028,560                                     |
| X-Anteile  | USD        | 192,91   | -                | -                | 1.708.537,085                                  |
| Y-Anteile  | USD        | 203,20   | 222,93           | 160,28           | 657.513,585                                    |
| <b>Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund</b> | <b>USD</b> | 63.866.559,47  | 60.168.951,30    | 57.299.160,36    | 556.788,328                                    |
| BF-Anteile                                       | USD        | 114,52   | -                | -                | 9,885  |
| BI-Anteile                                       | USD        | 117,88   | 129,24           | 126,07           | 250.937,307                                    |
| BP-Anteile                                       | USD        | 114,20   | 125,84           | 123,39           | 22.495,747                                     |
| E-Anteile  | USD        | 109,09   | 121,11           | 119,65           | 2.404,036                                      |
| HB EUR-Anteile                                   | EUR        | 88,79  | 98,89            | 98,62            | 1.524,789                                      |
| HB SEK-Anteile                                   | SEK        | 811,16   | 901,72           | 900,21           | 13.686,814                                     |
| HBF EUR-Anteile                                  | EUR        | 95,55  | 105,88           | -                | 669,009  |
| Y-Anteile  | USD        | 113,19   | 123,20           | -                | 265.060,741                                    |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                         |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                   |                   | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|--|------------|--|-------------------|-------------------|--|
|  |            | 31.12.2021   | 31.12.2020        | 31.12.2019        | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund (Anmerkung 1b)</b>       | <b>EUR</b> | 139.428.636,59   | 142.857.697,16    | 72.510.543,51     | 5.151.424,019                                  |
| AI-Anteile   | EUR        | 23,78  | 26,14             | 23,13             | 1.300,000                                      |
| BC-Anteile   | EUR        | 26,54  | 28,98             | 25,30             | 89.495,371                                     |
| BF-Anteile   | EUR        | 25,37  | -                 | -                 | 323.690,306                                    |
| BI-Anteile   | EUR        | 27,95  | 30,46             | 26,53             | 815.970,658                                    |
| BP-Anteile   | EUR        | 25,20  | 27,67             | 24,29             | 1.315.135,057                                  |
| E-Anteile  | EUR        | 22,86  | 25,28             | 22,36             | 188.610,718                                    |
| HE PLN-Anteile   | PLN        | 109,21   | 120,10            | 106,03            | 130,628  |
| X-Anteile  | EUR        | 28,36  | 30,60             | -                 | 2.417.091,281                                  |
| <b>Nordea 1 - European Corporate Bond Fund</b>                     | <b>EUR</b> | 545.867.740,19   | 592.754.401,21    | 571.871.369,85    | 10.440.853,000                                 |
| BC-Anteile   | EUR        | 50,30  | -                 | -                 | 4.703,097                                      |
| BF-Anteile   | EUR        | 50,44  | 51,12             | -                 | 1.555,993                                      |
| BI-Anteile   | EUR        | 53,33  | 54,02             | 52,79             | 302.175,190                                    |
| BP-Anteile   | EUR        | 50,21  | 51,07             | 50,11             | 715.682,246                                    |
| E-Anteile  | EUR        | 43,91  | 44,99             | 44,48             | 93.607,260                                     |
| HB NOK-Anteile   | NOK        | 509,29   | 513,94            | 500,86            | 34.368,106                                     |
| HB SEK-Anteile   | SEK        | 526,02   | 533,68            | 522,83            | 1.335.420,005                                  |
| HBC NOK-Anteile  | NOK        | 500,10   | 503,57            | 489,81            | 1.023.162,224                                  |
| HBC SEK-Anteile  | SEK        | -  | 543,71            | 531,61            | -  |
| HBI SEK-Anteile  | SEK        | 509,41   | 514,73            | 502,25            | 2.545.765,242                                  |
| HE PLN-Anteile   | PLN        | 219,76   | 223,28            | 218,62            | 159,085  |
| HY DKK-Anteile   | DKK        | 410,93   | 414,60            | -                 | 909.310,650                                    |
| Y-Anteile  | EUR        | 54,99  | 55,50             | 54,04             | 3.474.943,902                                  |
|  |            | <b>29.10.2021*</b>   | <b>31.12.2020</b> | <b>31.12.2019</b> | <b>29.10.2021*</b>                             |
| <b>Nordea 1 - European Corporate Bond Fund Plus (Anmerkung 1b)</b> | <b>EUR</b> | 57.387.147,24  | 93.564.042,08     | 88.973.703,12     | 364.240,674                                    |
| BC-Anteile   | EUR        | -  | 150,17            | 146,27            | -  |
| BI-Anteile   | EUR        | 149,43   | 150,81            | 146,58            | 52,004   |
| X-Anteile  | EUR        | 157,55   | 158,40            | 153,22            | 364.188,670                                    |
|  |            | <b>31.12.2021</b>  | <b>31.12.2020</b> | <b>31.12.2019</b> | <b>31.12.2021</b>                              |
| <b>Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund</b>               | <b>EUR</b> | 1.258.909.989,13   | 563.876.499,76    | 254.649.057,26    | 11.654.030,492                                 |
| AP-Anteile   | EUR        | 102,24   | 105,78            | 105,80            | 9,890  |
| BF-Anteile   | EUR        | 105,74   | 107,57            | -                 | 196.793,998                                    |
| BI-Anteile   | EUR        | 106,53   | 108,31            | 106,16            | 618.788,337                                    |
| BP-Anteile   | EUR        | 105,21   | 107,41            | 105,70            | 19.035,768                                     |
| E-Anteile  | EUR        | 103,14   | 106,03            | 105,09            | 1.661,725                                      |
| HAF SEK-Anteile  | SEK        | 1.063,11   | 1.079,39          | -                 | 4.880,891                                      |
| HB NOK-Anteile   | NOK        | 1.058,01   | 1.071,32          | 1.047,99          | 108,069  |
| HB SEK-Anteile   | SEK        | 1.082,69   | 1.102,56          | 1.083,28          | 468.275,792                                    |
| HBC SEK-Anteile  | SEK        | -  | 1.105,26          | 1.085,68          | -  |
| HBF NOK-Anteile  | NOK        | 1.159,94   | 1.170,46          | -                 | 20.891,367                                     |
| HBF SEK-Anteile  | SEK        | 1.090,17   | 1.106,17          | -                 | 197.081,060                                    |
| HBI NOK-Anteile  | NOK        | 1.071,39   | 1.080,43          | 1.051,93          | 1.741,936                                      |
| HBI SEK-Anteile  | SEK        | 1.096,43   | 1.111,68          | 1.087,77          | 18.857,774                                     |
| HX NOK-Anteile   | NOK        | 1.096,75   | -                 | -                 | 2.764.989,902                                  |
| X-Anteile  | EUR        | 107,71   | 109,11            | 106,54            | 4.211.427,909                                  |
| Y-Anteile  | EUR        | 107,72   | 109,12            | 106,55            | 3.129.486,074                                  |

(\*) Bei zusammengelegten oder liquidierten Teilfonds entsprechen die ausgewiesenen Beträge der letzten Berechnung des Nettoinventarwerts, die vor dem Datum der Zusammenlegung oder Liquidation vorgenommen wurde. Nähere Angaben sind in Anmerkung 1b zu finden.

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                 |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|--|------------|--|------------------|------------------|--|
|  |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - European Covered Bond Fund</b>               | <b>EUR</b> | 5.706.671.932,11   | 7.512.639.694,36 | 5.662.985.153,44 | 406.286.472,985                                |
| AC-Anteile   | EUR        | 12,74  | 13,15            | 12,83            | 5.442.599,632                                  |
| AI-Anteile   | EUR        | 13,67  | 14,08            | 13,76            | 32.707.955,043                                 |
| AP-Anteile   | EUR        | 12,62  | 13,05            | 12,80            | 5.276.608,734                                  |
| BC-Anteile   | EUR        | 13,58  | 13,89            | 13,43            | 10.890.458,159                                 |
| BF-Anteile   | EUR        | 14,99  | 15,30            | -                | 163.979,558                                    |
| BI-Anteile   | EUR        | 14,99  | 15,29            | 14,76            | 153.187.932,423                                |
| BP-Anteile   | EUR        | 13,39  | 13,72            | 13,30            | 123.042.835,341                                |
| E-Anteile  | EUR        | 11,55  | 11,92            | 11,64            | 33.337.266,992                                 |
| HB NOK-Anteile   | NOK        | 134,48   | 136,62           | 131,11           | 1.056,015                                      |
| HB SEK-Anteile   | SEK        | 139,73   | 142,80           | 138,02           | 42.154,534                                     |
| HBC CHF-Anteile  | CHF        | 15,38  | 15,76            | 15,30            | 459.866,731                                    |
| HBF SEK-Anteile  | SEK        | 156,54   | 159,24           | -                | 315,876  |
| HBI CHF-Anteile  | CHF        | 17,37  | 17,76            | 17,20            | 1.613.296,619                                  |
| HBI GBP-Anteile  | GBP        | 13,63  | 13,82            | 13,25            | 68.643,940                                     |
| HBI NOK-Anteile  | NOK        | 150,66   | 152,43           | 145,71           | 1.387.803,945                                  |
| HBI SEK-Anteile  | SEK        | 154,90   | 157,74           | 151,81           | 10.173.072,715                                 |
| HBI USD-Anteile  | USD        | 22,66  | 22,94            | 21,85            | 281.378,283                                    |
| HE PLN-Anteile   | PLN        | 57,55  | 58,91            | 56,91            | 12.300,000                                     |
| X-Anteile  | EUR        | 15,16  | 15,41            | 14,82            | 581.074,000                                    |
| Y-Anteile  | EUR        | 15,21  | 15,47            | 14,87            | 27.615.874,445                                 |
| <b>Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund</b> | <b>EUR</b> | 691.897.912,82   | 153.607.704,56   | 128.703.991,89   | 6.323.290,840                                  |
| AC-Anteile   | EUR        | 106,02   | 106,97           | 104,66           | 223.492,000                                    |
| AI-Anteile   | EUR        | 109,47   | -                | -                | 9,014  |
| BC-Anteile   | EUR        | 108,83   | 108,07           | 104,70           | 105.534,926                                    |
| BF-Anteile   | EUR        | 108,68   | 107,67           | -                | 8,974  |
| BI-Anteile   | EUR        | 109,47   | 108,47           | 104,86           | 1.755.943,630                                  |
| BP-Anteile   | EUR        | 108,01   | 107,52           | 104,43           | 1.272.223,789                                  |
| E-Anteile  | EUR        | 105,68   | 105,99           | 103,71           | 296.514,500                                    |
| HB CHF-Anteile   | CHF        | 116,06   | -                | -                | 50,501   |
| HB USD-Anteile   | USD        | 124,61   | -                | -                | 51,583   |
| HBC CHF-Anteile  | CHF        | 116,95   | -                | -                | 390,146  |
| HBI CHF-Anteile  | CHF        | 117,63   | -                | -                | 60.839,012                                     |
| HBI NOK-Anteile  | NOK        | 1.087,96   | -                | -                | 18.286,885                                     |
| X-Anteile  | EUR        | 110,73   | -                | -                | 1.831.165,848                                  |
| Y-Anteile  | EUR        | 110,72   | 109,30           | 105,27           | 758.780,032                                    |
| <b>Nordea 1 - European Cross Credit Fund</b>               | <b>EUR</b> | 960.678.252,14   | 1.161.707.472,33 | 1.314.653.751,68 | 7.508.263,802                                  |
| AC-Anteile   | EUR        | 103,56   | 105,60           | 109,53           | 4.352,494                                      |
| AI-Anteile   | EUR        | 100,68   | 102,44           | 106,02           | 1.282.870,736                                  |
| AP-Anteile   | EUR        | 98,01  | 100,34           | 104,50           | 719.292,184                                    |
| BC-Anteile   | EUR        | 142,48   | 141,28           | 141,42           | 33.856,229                                     |
| BF-Anteile   | EUR        | 137,21   | 135,72           | -                | 241.911,178                                    |
| BI-Anteile   | EUR        | 144,53   | 143,02           | 142,86           | 2.821.699,307                                  |
| BP-Anteile   | EUR        | 135,96   | 135,36           | 136,04           | 1.456.172,715                                  |
| E-Anteile  | EUR        | 126,23   | 126,62           | 128,21           | 213.593,585                                    |
| HB NOK-Anteile   | NOK        | 1.150,96   | 1.137,48         | 1.140,72         | 1.000,000                                      |
| HB SEK-Anteile   | SEK        | 1.223,96   | 1.215,47         | 1.221,30         | 326.301,241                                    |
| HBI NOK-Anteile  | NOK        | 1.244,01   | 1.221,87         | 1.217,77         | 407.214,133                                    |
| X-Anteile  | EUR        | -  | 146,61           | 145,61           | -  |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse        |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|------------------|------------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - European Financial Debt Fund</b>    | <b>EUR</b> | 1.302.124.218,82   | 1.118.875.899,90 | 1.084.674.967,02 | 6.801.196,305                                  |
| AD-Anteile  | EUR        | 155,56   | 156,13           | -                | 1.029.385,303                                  |
| AI-Anteile  | EUR        | 160,61   | 161,75           | 166,98           | 34.319,278                                     |
| AP-Anteile  | EUR        | 144,90   | 146,85           | 152,55           | 275.235,194                                    |
| BC-Anteile  | EUR        | 190,43   | 184,59           | 180,96           | 10.678,749                                     |
| BD-Anteile  | EUR        | 190,26   | 183,71           | -                | 5,515  |
| BI-Anteile  | EUR        | 198,30   | 191,82           | 187,65           | 2.808.624,018                                  |
| BP-Anteile  | EUR        | 187,39   | 182,37           | 179,51           | 1.134.264,877                                  |
| E-Anteile   | EUR        | 174,73   | 171,33           | 169,91           | 577.253,812                                    |
| HBI CHF-Anteile                                   | CHF        | 205,04   | 198,78           | 195,07           | 86.197,000                                     |
| HBI SGD-Anteile                                   | SGD        | 384,89   | 369,07           | 358,52           | 12.169,926                                     |
| HBI USD-Anteile                                   | USD        | 305,55   | 293,20           | 283,00           | 497.941,735                                    |
| X-Anteile   | EUR        | 207,95   | 200,00           | 194,54           | 335.120,898                                    |
| <b>Nordea 1 - European High Yield Bond Fund</b>   | <b>EUR</b> | 4.367.611.249,52   | 5.136.098.333,15 | 5.068.913.301,11 | 177.676.952,983                                |
| AC-Anteile  | EUR        | 10,71  | 10,90            | 11,26            | 6.937.583,415                                  |
| AI-Anteile  | EUR        | 11,49  | 11,67            | 12,03            | 42.171.007,550                                 |
| AP-Anteile  | EUR        | 16,23  | 16,59            | 17,20            | 11.079.434,965                                 |
| BC-Anteile  | EUR        | 15,34  | 14,98            | 14,73            | 5.437.982,366                                  |
| BI-Anteile  | EUR        | 40,22  | 39,19            | 38,47            | 55.931.957,977                                 |
| BP-Anteile  | EUR        | 36,35  | 35,64            | 35,20            | 10.413.987,022                                 |
| E-Anteile   | EUR        | 32,26  | 31,87            | 31,71            | 1.248.084,062                                  |
| HA GBP-Anteile                                    | GBP        | 9,38   | 9,53             | 9,85             | 54.455,361                                     |
| HA USD-Anteile                                    | USD        | 15,87  | 16,12            | 16,43            | 1.076.706,204                                  |
| HAC GBP-Anteile                                   | GBP        | 8,27   | 8,36             | 8,61             | 128.161,136                                    |
| HAC USD-Anteile                                   | USD        | 15,64  | 15,83            | 16,06            | 499.740,451                                    |
| HAI GBP-Anteile                                   | GBP        | 9,59   | 9,67             | 9,93             | 7.851.442,872                                  |
| HAI USD-Anteile                                   | USD        | 16,26  | 16,43            | 16,63            | 1.653.248,333                                  |
| HB CHF-Anteile                                    | CHF        | 38,27  | 37,60            | 37,23            | 134.654,742                                    |
| HB GBP-Anteile                                    | GBP        | 31,56  | 30,75            | 30,30            | 144.282,311                                    |
| HB SEK-Anteile                                    | SEK        | 355,94   | 348,06           | 344,17           | 4.334.920,080                                  |
| HB USD-Anteile                                    | USD        | 22,42  | 21,79            | 21,21            | 3.746.748,038                                  |
| HBC CHF-Anteile                                   | CHF        | 16,15  | 15,81            | 15,59            | 207.032,778                                    |
| HBC GBP-Anteile                                   | GBP        | 12,73  | 12,35            | 12,12            | 443.834,641                                    |
| HBC SEK-Anteile                                   | SEK        | 161,98   | 157,74           | 155,37           | 19.553,674                                     |
| HBC USD-Anteile                                   | USD        | 61,00  | 59,09            | 57,30            | 606.292,664                                    |
| HBI CHF-Anteile                                   | CHF        | 20,85  | 20,37            | 20,05            | 1.956.297,573                                  |
| HBI NOK-Anteile                                   | NOK        | 134,19   | 129,71           | 127,46           | 1.436.944,431                                  |
| HBI SEK-Anteile                                   | SEK        | 135,53   | 131,77           | 129,45           | 7.533.086,843                                  |
| HBI USD-Anteile                                   | USD        | 24,19  | 23,39            | 22,63            | 11.149.176,187                                 |
| MP-Anteile  | EUR        | 30,77  | 31,47            | 32,34            | 9.337,068                                      |
| X-Anteile   | EUR        | 44,07  | 42,66            | 41,60            | 1.470.976,049                                  |
| Y-Anteile   | EUR        | 44,12  | 42,67            | -                | 24,190   |
| <b>Nordea 1 - European High Yield Credit Fund</b> | <b>EUR</b> | 278.864.337,71   | 428.134.590,08   | 411.567.230,07   | 2.888.805,486                                  |
| BI-Anteile  | EUR        | 97,39  | 94,87            | 91,28            | 837.014,318                                    |
| BP-Anteile  | EUR        | 95,42  | 93,51            | 90,52            | 1.997,239                                      |
| E-Anteile   | EUR        | 93,72  | 92,59            | 90,31            | 11,246   |
| HB SEK-Anteile                                    | SEK        | 781,60   | 764,12           | 740,37           | 285.439,306                                    |
| HE PLN-Anteile                                    | PLN        | 382,75   | 374,79           | 363,26           | 97,127   |
| HX NOK-Anteile                                    | NOK        | 1.042,43   | 1.001,91         | -                | 224.669,153                                    |
| HX SEK-Anteile                                    | SEK        | -  | 991,35           | 948,71           | -  |
| HY DKK-Anteile                                    | DKK        | 755,08   | 730,76           | -                | 308.794,609                                    |
| X-Anteile   | EUR        | 95,57  | 92,53            | 88,46            | 693.912,421                                    |
| Y-Anteile   | EUR        | 101,06   | 97,83            | 93,54            | 536.870,067                                    |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.



| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse               |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                |                | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|--|------------|--|----------------|----------------|--|
|  |            | 31.12.2021   | 31.12.2020     | 31.12.2019     | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund</b>    | <b>EUR</b> | 629.870.570,99   | 213.279.954,55 | 87.696.899,34  | 5.204.023,915                                  |
| AI-Anteile   | EUR        | 118,60   | 116,26         | -              | 8,918  |
| AP-Anteile   | EUR        | 106,87   | 109,43         | 112,50         | 37.278,253                                     |
| BC-Anteile   | EUR        | 118,06   | 115,56         | 112,94         | 61.192,130                                     |
| BF-Anteile   | EUR        | 117,71   | 115,01         | -              | 76.687,790                                     |
| BI-Anteile   | EUR        | 119,01   | 116,22         | 113,27         | 726.072,719                                    |
| BP-Anteile   | EUR        | 116,80   | 114,75         | 112,52         | 18.721,183                                     |
| E-Anteile  | EUR        | 114,27   | 113,11         | 111,75         | 584,227  |
| HAF SEK-Anteile  | SEK        | 1.143,07   | 1.116,90       | -              | 1.505,791                                      |
| HB NOK-Anteile   | NOK        | 1.166,83   | 1.138,11       | 1.116,65       | 3.268,863                                      |
| HB SEK-Anteile   | SEK        | 1.198,84   | 1.175,06       | 1.153,70       | 174.085,843                                    |
| HBC NOK-Anteile  | NOK        | -  | 1.145,96       | 1.121,09       | -  |
| HBC SEK-Anteile  | SEK        | -  | 1.183,78       | 1.158,19       | -  |
| HBF NOK-Anteile  | NOK        | 1.289,74   | 1.250,97       | -              | 20.986,365                                     |
| HBF SEK-Anteile  | SEK        | 1.213,20   | 1.182,38       | -              | 58.281,054                                     |
| HBI CHF-Anteile  | CHF        | 131,33   | 128,52         | 125,61         | 115.261,800                                    |
| HBI NOK-Anteile  | NOK        | 1.187,50   | 1.151,09       | 1.122,77       | 143,808  |
| HX NOK-Anteile   | NOK        | 1.243,21   | -              | -              | 615.718,336                                    |
| HX SEK-Anteile   | SEK        | 1.241,29   | 1.201,83       | -              | 1.152.054,839                                  |
| X-Anteile  | EUR        | 121,19   | 117,61         | 113,91         | 1.179.811,871                                  |
| Y-Anteile  | EUR        | 121,21   | 117,63         | 113,93         | 962.360,125                                    |
| <b>Nordea 1 - European Inflation Linked Bond Fund</b>    | <b>EUR</b> | 17.131.221,27  | 15.060.071,65  | -              | 160.874,525                                    |
| BC-Anteile   | EUR        | 106,11   | 100,33         | -              | 10,000   |
| BF-Anteile   | EUR        | 105,92   | -              | -              | 9,928  |
| BI-Anteile   | EUR        | 106,21   | 100,35         | -              | 10,000   |
| BP-Anteile   | EUR        | 105,71   | 100,30         | -              | 4.930,532                                      |
| E-Anteile  | EUR        | 104,86   | 100,23         | -              | 5.914,065                                      |
| Y-Anteile  | EUR        | 106,58   | 100,37         | -              | 150.000,000                                    |
| <b>Nordea 1 - European Small and Mid Cap Equity Fund</b> | <b>EUR</b> | 535.957.763,78   | 509.740.148,22 | 604.042.483,72 | 568.614,071                                    |
| AP-Anteile   | EUR        | 815,54   | 665,94         | 685,67         | 926,441  |
| BC-Anteile   | EUR        | 955,69   | 765,00         | 762,68         | 3.169,433                                      |
| BF-Anteile   | EUR        | 948,40   | 757,92         | -              | 1,385  |
| BI-Anteile   | EUR        | 1.015,21   | 810,94         | 806,82         | 7.482,702                                      |
| BP-Anteile   | EUR        | 942,24   | 756,87         | 757,22         | 553.715,579                                    |
| E-Anteile  | EUR        | 856,14   | 692,89         | 698,44         | 3.318,531                                      |
| <b>Nordea 1 - European Stars Equity Fund</b>             | <b>EUR</b> | 772.147.610,80   | 600.142.860,60 | 86.563.796,37  | 5.156.794,409                                  |
| AC-Anteile   | EUR        | 149,28   | 122,27         | -              | 5.130,950                                      |
| AF-Anteile   | EUR        | 149,94   | -              | -              | 6,628  |
| AP-Anteile   | EUR        | 147,98   | 122,00         | -              | 68.280,922                                     |
| BC-Anteile   | EUR        | 151,87   | 124,21         | 114,22         | 38.189,285                                     |
| BF-Anteile   | EUR        | 149,94   | 122,43         | -              | 155.415,030                                    |
| BI-Anteile   | EUR        | 153,49   | 125,27         | 114,92         | 1.213.664,824                                  |
| BP-Anteile   | EUR        | 148,24   | 122,03         | 112,92         | 2.808.144,718                                  |
| E-Anteile  | EUR        | 143,71   | 119,20         | 111,15         | 37.121,122                                     |
| HB USD-Anteile   | USD        | 178,58   | 145,74         | -              | 1.439,036                                      |
| HBI CHF-Anteile  | CHF        | 164,59   | 134,66         | -              | 1.170,628                                      |
| HBI USD-Anteile  | USD        | 185,08   | 149,75         | -              | 1.086,057                                      |
| X-Anteile  | EUR        | 149,54   | 120,96         | -              | 827.145,209                                    |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                       |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|--|------------|--|------------------|------------------|--|
|  |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Flexible Credit Fund (Anmerkung 1b)</b>            | <b>EUR</b> | 81.070.420,00  | 69.878.630,28    | -                | 596.139,918                                    |
| AF-Anteile   | EUR        | 133,69   | -                | -                | 7,509  |
| AZ-Anteile   | EUR        | 135,93   | -                | -                | 7,412  |
| BF-Anteile   | EUR        | 133,63   | 127,84           | -                | 76.297,736                                     |
| BI-Anteile   | EUR        | 134,24   | 128,34           | -                | 20.212,784                                     |
| BP-Anteile   | EUR        | 132,57   | 127,58           | -                | 16.263,481                                     |
| E-Anteile  | EUR        | 130,77   | 126,86           | -                | 8.097,981                                      |
| HB CHF-Anteile   | CHF        | 144,73   | -                | -                | 1.817,537                                      |
| HB NOK-Anteile   | NOK        | 1.560,50   | 1.491,35         | -                | 51,541   |
| HB SEK-Anteile   | SEK        | 1.458,32   | 1.400,78         | -                | 277,801  |
| HB USD-Anteile   | USD        | 161,93   | -                | -                | 11.576,467                                     |
| HBC GBP-Anteile  | GBP        | 113,69   | -                | -                | 39,879   |
| HBI USD-Anteile  | USD        | 149,25   | 141,52           | -                | 97,308   |
| HE USD-Anteile   | USD        | 159,81   | -                | -                | 1.384,770                                      |
| Y-Anteile  | EUR        | 136,46   | 129,35           | -                | 460.000,000                                    |
| Z-Anteile  | EUR        | 135,93   | -                | -                | 7,712  |
| <b>Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund</b>                     | <b>EUR</b> | 3.413.113.619,63   | 3.722.242.509,72 | 3.579.347.196,24 | 29.908.746,347                                 |
| AC-Anteile   | EUR        | 104,44   | 106,92           | 108,62           | 66.556,160                                     |
| AI-Anteile   | EUR        | 103,59   | 105,83           | 107,28           | 1.925.962,819                                  |
| AP-Anteile   | EUR        | 99,55  | 102,22           | 104,16           | 180.211,488                                    |
| BC-Anteile   | EUR        | 111,81   | 111,89           | 111,09           | 1.115.712,156                                  |
| BF-Anteile   | EUR        | 110,53   | 110,36           | -                | 571.613,463                                    |
| BI-Anteile   | EUR        | 114,67   | 114,52           | 113,47           | 14.886.091,146                                 |
| BP-Anteile   | EUR        | 109,74   | 110,15           | 109,69           | 2.465.150,318                                  |
| E-Anteile  | EUR        | 102,87   | 104,03           | 104,38           | 241.216,677                                    |
| HA USD-Anteile   | USD        | 128,14   | 130,76           | 131,39           | 3.713,574                                      |
| HB CHF-Anteile   | CHF        | 116,28   | 117,02           | 116,91           | 108.535,769                                    |
| HB NOK-Anteile   | NOK        | 1.082,37   | 1.077,39         | 1.065,94         | 19.233,364                                     |
| HB SEK-Anteile   | SEK        | 1.010,11   | 1.010,90         | 1.005,02         | 216.284,644                                    |
| HB USD-Anteile   | USD        | 140,45   | 139,91           | 137,58           | 91.485,459                                     |
| HBC GBP-Anteile  | GBP        | 82,30  | 81,82            | 80,77            | 61.677,595                                     |
| HBI CHF-Anteile  | CHF        | 115,76   | 115,90           | 115,21           | 866.490,027                                    |
| HBI NOK-Anteile  | NOK        | 1.137,88   | 1.126,60         | 1.109,05         | 1.361,656                                      |
| HBI SEK-Anteile  | SEK        | 1.078,08   | 1.073,58         | 1.061,86         | 837.962,185                                    |
| HBI USD-Anteile  | USD        | 148,98   | 147,66           | 144,47           | 815.053,126                                    |
| HY SEK-Anteile   | SEK        | 1.260,87   | 1.249,36         | 1.229,87         | 882.151,497                                    |
| Y-Anteile  | EUR        | 119,48   | 118,76           | 117,11           | 4.552.283,224                                  |
| <b>Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund (Anmerkung 1a)</b> | <b>EUR</b> | 72.950.962,52  | -                | -                | 718.004,076                                    |
| BC-Anteile   | EUR        | 101,10   | -                | -                | 10,000   |
| BI-Anteile   | EUR        | 101,31   | -                | -                | 314.778,571                                    |
| BP-Anteile   | EUR        | 100,74   | -                | -                | 10,000   |
| E-Anteile  | EUR        | 100,03   | -                | -                | 10,000   |
| Y-Anteile  | EUR        | 101,83   | -                | -                | 403.195,505                                    |
| <b>Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund</b>                    | <b>GBP</b> | 3.178.396.516,74   | 2.747.972.377,19 | 2.710.513.291,50 | 23.800.698,132                                 |
| AI-Anteile   | GBP        | 124,14   | 112,47           | 113,93           | 1.714.593,189                                  |
| BC-Anteile   | GBP        | 132,90   | 118,44           | 117,67           | 7.218,992                                      |
| BD-Anteile   | GBP        | 136,55   | 121,07           | 119,64           | 6.922.952,868                                  |
| BI-Anteile   | GBP        | 133,76   | 119,09           | 118,18           | 13.833.342,676                                 |
| BP-Anteile   | GBP        | 127,74   | 114,77           | 114,93           | 1.322.590,407                                  |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                                 |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|--|------------|--|------------------|------------------|--|
|  |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Global Bond Fund</b>   | <b>EUR</b> | 56.127.959,13  | 110.488.082,06   | 85.830.217,78    | 3.162.395,988                                  |
| AP-Anteile   | EUR        | 14,26  | 14,38            | 14,55            | 510.904,745                                    |
| BC-Anteile   | EUR        | 18,60  | 18,43            | -                | 405.665,027                                    |
| BI-Anteile   | EUR        | 19,45  | 19,23            | 19,04            | 357.162,945                                    |
| BP-Anteile   | EUR        | 18,55  | 18,42            | 18,31            | 1.593.899,099                                  |
| E-Anteile  | EUR        | 16,22  | 16,23            | 16,26            | 294.764,172                                    |
| <b>Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund</b>                      | <b>EUR</b> | 11.359.169.011,80  | 5.519.679.482,81 | 2.434.684.784,06 | 325.054.156,408                                |
| AC-Anteile   | EUR        | 33,48  | 25,09            | 21,09            | 991.086,587                                    |
| AI-Anteile   | EUR        | 36,23  | 27,09            | 22,72            | 3.472.533,431                                  |
| AP-Anteile   | EUR        | 32,31  | 24,37            | 20,62            | 16.383.681,737                                 |
| BC-Anteile   | EUR        | 34,24  | 25,47            | 21,12            | 10.551.482,402                                 |
| BF-Anteile   | EUR        | 33,65  | 25,00            | -                | 739.485,689                                    |
| BI-Anteile   | EUR        | 37,11  | 27,55            | 22,80            | 135.955.447,132                                |
| BP-Anteile   | EUR        | 33,31  | 24,94            | 20,82            | 136.651.499,132                                |
| E-Anteile  | EUR        | 30,17  | 22,76            | 19,14            | 12.409.143,091                                 |
| HB CHF-Anteile   | CHF        | 34,74  | 26,08            | 21,81            | 644.525,291                                    |
| HB USD-Anteile   | USD        | 46,05  | 34,22            | 28,23            | 2.823.693,776                                  |
| HBC CHF-Anteile  | CHF        | 37,24  | 27,78            | 23,08            | 167.731,131                                    |
| HBC GBP-Anteile  | GBP        | 31,01  | 22,96            | 19,10            | 112.251,556                                    |
| HBI CHF-Anteile  | CHF        | 43,92  | 32,69            | 27,11            | 1.377.486,972                                  |
| HBI NOK-Anteile  | NOK        | 375,20   | -                | -                | 159,408  |
| HBI USD-Anteile  | USD        | 47,73  | 35,16            | 28,76            | 865.519,136                                    |
| JI-Anteile   | EUR        | 37,05  | 27,55            | -                | 786.778,927                                    |
| X-Anteile  | EUR        | 37,39  | -                | -                | 1.121.651,010                                  |
| <b>Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund<br/>(Anmerkung 1a)</b> | <b>USD</b> | 213.441.491,61   | -                | -                | 2.043.218,941                                  |
| BC-Anteile   | USD        | 104,57   | -                | -                | 766,000  |
| BF-Anteile   | USD        | 104,64   | -                | -                | 111.603,936                                    |
| BI-Anteile   | USD        | 104,68   | -                | -                | 1.520.915,381                                  |
| BP-Anteile   | USD        | 104,20   | -                | -                | 348.085,774                                    |
| E-Anteile  | USD        | 103,86   | -                | -                | 2.648,229                                      |
| HY EUR-Anteile   | EUR        | 88,33  | -                | -                | 59.199,621                                     |
| <b>Nordea 1 - Global Disruption Fund</b>                                   | <b>USD</b> | 249.681.978,79   | 188.821.934,58   | 8.365.709,33     | 1.428.996,544                                  |
| AP-Anteile   | USD        | 172,91   | 163,37           | 117,93           | 59,211   |
| BC-Anteile   | USD        | 177,29   | 165,79           | 118,51           | 780,000  |
| BF-Anteile   | USD        | 175,90   | 164,22           | -                | 373.870,820                                    |
| BI-Anteile   | USD        | 178,24   | 166,33           | 118,66           | 55.221,655                                     |
| BP-Anteile   | USD        | 174,15   | 163,80           | 117,78           | 982.456,716                                    |
| E-Anteile  | USD        | 170,69   | 161,77           | 117,18           | 16.608,142                                     |
| Y-Anteile  | USD        | -  | 169,44           | 119,71           | -  |
| <b>Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund</b>                        | <b>EUR</b> | 27.549.683,85  | 27.354.313,88    | -                | 278.061,995                                    |
| BC-Anteile   | EUR        | 96,95  | 97,63            | -                | 10,000   |
| BI-Anteile   | EUR        | 97,48  | 97,83            | -                | 10,000   |
| BP-Anteile   | EUR        | 96,03  | 97,25            | -                | 51,995   |
| E-Anteile  | EUR        | 94,76  | 96,86            | -                | 10,000   |
| X-Anteile  | EUR        | 99,08  | 98,38            | -                | 277.980,000                                    |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse              |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                |                | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|----------------|----------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020     | 31.12.2019     | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Global Gender Diversity Fund</b>          | <b>USD</b> | 238.932.286,38   | 147.426.327,81 | 13.316.394,59  | 1.501.790,224                                  |
| AP-Anteile  | USD        | 147,79   | 118,80         | 110,68         | 14,634   |
| BC-Anteile  | USD        | 155,55   | 122,70         | 111,26         | 237,653  |
| BF-Anteile  | USD        | 154,27   | 121,54         | -              | 19.430,275                                     |
| BI-Anteile  | USD        | 156,46   | 123,17         | 111,45         | 304.745,142                                    |
| BP-Anteile  | USD        | 152,63   | 121,19         | 110,61         | 82.667,337                                     |
| E-Anteile   | USD        | 149,79   | 119,84         | 110,20         | 9.852,731                                      |
| X-Anteile   | USD        | 160,50   | 125,25         | -              | 1.084.842,452                                  |
| <b>Nordea 1 - Global Green Bond Fund (Anmerkung 1a)</b> | <b>EUR</b> | 62.002.395,41  | -              | -              | 626.175,232                                    |
| AQ-Anteile  | EUR        | 98,73  | -              | -              | 10,139   |
| BC-Anteile  | EUR        | 98,69  | -              | -              | 5.612,386                                      |
| BI-Anteile  | EUR        | 98,80  | -              | -              | 70.397,712                                     |
| BP-Anteile  | EUR        | 98,54  | -              | -              | 313,487  |
| BQ-Anteile  | EUR        | 98,62  | -              | -              | 2.063,478                                      |
| E-Anteile   | EUR        | 98,07  | -              | -              | 10,000   |
| HAQ SEK-Anteile   | SEK        | 1.005,39   | -              | -              | 49,812   |
| HBI NOK-Anteile   | NOK        | 1.009,58   | -              | -              | 114,933  |
| HBQ NOK-Anteile   | NOK        | 1.006,99   | -              | -              | 572,400  |
| HBO SEK-Anteile   | SEK        | 1.005,39   | -              | -              | 8.981,954                                      |
| X-Anteile   | EUR        | 99,06  | -              | -              | 538.048,931                                    |
| <b>Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund</b>           | <b>USD</b> | 692.859.075,61   | 707.317.059,13 | 654.050.587,90 | 38.367.916,474                                 |
| AP-Anteile  | USD        | 18,50  | 18,85          | -              | 87,464   |
| BC-Anteile  | USD        | 19,49  | 19,27          | 18,07          | 19.042,172                                     |
| BI-Anteile  | USD        | 19,76  | 19,50          | 18,24          | 235.421,125                                    |
| BP-Anteile  | USD        | 19,00  | 18,85          | 17,71          | 225.041,862                                    |
| E-Anteile   | USD        | 17,35  | 17,33          | 16,41          | 101.675,079                                    |
| HBC EUR-Anteile   | EUR        | -  | 16,71          | 15,93          | -  |
| HBC NOK-Anteile   | NOK        | 153,64   | 152,22         | 145,21         | 3.228.970,967                                  |
| HBI EUR-Anteile   | EUR        | 12,85  | 12,80          | 12,19          | 25.650,591                                     |
| HBI GBP-Anteile   | GBP        | 11,71  | 11,59          | 11,00          | 275.997,624                                    |
| HBI SEK-Anteile   | SEK        | 116,58   | 115,81         | 110,25         | 1.056.781,524                                  |
| HE PLN-Anteile  | PLN        | 55,15  | 55,18          | 52,80          | 247.028,267                                    |
| X-Anteile   | USD        | 18,32  | 17,94          | 16,65          | 32.952.219,799                                 |
| <b>Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund</b>     | <b>USD</b> | 476.629.133,17   | 373.067.766,65 | 101.701.769,48 | 33.879.235,523                                 |
| AI-Anteile  | USD        | 16,02  | 14,38          | 14,43          | 4.016.867,745                                  |
| AP-Anteile  | USD        | 13,43  | 12,16          | -              | 554.074,846                                    |
| BC-Anteile  | USD        | 13,95  | 12,33          | 12,11          | 566.799,606                                    |
| BF-Anteile  | USD        | 13,83  | 12,19          | -              | 10.955.950,864                                 |
| BI-Anteile  | USD        | 14,05  | 12,38          | 12,14          | 6.342.041,060                                  |
| BP-Anteile  | USD        | 13,66  | 12,16          | 12,03          | 9.182.683,519                                  |
| E-Anteile   | USD        | 13,42  | 12,03          | 11,99          | 1.555.160,832                                  |
| HAI EUR-Anteile   | EUR        | 13,49  | -              | -              | 251.925,000                                    |
| HBI CHF-Anteile   | CHF        | 12,63  | 11,26          | -              | 365.601,880                                    |
| MP-Anteile  | USD        | 12,94  | 11,86          | -              | 88.130,171                                     |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                          |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|----------------|------------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020     | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Global Opportunity Fund</b>                           | <b>EUR</b> | 490.972.692,53   | 341.230.866,52 | 271.026.294,52   | 1.522.188,932                                  |
| AI-Anteile  | EUR        | 327,09   | -              | -                | 14.866,592                                     |
| BC-Anteile  | EUR        | 311,57   | 234,03         | 214,12           | 1.049,693                                      |
| BF-Anteile  | EUR        | 310,19   | 232,77         | -                | 37.065,094                                     |
| BI-Anteile  | EUR        | 327,10   | 245,18         | 223,88           | 1.190.595,249                                  |
| BP-Anteile  | EUR        | 307,47   | 232,22         | 213,66           | 223.864,539                                    |
| E-Anteile   | EUR        | 289,60   | 220,38         | 204,29           | 51.732,925                                     |
| HBF NOK-Anteile   | NOK        | 3.412,04   | 2.550,31       | -                | 3.014,840                                      |
| <b>Nordea 1 - Global Portfolio Fund</b>                             | <b>EUR</b> | 473.207.845,74   | 238.502.275,80 | 174.428.368,03   | 11.866.221,315                                 |
| BC-Anteile  | EUR        | 39,95  | 31,22          | 28,50            | 102.909,928                                    |
| BI-Anteile  | EUR        | 40,61  | 31,67          | 28,85            | 5.862.299,496                                  |
| BP-Anteile  | EUR        | 39,70  | 31,07          | 28,41            | 5.509.136,585                                  |
| E-Anteile   | EUR        | 31,40  | 24,76          | 22,81            | 391.875,306                                    |
| <b>Nordea 1 - Global Real Estate Fund</b>                           | <b>USD</b> | 1.157.389.575,48   | 816.898.388,20 | 1.015.936.724,03 | 4.484.961,986                                  |
| AI-Anteile  | USD        | -  | 202,27         | 212,12           | -  |
| AP-Anteile  | USD        | 245,73   | 192,34         | -                | 4,757  |
| BC-Anteile  | USD        | 257,06   | 195,70         | 201,37           | 7.081,551                                      |
| BF-Anteile  | USD        | 253,69   | 192,83         | -                | 983.980,185                                    |
| BI-Anteile  | USD        | 271,92   | 206,58         | 212,13           | 1.234.583,935                                  |
| BP-Anteile  | USD        | 251,34   | 192,39         | 199,06           | 2.060.719,081                                  |
| E-Anteile   | USD        | 233,12   | 179,80         | 187,44           | 43.832,035                                     |
| JI-Anteile  | USD        | 271,91   | -              | -                | 154.760,442                                    |
| <b>Nordea 1 - Global Small Cap Fund</b>                             | <b>USD</b> | 271.320.312,16   | 250.977.881,64 | 300.563.005,99   | 1.586.170,675                                  |
| BC-Anteile  | USD        | 173,46   | 150,74         | 125,66           | 1.787,238                                      |
| BI-Anteile  | USD        | 180,40   | 156,44         | 130,15           | 184.360,828                                    |
| BP-Anteile  | USD        | 169,86   | 148,42         | 124,42           | 1.393.933,589                                  |
| E-Anteile   | USD        | 160,27   | 141,11         | 119,17           | 6.089,020                                      |
| <b>Nordea 1 - Global Social Empowerment Fund<br/>(Anmerkung 1c)</b> | <b>USD</b> | 355.375.885,20   | 143.112.665,65 | -                | 3.374.927,056                                  |
| AP-Anteile  | USD        | 103,49   | -              | -                | 11,806   |
| BC-Anteile  | USD        | 104,12   | 105,08         | -                | 6.313,488                                      |
| BF-Anteile  | USD        | 104,17   | -              | -                | 124.532,146                                    |
| BI-Anteile  | USD        | 104,37   | 105,11         | -                | 99.081,074                                     |
| BP-Anteile  | USD        | 103,46   | 105,04         | -                | 106.907,806                                    |
| E-Anteile   | USD        | 102,64   | 104,99         | -                | 3.331,740                                      |
| X-Anteile   | USD        | 105,45   | 105,19         | -                | 3.034.748,996                                  |
| Y-Anteile   | USD        | -  | 105,19         | -                | -  |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|------------------|------------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Global Stable Equity Fund</b>               | <b>EUR</b> | 2.572.820.118,36   | 2.503.804.676,43 | 2.920.144.131,88 | 84.974.909,092                                 |
| AC-Anteile  | EUR        | 27,21  | 21,53            | 23,88            | 46.202,000                                     |
| AI-Anteile  | EUR        | 29,39  | 23,20            | 25,71            | 581.162,164                                    |
| AP-Anteile  | EUR        | 26,34  | 20,96            | 23,37            | 416.678,631                                    |
| BC-Anteile  | EUR        | 29,63  | 22,98            | 24,87            | 1.266.462,564                                  |
| BF-Anteile  | EUR        | 28,80  | 22,31            | -                | 34,783   |
| BI-Anteile  | EUR        | 32,48  | 25,14            | 27,15            | 12.821.459,060                                 |
| BP-Anteile  | EUR        | 28,55  | 22,27            | 24,23            | 48.311.080,411                                 |
| E-Anteile   | EUR        | 25,14  | 19,76            | 21,66            | 1.566.564,273                                  |
| HB USD-Anteile  | USD        | 35,25  | 27,32            | 29,42            | 49.652,432                                     |
| HBI CHF-Anteile   | CHF        | -  | 25,88            | 28,03            | -  |
| HY SEK-Anteile  | SEK        | 321,50   | -                | -                | 159,490  |
| X-Anteile   | EUR        | 37,24  | 28,55            | 30,52            | 4.654.216,313                                  |
| Y-Anteile   | EUR        | 32,49  | 24,90            | 26,63            | 14.889.446,118                                 |
| Z-Anteile   | EUR        | 33,33  | 25,71            | 27,67            | 371.790,853                                    |
| <b>Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged</b> | <b>EUR</b> | 565.456.683,39   | 510.883.278,50   | 1.042.435.879,84 | 26.385.111,873                                 |
| AI-Anteile  | EUR        | 21,62  | 18,14            | 19,07            | 3.844.416,000                                  |
| AP-Anteile  | EUR        | 19,14  | 16,18            | 17,14            | 507.409,554                                    |
| BC-Anteile  | EUR        | 22,95  | 18,93            | 19,43            | 331.538,027                                    |
| BI-Anteile  | EUR        | 24,42  | 20,10            | 20,59            | 2.717.899,944                                  |
| BP-Anteile  | EUR        | 22,26  | 18,46            | 19,06            | 7.320.849,977                                  |
| E-Anteile   | EUR        | 20,88  | 17,44            | 18,14            | 1.225.561,645                                  |
| HB NOK-Anteile  | NOK        | 197,98   | 163,43           | 170,27           | 32.723,431                                     |
| HB SEK-Anteile  | SEK        | 197,45   | 163,55           | 169,68           | 7.501.519,561                                  |
| HBI NOK-Anteile   | NOK        | -  | 223,73           | -                | -  |
| HE PLN-Anteile  | PLN        | 99,93  | 82,89            | 86,03            | 1.482,417                                      |
| HX USD-Anteile  | USD        | 34,17  | 27,61            | 27,62            | 281.810,382                                    |
| HY SEK-Anteile  | SEK        | 220,82   | -                | -                | 2.619.900,935                                  |
| <b>Nordea 1 - Global Stars Equity Fund</b>                | <b>USD</b> | 2.180.478.473,61   | 1.689.752.657,02 | 844.242.400,98   | 9.631.169,273                                  |
| AF-Anteile  | USD        | 228,96   | 200,21           | -                | 8.877,573                                      |
| AP-Anteile  | USD        | 214,08   | 190,01           | 160,41           | 3.822,609                                      |
| BC-Anteile  | USD        | 224,14   | 196,18           | 162,14           | 71.274,202                                     |
| BF-Anteile  | USD        | 221,05   | 193,17           | -                | 382.921,958                                    |
| BI-Anteile  | USD        | 229,26   | 200,24           | 165,14           | 2.881.419,837                                  |
| BP-Anteile  | USD        | 218,93   | 192,88           | 160,44           | 3.146.229,177                                  |
| E-Anteile   | USD        | 209,88   | 186,29           | 156,13           | 100.554,076                                    |
| HA EUR-Anteile  | EUR        | 191,01   | 171,21           | 145,12           | 6.229,931                                      |
| X-Anteile   | USD        | 236,09   | 204,42           | 167,12           | 1.856.835,839                                  |
| Y-Anteile   | USD        | 227,43   | 196,92           | 160,99           | 1.173.004,071                                  |
| <b>Nordea 1 - Indian Equity Fund</b>                      | <b>USD</b> | 338.730.596,49   | 183.454.370,15   | 192.197.803,99   | 1.195.848,073                                  |
| BC-Anteile  | USD        | 255,53   | 189,01           | 171,08           | 5.148,839                                      |
| BI-Anteile  | USD        | 271,36   | 200,29           | 180,94           | 8.748,646                                      |
| BP-Anteile  | USD        | 248,59   | 185,16           | 168,80           | 86.393,303                                     |
| E-Anteile   | USD        | 231,31   | 173,59           | 159,45           | 13.863,239                                     |
| Y-Anteile   | USD        | 286,92   | 209,19           | 186,69           | 1.081.694,046                                  |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                              |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                   |                   | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|-------------------|-------------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020        | 31.12.2019        | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - International High Yield Bond Fund -<br/>USD Hedged</b>   | <b>USD</b> | 81.677.792,51  | 193.460.546,96    | 135.822.286,66    | 601.576,794                                    |
| BF-Anteile  | USD        | 149,82   | -                 | -                 | 4.147,439                                      |
| BI-Anteile  | USD        | 155,09   | 147,08            | 141,44            | 24.532,932                                     |
| BP-Anteile  | USD        | 149,25   | 142,26            | 137,36            | 59.505,510                                     |
| E-Anteile   | USD        | 139,51   | 133,98            | 130,35            | 4.113,931                                      |
| HB EUR-Anteile  | EUR        | 98,45  | 94,62             | 92,82             | 29.020,196                                     |
| HB NOK-Anteile  | NOK        | 797,56   | 761,12            | 746,58            | 3.583,834                                      |
| HB SEK-Anteile  | SEK        | 1.283,00   | 1.230,60          | 1.208,62          | 87.517,533                                     |
| HBI EUR-Anteile   | EUR        | 102,71   | 98,24             | 95,98             | 49.693,498                                     |
| HBI NOK-Anteile   | NOK        | 829,64   | 787,91            | 770,04            | 83.092,789                                     |
| HX EUR-Anteile  | EUR        | -  | 106,99            | 103,65            | -  |
| HY EUR-Anteile  | EUR        | 131,66   | 124,94            | -                 | 256.369,132                                    |
|   |            | <b>10.03.2021*</b>   | <b>31.12.2020</b> | <b>31.12.2019</b> | <b>10.03.2021*</b>                             |
| <b>Nordea 1 - Latin American Corporate Bond Fund<br/>(Anmerkung 1b)</b> | <b>USD</b> | 62.604.025,03  | 78.166.341,06     | 63.890.698,34     | 531.930,922                                    |
| BC-Anteile  | USD        | 117,39   | 120,53            | 112,02            | 3.405,067                                      |
| BI-Anteile  | USD        | 118,09   | 121,21            | 112,42            | 414.547,628                                    |
| BP-Anteile  | USD        | 116,26   | 119,44            | 111,35            | 113.633,886                                    |
| E-Anteile   | USD        | 113,79   | 117,06            | 109,95            | 344,341  |
| <b>Nordea 1 - Latin American Equity Fund</b>                            | <b>EUR</b> | 34.039.280,52  | 89.354.837,92     | 143.310.798,27    | 3.139.907,942                                  |
| AP-Anteile  | EUR        | 9,15   | 9,74              | 13,82             | 35.297,295                                     |
| BC-Anteile  | EUR        | 10,87  | -                 | -                 | 62.172,413                                     |
| BF-Anteile  | EUR        | 10,92  | 11,28             | -                 | 79.814,553                                     |
| BI-Anteile  | EUR        | 12,32  | 12,72             | 16,53             | 213.226,525                                    |
| BP-Anteile  | EUR        | 10,82  | 11,25             | 14,73             | 2.559.527,695                                  |
| E-Anteile   | EUR        | 9,70   | 10,17             | 13,40             | 152.581,805                                    |
| HE PLN-Anteile  | PLN        | 44,91  | 46,78             | 62,19             | 37.287,656                                     |
| <b>Nordea 1 - Long Duration US Bond Fund</b>                            | <b>USD</b> | 4.407.194,14   | 18.152.910,46     | 13.908.427,34     | 39.281,580                                     |
| BI-Anteile  | USD        | 113,32   | 120,48            | 103,92            | 15,000   |
| BP-Anteile  | USD        | 112,19   | 119,76            | 103,68            | 39.266,580                                     |
| HBI NOK-Anteile   | NOK        | -  | 1.022,39          | 881,33            | -  |
| HBI SEK-Anteile   | SEK        | -  | 1.092,31          | 951,47            | -  |
| X-Anteile   | USD        | -  | 121,28            | 104,14            | -  |

(\*) Bei zusammengelegten oder liquidierten Teilfonds entsprechen die ausgewiesenen Beträge der letzten Berechnung des Nettoinventarwerts, die vor dem Datum der Zusammenlegung oder Liquidation vorgenommen wurde. Nähere Angaben sind in Anmerkung 1b zu finden.

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|------------------|------------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund</b> | <b>EUR</b> | 7.646.058.350,72   | 3.858.339.168,16 | 2.654.397.721,32 | 74.126.520,983                                 |
| AC-Anteile  | EUR        | 100,95   | -                | -                | 72.687,090                                     |
| AI-Anteile  | EUR        | 100,88   | 102,30           | 101,70           | 933.950,175                                    |
| AP-Anteile  | EUR        | 100,88   | 102,67           | 101,85           | 77.412,593                                     |
| BC-Anteile  | EUR        | 102,20   | 102,96           | 101,52           | 3.312.691,637                                  |
| BF-Anteile  | EUR        | 101,94   | 102,53           | -                | 59.625,492                                     |
| BI-Anteile  | EUR        | 103,13   | 103,68           | 102,02           | 45.397.365,269                                 |
| BN-Anteile  | EUR        | 101,59   | -                | -                | 753.843,644                                    |
| BP-Anteile  | EUR        | 101,52   | 102,43           | 101,16           | 17.389.153,803                                 |
| E-Anteile   | EUR        | 98,51  | 100,14           | 99,63            | 30.779,621                                     |
| HAI GBP-Anteile   | GBP        | 90,73  | 91,45            | 90,27            | 1.271.755,749                                  |
| HB CHF-Anteile  | CHF        | 116,48   | 117,78           | 116,68           | 29.752,011                                     |
| HB NOK-Anteile  | NOK        | 1.001,60   | 1.003,27         | 982,09           | 4.197,938                                      |
| HB SEK-Anteile  | SEK        | 1.055,83   | 1.062,85         | 1.046,29         | 387.727,088                                    |
| HB USD-Anteile  | USD        | 125,40   | 125,52           | 122,33           | 36.214,788                                     |
| HBC CHF-Anteile   | CHF        | 117,23   | 118,37           | 117,07           | 14.588,267                                     |
| HBC NOK-Anteile   | NOK        | 1.059,60   | -                | -                | 47,114   |
| HBC SEK-Anteile   | SEK        | 1.027,33   | -                | -                | 48,385   |
| HBC USD-Anteile   | USD        | 126,14   | 126,09           | 122,74           | 30.101,232                                     |
| HBF SEK-Anteile   | SEK        | 1.063,73   | 1.067,56         | -                | 940.480,017                                    |
| HBI CHF-Anteile   | CHF        | 119,67   | 120,59           | 119,02           | 85.500,049                                     |
| HBI SEK-Anteile   | SEK        | 1.021,90   | 1.023,24         | 1.004,08         | 210.430,366                                    |
| HBI USD-Anteile   | USD        | 127,34   | 127,03           | 123,34           | 3.029.913,923                                  |
| Y-Anteile   | EUR        | 103,30   | -                | -                | 58.254,732                                     |
| <b>Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund</b>    | <b>USD</b> | 131.386.125,76   | 180.403.191,50   | 248.005.962,47   | 10.958.200,032                                 |
| AC-Anteile  | USD        | 9,05   | 9,30             | 9,40             | 1.747,660                                      |
| AP-Anteile  | USD        | 8,74   | 9,01             | 9,13             | 318.065,816                                    |
| BC-Anteile  | USD        | 10,59  | 10,34            | 9,91             | 52.000,724                                     |
| BI-Anteile  | USD        | 14,19  | 13,84            | 13,22            | 3.571.616,463                                  |
| BP-Anteile  | USD        | 13,53  | 13,26            | 12,73            | 2.363.559,670                                  |
| E-Anteile   | USD        | 12,23  | 12,07            | 11,68            | 480.910,443                                    |
| HA EUR-Anteile  | EUR        | 6,01   | 6,23             | 6,42             | 79.653,000                                     |
| HAC EUR-Anteile   | EUR        | 7,12   | 7,35             | 7,57             | 3.208,997                                      |
| HAI EUR-Anteile   | EUR        | 5,12   | 5,28             | 5,42             | 42.011,949                                     |
| HB EUR-Anteile  | EUR        | 8,47   | 8,36             | 8,14             | 930.617,136                                    |
| HB SEK-Anteile  | SEK        | 79,29  | 78,05            | 75,92            | 450.178,091                                    |
| HBF EUR-Anteile   | EUR        | 11,37  | 11,17            | -                | 24.630,911                                     |
| HBI EUR-Anteile   | EUR        | 9,06   | 8,90             | 8,63             | 1.132.036,858                                  |
| HBI NOK-Anteile   | NOK        | 81,10  | 79,10            | 76,34            | 1.507.962,314                                  |
| HX EUR-Anteile  | EUR        | -  | 9,85             | 9,48             | -  |
| <b>Nordea 1 - Nordic Equity Fund</b>                      | <b>EUR</b> | 251.273.299,93   | 206.501.925,04   | 220.562.102,23   | 2.113.121,677                                  |
| AC-Anteile  | EUR        | 23,24  | 18,41            | 16,16            | 20.577,825                                     |
| AP-Anteile  | EUR        | 107,70   | 85,83            | 75,68            | 77.781,751                                     |
| BC-Anteile  | EUR        | 26,11  | 20,41            | 17,27            | 321.781,671                                    |
| BI-Anteile  | EUR        | 149,22   | 116,43           | 98,28            | 378.495,556                                    |
| BP-Anteile  | EUR        | 136,07   | 106,98           | 90,99            | 1.235.963,253                                  |
| E-Anteile   | EUR        | 119,24   | 94,46            | 80,95            | 78.521,621                                     |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.



| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse            |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                |                | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|----------------|----------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020     | 31.12.2019     | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund</b>        | <b>EUR</b> | 178.907.917,59   | 149.826.771,43 | 132.293.871,05 | 3.681.231,686                                  |
| AP-Anteile  | EUR        | 37,83  | 29,70          | 23,51          | 182.013,399                                    |
| BC-Anteile  | EUR        | 50,79  | 39,40          | 30,44          | 108.454,913                                    |
| BI-Anteile  | EUR        | 53,30  | 41,26          | 31,81          | 655.889,505                                    |
| BP-Anteile  | EUR        | 48,89  | 38,07          | 29,53          | 2.320.994,654                                  |
| E-Anteile   | EUR        | 43,71  | 34,29          | 26,80          | 413.879,215                                    |
| <b>Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund</b>            | <b>EUR</b> | 78.426.790,39  | 86.981.795,48  | 92.129.185,04  | 315.978,859                                    |
| AI-Anteile  | EUR        | 238,90   | 188,62         | 160,95         | 4,792  |
| AP-Anteile  | EUR        | 228,70   | 181,90         | 160,74         | 787,152  |
| BC-Anteile  | EUR        | 252,29   | 197,75         | 168,23         | 3.232,976                                      |
| BI-Anteile  | EUR        | 262,03   | 204,95         | 173,99         | 21.056,395                                     |
| BP-Anteile  | EUR        | 248,34   | 195,42         | 166,92         | 269.974,014                                    |
| E-Anteile   | EUR        | 232,65   | 184,47         | 158,75         | 20.923,530                                     |
| <b>Nordea 1 - Nordic Stars Equity Fund</b>            | <b>EUR</b> | 251.245.138,43   | 141.578.521,51 | 46.490.946,98  | 1.132.930,955                                  |
| AF-Anteile  | EUR        | 216,06   | -              | -              | 4,554  |
| BC-Anteile  | EUR        | 218,66   | 179,29         | 149,74         | 10.733,067                                     |
| BF-Anteile  | EUR        | 216,06   | 176,87         | -              | 35.267,245                                     |
| BI-Anteile  | EUR        | 225,31   | 184,36         | 153,65         | 771.424,648                                    |
| BP-Anteile  | EUR        | 213,97   | 176,59         | 148,44         | 311.617,257                                    |
| E-Anteile   | EUR        | 202,62   | 168,48         | 142,69         | 3.884,184                                      |
| Y-Anteile   | EUR        | -  | 180,44         | 148,97         | -  |
| <b>Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund</b> | <b>USD</b> | 769.740.911,79   | 975.287.049,54 | 698.271.919,67 | 5.169.367,221                                  |
| BC-Anteile  | USD        | 151,34   | 143,26         | 140,87         | 453,000  |
| BI-Anteile  | USD        | 156,07   | 147,42         | 144,67         | 2.957.863,046                                  |
| BP-Anteile  | USD        | 149,96   | 142,38         | 140,33         | 19.902,961                                     |
| E-Anteile   | USD        | 140,14   | 134,05         | 133,14         | 6.165,725                                      |
| HB EUR-Anteile  | EUR        | 117,82   | 112,80         | 113,03         | 6.877,950                                      |
| HB SEK-Anteile  | SEK        | 839,68   | 801,77         | 804,19         | 197.933,147                                    |
| HBC EUR-Anteile                                       | EUR        | -  | 124,72         | 124,66         | -  |
| HBI EUR-Anteile                                       | EUR        | 118,10   | 112,50         | 112,03         | 15.580,646                                     |
| HX EUR-Anteile  | EUR        | 113,71   | 107,49         | 106,34         | 202.508,005                                    |
| HY DKK-Anteile  | DKK        | 964,65   | 911,79         | 902,79         | 1.631.701,754                                  |
| HY SEK-Anteile  | SEK        | 1.340,38   | -              | -              | 37,468   |
| MX-Anteile  | USD        | 130,44   | 129,37         | 133,85         | 130.343,519                                    |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                                     |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                |                | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|--|------------|--|----------------|----------------|--|
|  |            | 31.12.2021   | 31.12.2020     | 31.12.2019     | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund<br/>(Anmerkung 1a)</b> | <b>USD</b> | 774.237.443,99   | -              | -              | 6.604.206,165                                  |
| BC-Anteile   | USD        | 117,89   | -              | -              | 3.993,177                                      |
| BI-Anteile   | USD        | 118,59   | -              | -              | 15,000   |
| BP-Anteile   | USD        | 117,26   | -              | -              | 15,000   |
| HAF SEK-Anteile  | SEK        | 987,21   | -              | -              | 1.760,876                                      |
| HB EUR-Anteile   | EUR        | 98,36  | -              | -              | 3.075,315                                      |
| HB NOK-Anteile   | NOK        | 979,67   | -              | -              | 532,006  |
| HB SEK-Anteile   | SEK        | 1.034,73   | -              | -              | 50.690,250                                     |
| HBF EUR-Anteile  | EUR        | 98,28  | -              | -              | 113.765,861                                    |
| HBF NOK-Anteile  | NOK        | 1.090,03   | -              | -              | 26.498,236                                     |
| HBF SEK-Anteile  | SEK        | 1.014,18   | -              | -              | 79.731,070                                     |
| HBI EUR-Anteile  | EUR        | 99,47  | -              | -              | 688.835,981                                    |
| HBI NOK-Anteile  | NOK        | 990,78   | -              | -              | 49.214,476                                     |
| HBI SEK-Anteile  | SEK        | 1.046,40   | -              | -              | 34.339,420                                     |
| HX NOK-Anteile   | NOK        | 1.037,23   | -              | -              | 1.487.268,637                                  |
| HX SEK-Anteile   | SEK        | 1.056,00   | -              | -              | 1.366.027,900                                  |
| HY DKK-Anteile   | DKK        | 789,03   | -              | -              | 405.656,542                                    |
| HY EUR-Anteile   | EUR        | 103,24   | -              | -              | 1.385.824,118                                  |
| X-Anteile  | USD        | 121,51   | -              | -              | 906.962,300                                    |
| <b>Nordea 1 - North American Small Cap Fund</b>                                | <b>USD</b> | 50.879.214,06  | 43.667.610,62  | 68.038.478,94  | 248.639,651                                    |
| AP-Anteile   | USD        | 199,35   | 164,77         | 166,99         | 15,434   |
| BF-Anteile   | USD        | 206,06   | 167,60         | -              | 22.755,273                                     |
| BI-Anteile   | USD        | 219,37   | 178,36         | 176,67         | 44.326,492                                     |
| BP-Anteile   | USD        | 204,16   | 167,26         | 166,93         | 161.263,403                                    |
| E-Anteile  | USD        | 190,55   | 157,29         | 158,16         | 7.119,490                                      |
| HB EUR-Anteile   | EUR        | 146,46   | 121,24         | 122,95         | 13.159,559                                     |
| <b>Nordea 1 - North American Stars Equity Fund</b>                             | <b>USD</b> | 2.048.689.923,37   | 933.106.913,10 | 479.339.024,46 | 6.016.151,741                                  |
| AF-Anteile   | USD        | 345,85   | -              | -              | 3,256  |
| AI-Anteile   | USD        | 347,00   | 283,61         | 229,68         | 58.426,600                                     |
| AP-Anteile   | USD        | 294,44   | 242,73         | 198,28         | 13.460,740                                     |
| BC-Anteile   | USD        | 292,43   | 237,77         | 190,61         | 86.499,880                                     |
| BF-Anteile   | USD        | 345,81   | 280,78         | -              | 208.720,435                                    |
| BI-Anteile   | USD        | 369,58   | 299,86         | 239,88         | 1.416.626,607                                  |
| BP-Anteile   | USD        | 342,23   | 280,06         | 225,98         | 1.684.728,642                                  |
| E-Anteile  | USD        | 318,87   | 262,92         | 213,72         | 14.645,634                                     |
| HA EUR-Anteile   | EUR        | 202,15   | 168,25         | 139,63         | 309,016  |
| HB EUR-Anteile   | EUR        | 214,96   | 177,64         | 145,51         | 130.761,151                                    |
| HBC EUR-Anteile  | EUR        | 192,09   | 157,73         | 128,36         | 53.796,935                                     |
| HBI CHF-Anteile  | CHF        | 286,01   | 234,86         | 191,10         | 100,000  |
| X-Anteile  | USD        | 331,57   | 266,68         | -              | 2.348.072,845                                  |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswahrung des Teilfonds ausgewiesen, diese konnen jedoch in anderen Wahrungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswahrung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Wahrung ausgewiesen, die sich von der Basiswahrung des Teilfonds unterscheidet.

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse            |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|------------------|------------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - North American Value Fund</b>           | <b>USD</b> | 343.470.829,05   | 410.848.924,57   | 513.358.911,17   | 4.634.472,004                                  |
| AP-Anteile  | USD        | 71,27  | 63,39            | 66,01            | 14.306,599                                     |
| BC-Anteile  | USD        | 75,95  | 66,64            | 67,90            | 43.976,666                                     |
| BF-Anteile  | USD        | 74,03  | -                | -                | 904,417  |
| BI-Anteile  | USD        | 82,37  | 72,13            | 73,34            | 662.919,015                                    |
| BP-Anteile  | USD        | 73,57  | 64,91            | 66,50            | 3.724.440,807                                  |
| E-Anteile   | USD        | 64,34  | 57,20            | 59,05            | 27.789,610                                     |
| HA EUR-Anteile  | EUR        | 45,46  | 40,82            | 43,22            | 44.286,439                                     |
| HB EUR-Anteile  | EUR        | 47,87  | 42,65            | 44,39            | 109.673,451                                    |
| HB NOK-Anteile  | NOK        | -  | 353,09           | 373,77           | -  |
| HBI EUR-Anteile                                       | EUR        | 61,10  | 54,03            | 55,80            | 6.175,000                                      |
| <b>Nordea 1 - Norwegian Bond Fund</b>                 | <b>NOK</b> | 4.924.577.080,62   | 4.791.955.216,63 | 5.150.789.199,83 | 30.108.068,646                                 |
| AC-Anteile  | NOK        | 110,99   | 115,79           | 112,19           | 8.821.504,192                                  |
| AP-Anteile  | NOK        | 104,54   | 109,27           | 106,09           | 5.771.158,539                                  |
| BC-Anteile  | NOK        | 124,22   | 126,75           | 119,94           | 1.781.395,947                                  |
| BI-Anteile  | NOK        | 238,72   | 243,09           | 229,53           | 1.451.484,496                                  |
| BP-Anteile  | NOK        | 227,15   | 232,24           | 220,20           | 11.737.368,713                                 |
| E-Anteile   | NOK        | 198,61   | 204,59           | 195,44           | 545.156,759                                    |
| <b>Nordea 1 - Norwegian Equity Fund</b>               | <b>NOK</b> | 1.051.452.346,55   | 969.806.278,83   | 1.026.322.384,62 | 2.922.005,781                                  |
| AP-Anteile  | NOK        | 321,42   | 268,95           | 256,03           | 215.094,298                                    |
| BC-Anteile  | NOK        | 380,14   | 308,91           | 281,91           | 223.302,165                                    |
| BI-Anteile  | NOK        | 373,55   | 302,94           | 275,89           | 88.731,271                                     |
| BP-Anteile  | NOK        | 362,38   | 296,12           | 271,73           | 2.314.599,495                                  |
| E-Anteile   | NOK        | 317,95   | 261,76           | 242,01           | 80.278,552                                     |
| <b>Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund</b>      | <b>NOK</b> | 4.353.256.853,56   | 4.346.103.906,64 | 5.620.661.913,20 | 22.086.526,133                                 |
| AC-Anteile  | NOK        | 194,53   | 196,08           | 197,67           | 132.602,889                                    |
| AP-Anteile  | NOK        | 99,97  | 100,77           | 101,58           | 2.829.601,747                                  |
| BC-Anteile  | NOK        | 211,86   | 210,07           | 207,28           | 1.002.093,736                                  |
| BI-Anteile  | NOK        | 214,26   | 212,22           | 209,19           | 3.756.273,134                                  |
| BP-Anteile  | NOK        | 211,76   | 209,98           | 207,20           | 13.821.647,407                                 |
| E-Anteile   | NOK        | 184,94   | 184,75           | 183,68           | 544.307,220                                    |
| <b>Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund</b> | <b>USD</b> | 462.861.476,34   | 566.043.315,98   | 940.935.013,53   | 6.058.880,482                                  |
| AI-Anteile  | USD        | -  | 61,56            | 66,50            | -  |
| AX-Anteile  | USD        | 69,63  | 65,79            | 70,26            | 383.435,583                                    |
| BC-Anteile  | USD        | 74,87  | 69,57            | 72,25            | 14.729,520                                     |
| BF-Anteile  | USD        | 69,93  | 64,88            | -                | 69.527,489                                     |
| BI-Anteile  | USD        | 75,97  | 70,44            | 73,01            | 3.534.190,140                                  |
| BP-Anteile  | USD        | 69,14  | 64,69            | 67,66            | 465.839,187                                    |
| E-Anteile   | USD        | 64,02  | 60,35            | 63,60            | 59.668,068                                     |
| X-Anteile   | USD        | 82,68  | 75,81            | 77,69            | 958.516,984                                    |
| Y-Anteile   | USD        | 81,00  | 74,26            | 76,10            | 572.973,511                                    |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                  |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|--|------------|--|------------------|------------------|--|
|  |            | 31.12.2021   | 31.12.2020       | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Stable Return Fund</b>       | <b>EUR</b> | 7.686.424.714,02   | 7.650.691.014,59 | 9.955.570.527,76 | 401.950.598,403                                |
| AC-Anteile                                 | EUR        | 16,75  | 15,28            | 15,61            | 836.977,971                                    |
| AI-Anteile                                 | EUR        | 19,25  | 17,53            | 17,87            | 8.450.381,925                                  |
| AP-Anteile                                 | EUR        | 16,32  | 14,98            | 15,39            | 63.041.233,902                                 |
| BC-Anteile                                 | EUR        | 19,85  | 17,81            | 17,81            | 5.436.058,908                                  |
| BD-Anteile                                 | EUR        | 19,47  | 17,37            | 17,28            | 9.856.022,312                                  |
| BI-Anteile                                 | EUR        | 21,00  | 18,80            | 18,76            | 77.639.990,211                                 |
| BN-Anteile                                 | EUR        | 18,96  | -                | -                | 1.874.380,209                                  |
| BP-Anteile                                 | EUR        | 18,85  | 17,00            | 17,10            | 158.030.559,876                                |
| E-Anteile                                  | EUR        | 16,77  | 15,24            | 15,44            | 31.954.323,318                                 |
| HA NOK-Anteile                             | NOK        | 177,82   | 161,65           | 166,03           | 1.201.882,961                                  |
| HAC GBP-Anteile                            | GBP        | 15,46  | 14,02            | 14,25            | 23.305,120                                     |
| HAI GBP-Anteile                            | GBP        | 15,84  | 14,33            | 14,54            | 102.498,844                                    |
| HAI USD-Anteile                            | USD        | 23,93  | 21,66            | 21,76            | 277.760,232                                    |
| HAX CAD-Anteile                            | CAD        | 28,69  | -                | -                | 4.248.357,750                                  |
| HB CHF-Anteile                             | CHF        | 21,98  | 19,88            | 20,06            | 1.550.422,754                                  |
| HB NOK-Anteile                             | NOK        | 187,40   | 167,61           | 167,81           | 62.732,086                                     |
| HB SEK-Anteile                             | SEK        | 178,18   | 160,34           | 161,01           | 112.423,887                                    |
| HB SGD-Anteile                             | SGD        | 31,60  | 28,24            | 28,21            | 130.774,905                                    |
| HB USD-Anteile                             | USD        | 28,81  | 25,79            | 25,61            | 8.273.215,695                                  |
| HBC CHF-Anteile                            | CHF        | 20,43  | 18,38            | 18,44            | 317.308,758                                    |
| HBC GBP-Anteile                            | GBP        | 17,25  | 15,38            | 15,32            | 184.940,415                                    |
| HBC USD-Anteile                            | USD        | 24,10  | 21,46            | 21,19            | 836.864,818                                    |
| HBI CHF-Anteile                            | CHF        | 24,38  | 21,89            | 21,92            | 1.102.276,998                                  |
| HBI GBP-Anteile                            | GBP        | 17,23  | 15,33            | 15,24            | 124.596,131                                    |
| HBI NOK-Anteile                            | NOK        | 212,46   | 188,66           | 187,54           | 891.353,746                                    |
| HBI SEK-Anteile                            | SEK        | 191,61   | 171,17           | 170,73           | 8.414,262                                      |
| HBI SGD-Anteile                            | SGD        | 35,16  | 31,19            | 30,91            | 7.957,722                                      |
| HBI USD-Anteile                            | USD        | 32,18  | 28,59            | 28,17            | 4.043.817,495                                  |
| HE PLN-Anteile                             | PLN        | 82,00  | 73,91            | 74,24            | 144.484,929                                    |
| HM AUD-Anteile                             | AUD        | 26,80  | 24,75            | 25,52            | 262.982,071                                    |
| HM GBP-Anteile                             | GBP        | 13,69  | 12,65            | 13,06            | 208.534,152                                    |
| HM SGD-Anteile                             | SGD        | 24,64  | 22,69            | 23,36            | 333.226,303                                    |
| HM USD-Anteile                             | USD        | 18,50  | 17,07            | 17,46            | 1.649.622,431                                  |
| ME-Anteile                                 | EUR        | 14,81  | 13,87            | 14,48            | 1.138.075,753                                  |
| MP-Anteile                                 | EUR        | 15,47  | 14,37            | 14,90            | 1.714.024,625                                  |
| X-Anteile                                  | EUR        | 22,66  | 20,08            | 19,85            | 15.878.814,928                                 |
| <b>Nordea 1 - Swedish Bond Fund</b>        | <b>SEK</b> | 707.637.006,84   | 884.623.870,73   | 842.334.980,02   | 3.175.512,729                                  |
| AC-Anteile                                 | SEK        | 107,13   | 110,70           | 110,27           | 195.349,216                                    |
| AP-Anteile                                 | SEK        | 99,51  | 103,04           | 102,84           | 131.771,275                                    |
| BC-Anteile                                 | SEK        | 116,33   | 118,68           | 116,48           | 189.409,779                                    |
| BI-Anteile                                 | SEK        | 118,24   | 120,38           | 117,91           | 805.283,816                                    |
| BP-Anteile                                 | SEK        | 303,43   | 310,18           | 305,06           | 1.692.094,959                                  |
| E-Anteile                                  | SEK        | 265,49   | 273,42           | 270,93           | 161.603,684                                    |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                                |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                   |                   | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|-------------------|-------------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020        | 31.12.2019        | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - Swedish Short-Term Bond Fund</b>                            | <b>SEK</b> | 1.189.350.868,01   | 1.313.875.228,23  | 1.601.812.055,33  | 6.189.600,833                                  |
| AP-Anteile  | SEK        | 186,85   | 189,35            | 190,15            | 36.212,000                                     |
| BC-Anteile  | SEK        | 192,29   | 192,28            | 191,04            | 423.673,855                                    |
| BI-Anteile  | SEK        | 195,04   | 194,82            | 193,36            | 2.456.461,556                                  |
| BP-Anteile  | SEK        | 192,34   | 192,34            | 191,10            | 2.958.989,673                                  |
| E-Anteile   | SEK        | 168,29   | 169,55            | 169,72            | 314.263,749                                    |
|   |            | <b>25.06.2021*</b>   | <b>31.12.2020</b> | <b>31.12.2019</b> | <b>25.06.2021*</b>                             |
| <b>Nordea 1 - Unconstrained Bond Fund - USD Hedged<br/>(Anmerkung 1b)</b> | <b>USD</b> | 6.093.139,86   | 51.163.085,68     | 71.539.526,84     | 58.846,633                                     |
| BP-Anteile  | USD        | 119,75   | 118,81            | 113,65            | 21.559,610                                     |
| E-Anteile   | USD        | 113,12   | 112,64            | 108,56            | 3.542,971                                      |
| HB CHF-Anteile  | CHF        | 92,76  | 92,54             | 90,05             | 2.810,000                                      |
| HB EUR-Anteile  | EUR        | 78,64  | 78,32             | 75,99             | 295,681  |
| HB SEK-Anteile  | SEK        | -  | 697,72            | 675,90            | -  |
| HBI EUR-Anteile   | EUR        | 82,57  | 82,04             | 79,15             | 12.919,549                                     |
| HBI NOK-Anteile   | NOK        | 730,46   | 723,24            | 693,70            | 17.718,822                                     |
| X-Anteile   | USD        | -  | 131,08            | 123,69            | -  |
|   |            | <b>31.12.2021</b>  | <b>31.12.2020</b> | <b>31.12.2019</b> | <b>31.12.2021</b>                              |
| <b>Nordea 1 - US Corporate Bond Fund</b>                                  | <b>USD</b> | 2.244.612.682,05   | 3.476.537.278,45  | 3.012.893.076,61  | 161.860.836,715                                |
| AI-Anteile  | USD        | 13,96  | 14,56             | 13,70             | 854.588,809                                    |
| AP-Anteile  | USD        | 13,59  | 14,24             | 13,47             | 1.129.305,611                                  |
| BC-Anteile  | USD        | 13,94  | 14,09             | 12,80             | 416.187,814                                    |
| BF-Anteile  | USD        | 17,18  | 17,34             | -                 | 1.798.402,885                                  |
| BI-Anteile  | USD        | 18,16  | 18,32             | 16,61             | 28.158.559,998                                 |
| BP-Anteile  | USD        | 17,08  | 17,31             | 15,76             | 13.919.704,783                                 |
| E-Anteile   | USD        | 13,44  | 13,72             | 12,59             | 214.304,092                                    |
| HA EUR-Anteile  | EUR        | 11,44  | 12,07             | 11,63             | 49.390,580                                     |
| HAI EUR-Anteile   | EUR        | 7,96   | 8,36              | 8,01              | 6.807.066,000                                  |
| HAI GBP-Anteile   | GBP        | 7,34   | 7,64              | 7,30              | 17.701,751                                     |
| HB CHF-Anteile  | CHF        | 11,48  | 11,77             | 10,93             | 63.084,666                                     |
| HB EUR-Anteile  | EUR        | 11,29  | 11,54             | 10,68             | 3.280.009,692                                  |
| HB SEK-Anteile  | SEK        | 113,23   | 115,48            | 106,71            | 35.648.267,231                                 |
| HBC EUR-Anteile   | EUR        | 11,03  | 11,24             | 10,37             | 623.788,918                                    |
| HBF EUR-Anteile   | EUR        | 14,34  | 14,59             | -                 | 1.989.810,591                                  |
| HBI CHF-Anteile   | CHF        | 12,00  | 12,25             | 11,32             | 634.595,355                                    |
| HBI EUR-Anteile   | EUR        | 11,80  | 12,00             | 11,05             | 21.013.242,294                                 |
| HBI GBP-Anteile   | GBP        | 9,64   | 9,74              | 8,94              | 365.272,606                                    |
| HBI NOK-Anteile   | NOK        | 111,24   | 112,29            | 102,86            | 15.910.375,251                                 |
| HBI SEK-Anteile   | SEK        | 92,05  | 93,42             | 85,96             | 18.152.599,114                                 |
| HE PLN-Anteile  | PLN        | 48,70  | 49,76             | 46,01             | 40.037,255                                     |
| HX EUR-Anteile  | EUR        | 12,22  | 12,37             | 11,34             | 8.878.450,773                                  |
| X-Anteile   | USD        | 18,64  | 18,71             | 16,87             | 1.896.090,646                                  |

(\*) Bei zusammengelegten oder liquidierten Teilfonds entsprechen die ausgewiesenen Beträge der letzten Berechnung des Nettoinventarwerts, die vor dem Datum der Zusammenlegung oder Liquidation vorgenommen wurde. Nähere Angaben sind in Anmerkung 1b zu finden.

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Statistische Angaben zum 31.12.2021

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse                    |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                |                | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|----------------|----------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020     | 31.12.2019     | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund (Anmerkung 1a)</b> | <b>USD</b> | 1.493.337.016,09   | -              | -              | 12.723.797,583                                 |
| BC-Anteile  | USD        | 119,61   | -              | -              | 15,000   |
| BI-Anteile  | USD        | 120,04   | -              | -              | 15,000   |
| BP-Anteile  | USD        | 118,76   | -              | -              | 626,973  |
| HAF SEK-Anteile   | SEK        | 1.000,42   | -              | -              | 5.234,850                                      |
| HB EUR-Anteile  | EUR        | 98,78  | -              | -              | 8.411,015                                      |
| HB NOK-Anteile  | NOK        | 984,96   | -              | -              | 1.256,422                                      |
| HB SEK-Anteile  | SEK        | 1.032,56   | -              | -              | 108.324,993                                    |
| HBF EUR-Anteile   | EUR        | 99,53  | -              | -              | 245.582,794                                    |
| HBF NOK-Anteile   | NOK        | 1.093,65   | -              | -              | 22.676,266                                     |
| HBF SEK-Anteile   | SEK        | 1.026,85   | -              | -              | 224.257,049                                    |
| HBI EUR-Anteile   | EUR        | 100,20   | -              | -              | 2.355.475,265                                  |
| HBI NOK-Anteile   | NOK        | 997,48   | -              | -              | 2.651,829                                      |
| HBI SEK-Anteile   | SEK        | 1.045,68   | -              | -              | 55.199,866                                     |
| HX NOK-Anteile  | NOK        | 1.041,82   | -              | -              | 2.919.656,991                                  |
| HY EUR-Anteile  | EUR        | 103,54   | -              | -              | 4.683.681,002                                  |
| X-Anteile   | USD        | 121,93   | -              | -              | 2.090.732,268                                  |
| <b>Nordea 1 - US High Yield Bond Fund</b>                     | <b>USD</b> | 668.455.258,20   | 989.344.264,79 | 793.202.437,19 | 32.346.274,277                                 |
| AI-Anteile  | USD        | 12,16  | 12,39          | 12,46          | 27.518,348                                     |
| BC-Anteile  | USD        | 23,50  | 22,72          | 21,51          | 34.016,136                                     |
| BI-Anteile  | USD        | 24,52  | 23,65          | 22,35          | 298.033,376                                    |
| BP-Anteile  | USD        | 23,05  | 22,35          | 21,22          | 506.732,986                                    |
| E-Anteile   | USD        | 20,86  | 20,38          | 19,49          | 68.641,783                                     |
| HB EUR-Anteile  | EUR        | 14,97  | 14,65          | 14,12          | 101.964,106                                    |
| HB NOK-Anteile  | NOK        | 154,61   | 150,09         | 144,59         | 98.594,366                                     |
| HB SEK-Anteile  | SEK        | 155,95   | 152,18         | 146,81         | 7.917.037,096                                  |
| HBC EUR-Anteile   | EUR        | -  | 19,79          | 19,04          | -  |
| HBI EUR-Anteile   | EUR        | 13,86  | 13,49          | 12,96          | 263.320,942                                    |
| HBI SEK-Anteile   | SEK        | 137,40   | 133,30         | 128,02         | 4.824.618,750                                  |
| HE PLN-Anteile  | PLN        | 62,58  | 61,17          | 59,05          | 18.584,090                                     |
| HX EUR-Anteile  | EUR        | 20,85  | 20,14          | 19,18          | 6.175.473,893                                  |
| HX NOK-Anteile  | NOK        | 188,37   | 180,55         | 171,82         | 1.252.725,969                                  |
| HY DKK-Anteile  | DKK        | 151,07   | 145,91         | 139,04         | 8.267.546,792                                  |
| X-Anteile   | USD        | 26,68  | 25,55          | 23,95          | 2.491.465,644                                  |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

| Name des Teilfonds<br>und<br>Anteilsklasse  |            | Summe Nettovermögen<br>und<br>Nettoinventarwert pro Anteil |                |                  | Anzahl der in<br>Umlauf befindlichen<br>Aktien |
|---|------------|--|----------------|------------------|--|
|   |            | 31.12.2021   | 31.12.2020     | 31.12.2019       | 31.12.2021                                     |
| <b>Nordea 1 - US Total Return Bond Fund</b> | <b>USD</b> | 705.944.298,49   | 945.580.727,40 | 1.184.697.438,14 | 6.128.092,041                                  |
| AC-Anteile                                  | USD        | 94,36  | 98,83          | 100,83           | 65.326,351                                     |
| AD-Anteile                                  | USD        | 96,49  | 100,69         | 102,36           | 40.548,169                                     |
| AI-Anteile                                  | USD        | 93,87  | 98,11          | 99,89            | 150.751,800                                    |
| AP-Anteile                                  | USD        | 92,02  | 96,84          | 99,26            | 113.343,606                                    |
| BC-Anteile                                  | USD        | 123,70   | 123,38         | 120,11           | 286.239,588                                    |
| BD-Anteile                                  | USD        | 121,81   | 121,06         | 117,43           | 388.447,753                                    |
| BI-Anteile                                  | USD        | 125,42   | 124,84         | 121,27           | 2.843.358,880                                  |
| BP-Anteile                                  | USD        | 117,84   | 118,06         | 115,45           | 851.421,273                                    |
| E-Anteile                                   | USD        | 109,83   | 110,87         | 109,23           | 7.828,782                                      |
| HA EUR-Anteile                              | EUR        | 63,26  | 66,96          | 69,76            | 895,070  |
| HA GBP-Anteile                              | GBP        | 55,81  | 58,62          | 60,64            | 18.885,687                                     |
| HAD EUR-Anteile                             | EUR        | 75,31  | 79,07          | 81,69            | 139.443,966                                    |
| HAD GBP-Anteile                             | GBP        | 69,75  | 72,65          | 74,52            | 200.636,264                                    |
| HAI EUR-Anteile                             | EUR        | 64,07  | 67,36          | 69,69            | 144.720,851                                    |
| HAI GBP-Anteile                             | GBP        | 56,74  | 59,20          | 60,81            | 9.733,765                                      |
| HB EUR-Anteile                              | EUR        | 82,38  | 83,25          | 82,48            | 12.346,565                                     |
| HBC EUR-Anteile                             | EUR        | 87,61  | 88,13          | 86,92            | 69.405,620                                     |
| HBD EUR-Anteile                             | EUR        | 95,50  | 95,73          | 94,07            | 136.940,754                                    |
| HBI CHF-Anteile                             | CHF        | 110,67   | 111,40         | 110,03           | 8.690,935                                      |
| HBI EUR-Anteile                             | EUR        | 87,62  | 87,96          | 86,57            | 633.996,214                                    |
| HE EUR-Anteile                              | EUR        | 76,31  | 77,68          | 77,56            | 4.405,156                                      |
| MI-Anteile                                  | USD        | 103,42   | 107,80         | 108,26           | 724,992  |

Die nicht abgesicherten Klassen werden in diesem Abschluss lediglich in der Basiswährung des Teilfonds ausgewiesen, diese können jedoch in anderen Währungen existieren, obwohl keine Anteile dieser Anteilsklasse in der Basiswährung in Umlauf sind.

Die Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile wird pro Anteilsklasse zusammengerechnet.

Die abgesicherten Klassen, sofern vorhanden, sind in der entsprechenden Hedge-Währung ausgewiesen, die sich von der Basiswährung des Teilfonds unterscheidet.

# Total Expense Ratios

|   | Nordea 1 -<br>Alpha 7 MA Fund | Nordea 1 -<br>Alpha 10 MA Fund | Nordea 1 -<br>Alpha 15 MA Fund |
|---|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| <b>TER für das Jahr (Anmerkung 6) (*)</b> |                               |                                |                                |
| AC-Anteile                                | 1,36%                         | 1,38%                          | 1,58%                          |
| AF-Anteile                                |                               |                                |                                |
| AI-Anteile                                | 1,08%                         |                                | 1,38%                          |
| AP-Anteile                                | 1,92%                         | 1,98%                          | 2,28%                          |
| BC-Anteile                                | 1,33%                         | 1,38%                          | 1,59%                          |
| BF-Anteile                                | 1,09%                         | 1,21%                          | 1,41%                          |
| BI-Anteile                                | 1,08%                         | 1,18%                          | 1,38%                          |
| BP-Anteile                                | 1,88%                         | 1,98%                          | 2,28%                          |
| BQ-Anteile                                |                               |                                |                                |
| BV-Anteile                                |                               | 1,17%                          |                                |
| E-Anteile                                 | 2,63%                         | 2,73%                          | 3,03%                          |
| HAX GBP-Anteile                           |                               | 0,05%                          |                                |
| HB CHF-Anteile                            |                               | 1,99%                          | 2,28%                          |
| HB NOK-Anteile                            |                               | 1,98%                          | 2,28%                          |
| HB SEK-Anteile                            | 1,89%                         | 1,99%                          | 2,28%                          |
| HB USD-Anteile                            |                               | 1,98%                          | 2,30%                          |
| HBC CHF-Anteile                           |                               | 1,38%                          |                                |
| HBC GBP-Anteile                           |                               | 1,42%                          | 1,58%                          |
| HBC SEK-Anteile                           |                               | 1,38%                          | 1,58%                          |
| HBC USD-Anteile                           |                               | 1,38%                          | 1,59%                          |
| HBF NOK-Anteile                           |                               | 1,22%                          |                                |
| HBF SEK-Anteile                           |                               | 1,41%                          | 1,41%                          |
| HBI CHF-Anteile                           |                               | 1,17%                          |                                |
| HBI GBP-Anteile                           |                               | 1,17%                          | 1,38%                          |
| HBI JPY-Anteile                           |                               | 1,17%                          | 1,38%                          |
| HBI NOK-Anteile                           |                               |                                | 1,38%                          |
| HBI SEK-Anteile                           |                               | 1,18%                          | 1,38%                          |
| HBI SGD-Anteile                           |                               | 1,18%                          | 1,37%                          |
| HBI USD-Anteile                           | 1,08%                         | 1,17%                          | 1,37%                          |
| HE PLN-Anteile                            |                               | 2,72%                          |                                |
| HM SGD-Anteile                            |                               | 1,99%                          |                                |
| HX GBP-Anteile                            |                               | 0,05%                          |                                |
| HY EUR-Anteile                            |                               |                                |                                |
| HY NOK-Anteile                            | 0,05%                         |                                |                                |
| HY SEK-Anteile                            | 0,05%                         | 0,07%                          | 0,08%                          |
| X-Anteile                                 |                               | 0,05%                          | 0,05%                          |
| Y-Anteile                                 | 0,05%                         | 0,05%                          | 0,05%                          |
| Z-Anteile                                 |                               |                                |                                |

## Performancegebühr für das Jahr (\*\*)

(\*) Einschließlich Performancegebühr.

(\*\*) Im Berichtszeitraum wurde keine Performancegebühr erhoben, daher wurde keine Ratio berechnet.

Nur Anteilsklassen mit TER-Wert oder Performancegebühr.



| Nordea 1 -<br>Asia ex Japan<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Asian Stars<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Balance<br>Income Fund | Nordea 1 -<br>Chinese Bond Fund<br>(Anmerkung 1c) | Nordea 1 -<br>Chinese<br>Equity Fund |
|--|--|--------------------------------------|---|--------------------------------------|
|  | 0,84%                                    |                                      |   |                                      |
| 1,81%                                      |  | 1,42%                                | 1,28%   |                                      |
| 1,26%                                      | 1,17%                                    | 0,98%                                |   | 1,26%                                |
|  | 0,99%                                    | 0,85%                                |   |                                      |
| 1,07%                                      | 0,95%                                    | 0,78%                                | 0,75%   | 1,06%                                |
| 1,82%                                      | 1,81%                                    | 1,43%                                | 1,36%   | 1,82%                                |
|  | 1,59%                                    |                                      |   |                                      |
| 2,57%                                      | 2,60%                                    | 2,18%                                | 2,12%   | 2,56%                                |
|  |  | 1,44%                                | 1,33%   |                                      |
|  |  | 1,43%                                |   |                                      |
|  |  |                                      |   |                                      |
|  |  | 0,98%                                |   |                                      |
|  |  |                                      |   |                                      |
|  |  |                                      |   |                                      |
|  |  |                                      |   |                                      |
|  |  |                                      |   |                                      |
|  |  |                                      |   |                                      |
| 2,58%                                      |  |                                      |   |                                      |
|  |  |                                      | 0,05%   |                                      |
|  |  | 0,06%                                |   |                                      |
|  |  | 0,06%                                |   |                                      |
|  |  |                                      |   |                                      |
|  |  | 0,06%                                |   | 0,05%                                |
|  |  |                                      | 0,63%   |                                      |

# Total Expense Ratios

|   | Nordea 1 -<br>Conservative Fixed<br>Income Fund | Nordea 1 -<br>Danish Covered<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Markets<br>Bond Fund |
|---|---|---|---|
| <b>TER für das Jahr (Anmerkung 6) (*)</b> |   |   |   |
| AC-Anteile                                |   |   | 1,05%                                       |
| AF-Anteile                                |   |   |   |
| AI-Anteile                                |   | 0,43%                                     | 0,85%                                       |
| AP-Anteile                                |   | 0,84%                                     | 1,31%                                       |
| BC-Anteile                                |   | 0,64%                                     | 1,05%                                       |
| BF-Anteile                                |   | 0,48%                                     | 0,90%                                       |
| BI-Anteile                                | 0,18%   | 0,43%                                     | 0,85%                                       |
| BP-Anteile                                | 0,37%   | 0,84%                                     | 1,31%                                       |
| E-Anteile                                 |   | 1,59%                                     | 2,06%                                       |
| HA EUR-Anteile                            |   |   | 1,31%                                       |
| HAC EUR-Anteile                           |   | 0,63%                                     | 1,05%                                       |
| HAF SEK-Anteile                           |   |   |   |
| HAI EUR-Anteile                           |   | 0,43%                                     | 0,85%                                       |
| HAI GBP-Anteile                           |   |   |   |
| HB CHF-Anteile                            |   |   |   |
| HB EUR-Anteile                            |   |   | 1,31%                                       |
| HB NOK-Anteile                            |   |   | 1,31%                                       |
| HB SEK-Anteile                            |   |   | 1,31%                                       |
| HBC CHF-Anteile                           |   |   |   |
| HBC EUR-Anteile                           |   |   | 1,05%                                       |
| HBC GBP-Anteile                           |   |   |   |
| HBC NOK-Anteile                           |   |   | 1,06%                                       |
| HBD EUR-Anteile                           |   |   | 0,50%                                       |
| HBF EUR-Anteile                           |   |   |   |
| HBF NOK-Anteile                           |   |   |   |
| HBF SEK-Anteile                           | 0,20%   |   |   |
| HBI CHF-Anteile                           |   | 0,43%                                     | 0,84%                                       |
| HBI DKK-Anteile                           |   |   | 0,85%                                       |
| HBI EUR-Anteile                           |   | 0,43%                                     | 0,85%                                       |
| HBI NOK-Anteile                           | 0,16%   |   | 0,84%                                       |
| HBI SEK-Anteile                           | 0,16%   | 0,43%                                     | 0,85%                                       |
| HBI USD-Anteile                           |   | 0,43%                                     |   |
| HMX JPY-Anteile                           |   | 0,05%                                     |   |
| HX EUR-Anteile                            |   |   |   |
| HX NOK-Anteile                            |   |   |   |
| HY DKK-Anteile                            | 0,05%   |   |   |
| HY EUR-Anteile                            |   |   |   |
| JI-Anteile                                |   |   |   |
| X-Anteile                                 |   |   | 0,05%                                       |
| Y-Anteile                                 | 0,05%   |   |   |

## Performancegebühr für das Jahr (\*\*)

(\*) Einschließlich Performancegebühr.

(\*\*) Im Berichtszeitraum wurde keine Performancegebühr erhoben, daher wurde keine Ratio berechnet.

Nur Anteilsklassen mit TER-Wert oder Performancegebühr.

| Nordea 1 -<br>Emerging Market Bond<br>Opportunities Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Market<br>Corporate Bond Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Markets<br>Debt Total Return Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Stars<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Stars<br>Equity Fund |
|--|--|--|---|---|
|  |  |  |   | 1,16%                                       |
|  |  |  |   | 1,00%                                       |
|  |  |  | 0,70%                                     | 0,94%                                       |
|  | 1,51%  |  | 1,19%                                     | 1,80%                                       |
|  | 1,27%  |  | 0,88%                                     | 1,15%                                       |
|  | 1,05%  | 0,77%  | 0,63%                                     | 0,98%                                       |
| 1,02%  | 1,00%  | 0,90%  | 0,68%                                     | 0,95%                                       |
| 1,53%  | 1,52%  | 1,60%  | 1,19%                                     | 1,80%                                       |
| 2,28%  | 2,27%  | 2,35%  | 1,93%                                     | 2,55%                                       |
|  |  |  |   |   |
|  |  |  | 0,72%                                     |   |
|  |  |  | 0,67%                                     |   |
|  | 1,51%  |  |   | 1,79%                                       |
|  | 1,51%  |  | 1,19%                                     |   |
|  |  |  | 1,19%                                     |   |
| 1,52%  | 1,51%  |  | 1,19%                                     |   |
|  |  |  |   | 1,15%                                       |
|  | 1,20%  |  |   |   |
|  |  |  |   | 1,16%                                       |
|  |  |  |   |   |
|  | 1,09%  |  | 0,74%                                     |   |
|  |  |  | 0,72%                                     |   |
|  |  |  | 0,72%                                     |   |
|  | 1,01%  |  | 0,68%                                     | 0,95%                                       |
|  |  |  |   |   |
|  | 1,00%  |  | 0,68%                                     | 0,95%                                       |
| 1,02%  | 1,01%  |  | 0,68%                                     |   |
| 1,02%  |  |  | 0,68%                                     |   |
|  |  |  |   |   |
|  | 0,05%  |  |   |   |
|  |  | 0,07%  | 0,06%                                     |   |
|  |  |  | 0,06%                                     |   |
|  |  |  | 0,06%                                     |   |
|  |  |  |   | 0,95%                                       |
|  |  |  |   | 0,08%                                       |
|  |  |  |   | 0,07%                                       |

# Total Expense Ratios

|   | Nordea 1 -<br>Emerging Stars<br>Local Bond Fund | Nordea 1 -<br>Emerging Wealth<br>Equity Fund<br>(Anmerkung 1b) | Nordea 1 -<br>European Corporate<br>Bond Fund |
|---|---|--|---|
| <b>TER für das Jahr (Anmerkung 6) (*)</b> |   |  |   |
| AC-Anteile                                |   |  |   |
| AD-Anteile                                |   |  |   |
| AI-Anteile                                |   | 1,04%  |   |
| AP-Anteile                                |   |  |   |
| BC-Anteile                                |   | 1,26%  | 0,63%   |
| BD-Anteile                                |   |  |   |
| BF-Anteile                                | 0,77%   | 1,10%  | 0,50%   |
| BI-Anteile                                | 0,82%   | 1,04%  | 0,42%   |
| BP-Anteile                                | 1,33%   | 1,79%  | 0,83%   |
| E-Anteile                                 | 2,08%   | 2,55%  | 1,58%   |
| HAF SEK-Anteile                           |   |  |   |
| HB CHF-Anteile                            |   |  |   |
| HB EUR-Anteile                            | 1,32%   |  |   |
| HB NOK-Anteile                            |   |  | 0,83%   |
| HB SEK-Anteile                            | 1,33%   |  | 0,83%   |
| HB USD-Anteile                            |   |  |   |
| HBC CHF-Anteile                           |   |  |   |
| HBC NOK-Anteile                           |   |  | 0,64%   |
| HBF EUR-Anteile                           | 0,87%   |  |   |
| HBF NOK-Anteile                           |   |  |   |
| HBF SEK-Anteile                           |   |  |   |
| HBI CHF-Anteile                           |   |  |   |
| HBI GBP-Anteile                           |   |  |   |
| HBI NOK-Anteile                           |   |  |   |
| HBI SEK-Anteile                           |   |  | 0,43%   |
| HBI SGD-Anteile                           |   |  |   |
| HBI USD-Anteile                           |   |  |   |
| HE PLN-Anteile                            |   | 2,53%  | 1,57%   |
| HX NOK-Anteile                            |   |  |   |
| HY DKK-Anteile                            |   |  | 0,05%   |
| X-Anteile                                 |   | 0,06%  |   |
| Y-Anteile                                 | 0,10%   |  | 0,05%   |

## Performancegebühr für das Jahr (\*\*)

(\*) Einschließlich Performancegebühr.

(\*\*) Im Berichtszeitraum wurde keine Performancegebühr erhoben, daher wurde keine Ratio berechnet.

Nur Anteilsklassen mit TER-Wert oder Performancegebühr.

| Nordea 1 -<br>European Corporate<br>Stars Bond Fund | Nordea 1 -<br>European Covered<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>European Covered Bond<br>Opportunities Fund | Nordea 1 -<br>European Cross<br>Credit Fund | Nordea 1 -<br>European Financial<br>Debt Fund |
|---|---|---|---|---|
|   | 0,66%                                       | 0,67%   | 0,83%                                       |   |
|   |   |   |   | 0,58%   |
|   | 0,45%                                       | 0,39%   | 0,63%                                       | 0,63%   |
| 0,77%   | 0,85%                                       |   | 1,23%                                       | 1,23%   |
|   | 0,65%                                       | 0,67%   | 0,83%                                       | 0,84%   |
|   |   |   |   | 0,47%   |
| 0,48%   | 0,49%                                       | 0,45%   | 0,68%                                       |   |
| 0,43%   | 0,45%                                       | 0,46%   | 0,63%                                       | 0,63%   |
| 0,83%   | 0,85%                                       | 0,92%   | 1,23%                                       | 1,23%   |
| 1,59%   | 1,60%                                       | 1,67%   | 1,98%                                       | 1,98%   |
| 0,47%   |   |   |   |   |
|   |   | 0,91%   |   |   |
| 0,83%   | 0,85%                                       |   | 1,23%                                       |   |
| 0,83%   | 0,84%                                       |   | 1,23%                                       |   |
|   |   | 0,92%   |   |   |
|   | 0,66%                                       | 0,71%   |   |   |
|   |   |   |   |   |
| 0,47%   |   |   |   |   |
| 0,47%   | 0,46%                                       |   |   |   |
|   | 0,44%                                       | 0,46%   |   | 0,63%   |
|   | 0,45%                                       |   |   |   |
| 0,42%   | 0,45%                                       | 0,44%   | 0,63%                                       |   |
| 0,43%   | 0,45%                                       |   |   |   |
|   |   |   |   | 0,63%   |
|   | 0,45%                                       |   |   | 0,63%   |
|   | 1,60%                                       |   |   |   |
| 0,05%   |   |   |   |   |
|   |   |   |   |   |
| 0,05%   | 0,07%                                       | 0,08%   |   | 0,05%   |
| 0,05%   | 0,07%                                       | 0,09%   |   |   |

# Total Expense Ratios

|   | Nordea 1 -<br>European High Yield<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>European High Yield<br>Credit Fund | Nordea 1 -<br>European High Yield<br>Stars Bond Fund |
|---|--|--|--|
| <b>TER für das Jahr (Anmerkung 6) (*)</b> |  |  |  |
| AC-Anteile                                | 0,91%  |  |  |
| AF-Anteile                                |  |  |  |
| AI-Anteile                                | 0,71%  |  | 0,48%  |
| AP-Anteile                                | 1,31%  |  | 1,32%  |
| AZ-Anteile                                |  |  |  |
| BC-Anteile                                | 0,92%  |  | 0,89%  |
| BF-Anteile                                |  |  | 0,73%  |
| BI-Anteile                                | 0,71%  | 0,67%  | 0,68%  |
| BP-Anteile                                | 1,31%  | 1,28%  | 1,28%  |
| E-Anteile                                 | 2,06%  | 2,09%  | 2,04%  |
| HA GBP-Anteile                            | 1,31%  |  |  |
| HA USD-Anteile                            | 1,31%  |  |  |
| HAC GBP-Anteile                           | 0,92%  |  |  |
| HAC USD-Anteile                           | 0,92%  |  |  |
| HAF SEK-Anteile                           |  |  | 0,72%  |
| HAI GBP-Anteile                           | 0,71%  |  |  |
| HAI USD-Anteile                           | 0,71%  |  |  |
| HB CHF-Anteile                            | 1,32%  |  |  |
| HB GBP-Anteile                            | 1,31%  |  |  |
| HB NOK-Anteile                            |  |  | 1,28%  |
| HB SEK-Anteile                            | 1,31%  | 1,28%  | 1,28%  |
| HB USD-Anteile                            | 1,31%  |  |  |
| HBC CHF-Anteile                           | 0,91%  |  |  |
| HBC GBP-Anteile                           | 0,91%  |  |  |
| HBC SEK-Anteile                           | 0,92%  |  |  |
| HBC USD-Anteile                           | 0,92%  |  |  |
| HBF NOK-Anteile                           |  |  | 0,72%  |
| HBF SEK-Anteile                           |  |  | 0,72%  |
| HBI CHF-Anteile                           | 0,71%  |  | 0,68%  |
| HBI NOK-Anteile                           | 0,71%  |  | 0,67%  |
| HBI SEK-Anteile                           | 0,71%  |  |  |
| HBI USD-Anteile                           | 0,71%  |  |  |
| HE PLN-Anteile                            |  | 2,01%  |  |
| HE USD-Anteile                            |  |  |  |
| HX NOK-Anteile                            |  | 0,05%  | 0,06%  |
| HX SEK-Anteile                            |  |  | 0,05%  |
| HY DKK-Anteile                            |  | 0,05%  |  |
| HY SEK-Anteile                            |  |  |  |
| MP-Anteile                                | 1,31%  |  |  |
| X-Anteile                                 | 0,05%  | 0,05%  | 0,05%  |
| Y-Anteile                                 | 0,01%  | 0,05%  | 0,05%  |
| Z-Anteile                                 |  |  |  |

## Performancegebühr für das Jahr (\*\*)

(\*) Einschließlich Performancegebühr.

(\*\*) Im Berichtszeitraum wurde keine Performancegebühr erhoben, daher wurde keine Ratio berechnet.

Nur Anteilsklassen mit TER-Wert oder Performancegebühr.

| Nordea 1 -<br>European Inflation<br>Linked Bond Fund | Nordea 1 -<br>European Small and<br>Mid Cap Equity Fund | Nordea 1 -<br>European Stars<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Flexible Credit Fund<br>(Anmerkung 1b) | Nordea 1 -<br>Flexible Fixed<br>Income Fund |
|--|---|---|--|---|
|  |   | 1,13%                                       |  | 0,74%                                       |
|  |   | 0,89%                                       | 0,80%  |   |
|  |   |   |  | 0,54%                                       |
|  | 1,59%   | 1,79%                                       |  | 1,02%                                       |
|  |   |   | 0,50%  |   |
| 0,47%  | 1,23%   | 1,13%                                       |  | 0,73%                                       |
| 0,44%  | 1,07%   | 0,97%                                       | 0,92%  | 0,59%                                       |
| 0,40%  | 1,03%   | 0,92%                                       | 0,87%  | 0,53%                                       |
| 0,88%  | 1,58%   | 1,79%                                       | 1,58%  | 1,03%                                       |
| 1,59%  | 2,33%   | 2,53%                                       | 2,26%  | 1,78%                                       |
|  |   |   |  | 1,03%                                       |
|  |   |   |  |   |
|  |   |   |  |   |
|  |   |   | 1,53%  | 1,03%                                       |
|  |   |   | 1,56%  | 1,04%                                       |
|  |   |   | 1,53%  | 1,03%                                       |
|  |   | 1,79%                                       | 1,53%  | 1,03%                                       |
|  |   |   | 1,09%  | 0,73%                                       |
|  |   |   |  |   |
|  |   |   |  |   |
|  |   | 0,93%                                       |  | 0,53%                                       |
|  |   |   |  | 0,53%                                       |
|  |   | 0,93%                                       | 0,90%  | 0,53%                                       |
|  |   |   | 2,29%  |   |
|  |   |   |  |   |
|  |   |   |  | 0,05%                                       |
|  |   | 0,05%                                       |  |   |
| 0,05%  |   |   | 0,05%  | 0,05%                                       |
|  |   |   | 0,47%  |   |

# Total Expense Ratios

|   | Nordea 1 -<br>Flexible Fixed Income<br>Plus Fund<br>(Anmerkung 1a) | Nordea 1 -<br>GBP Diversified<br>Return Fund | Nordea 1 -<br>Global<br>Bond Fund |
|---|--|--|-----------------------------------|
| <b>TER für das Jahr (Anmerkung 6) (*)</b> |  |  |                                   |
| AC-Anteile                                |  |  |                                   |
| AI-Anteile                                |  | 0,88%  |                                   |
| AP-Anteile                                |  |  | 0,83%                             |
| BC-Anteile                                | 0,79%  | 0,98%  | 0,64%                             |
| BD-Anteile                                |  | 0,46%  |                                   |
| BF-Anteile                                |  |  |                                   |
| BI-Anteile                                | 0,62%  | 0,88%  | 0,43%                             |
| BP-Anteile                                | 1,16%  | 1,78%  | 0,83%                             |
| E-Anteile                                 | 1,90%  |  | 1,58%                             |
| HB CHF-Anteile                            |  |  |                                   |
| HB USD-Anteile                            |  |  |                                   |
| HBC CHF-Anteile                           |  |  |                                   |
| HBC GBP-Anteile                           |  |  |                                   |
| HBI CHF-Anteile                           |  |  |                                   |
| HBI NOK-Anteile                           |  |  |                                   |
| HBI USD-Anteile                           |  |  |                                   |
| HY EUR-Anteile                            |  |  |                                   |
| JI-Anteile                                |  |  |                                   |
| X-Anteile                                 |  |  |                                   |
| Y-Anteile                                 | 0,06%  |  |                                   |

## Performancegebühr für das Jahr (\*\*)

(\*) Einschließlich Performancegebühr.

(\*\*) Im Berichtszeitraum wurde keine Performancegebühr erhoben, daher wurde keine Ratio berechnet.

Nur Anteilsklassen mit TER-Wert oder Performancegebühr.



| Nordea 1 -<br>Global Climate and<br>Environment Fund | Nordea 1 -<br>Global Climate and<br>Social Impact Fund<br>(Anmerkung 1a) | Nordea 1 -<br>Global<br>Disruption Fund | Nordea 1 -<br>Global Equity<br>Market Neutral Fund | Nordea 1 -<br>Global Gender<br>Diversity Fund |
|--|--|---|--|---|
| 1,13%  |  |   |  |   |
| 0,92%  |  |   |  |   |
| 1,78%  |  | 1,75%                                   |  | 1,73%   |
| 1,13%  | 1,16%  | 1,20%                                   | 1,49%  | 1,16%   |
| 0,97%  | 1,05%  | 0,97%                                   |  | 0,98%   |
| 0,92%  | 0,95%  | 0,94%                                   | 1,15%  | 0,92%   |
| 1,78%  | 1,89%  | 1,78%                                   | 2,03%  | 1,78%   |
| 2,53%  | 2,61%  | 2,53%                                   | 2,98%  | 2,53%   |
| 1,78%  |  |   |  |   |
| 1,78%  |  |   |  |   |
| 1,13%  |  |   |  |   |
| 1,14%  |  |   |  |   |
| 0,92%  |  |   |  |   |
| 0,91%  |  |   |  |   |
| 0,92%  |  |   |  |   |
|  | 0,05%  |   |  |   |
| 0,92%  |  |   |  |   |
| 0,06%  |  |   | 0,06%  | 0,06%   |

# Total Expense Ratios

|   | Nordea 1 -<br>Global Green<br>Bond Fund<br>(Anmerkung 1a) | Nordea 1 -<br>Global High Yield<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>Global Listed<br>Infrastructure Fund |
|---|---|--|--|
| <b>TER für das Jahr (Anmerkung 6) (*)</b> |   |  |  |
| AI-Anteile                                |   |  | 1,01%  |
| AP-Anteile                                |   | 1,24%  | 1,91%  |
| AQ-Anteile                                | 0,52%   |  |  |
| BC-Anteile                                | 0,63%   | 1,01%  | 1,21%  |
| BF-Anteile                                |   |  | 1,04%  |
| BI-Anteile                                | 0,43%   | 0,80%  | 1,00%  |
| BP-Anteile                                | 0,88%   | 1,30%  | 1,92%  |
| BQ-Anteile                                | 0,66%   |  |  |
| E-Anteile                                 | 1,52%   | 2,06%  | 2,65%  |
| HAI EUR-Anteile                           |   |  | 1,02%  |
| HAQ SEK-Anteile                           | 0,58%   |  |  |
| HBC NOK-Anteile                           |   | 1,01%  |  |
| HBF NOK-Anteile                           |   |  |  |
| HBI CHF-Anteile                           |   |  | 1,00%  |
| HBI EUR-Anteile                           |   | 0,81%  |  |
| HBI GBP-Anteile                           |   | 0,81%  |  |
| HBI NOK-Anteile                           | 0,42%   |  |  |
| HBI SEK-Anteile                           |   | 0,80%  |  |
| HBQ NOK-Anteile                           | 0,62%   |  |  |
| HBQ SEK-Anteile                           | 0,62%   |  |  |
| HE PLN-Anteile                            |   | 2,06%  |  |
| JI-Anteile                                |   |  |  |
| MP-Anteile                                |   |  | 1,92%  |
| X-Anteile                                 | 0,05%   | 0,05%  |  |

## Performancegebühr für das Jahr (\*\*)

(\*) Einschließlich Performancegebühr.

(\*\*) Im Berichtszeitraum wurde keine Performancegebühr erhoben, daher wurde keine Ratio berechnet.

Nur Anteilsklassen mit TER-Wert oder Performancegebühr.

| Nordea 1 -<br>Global<br>Opportunity Fund | Nordea 1 -<br>Global<br>Portfolio Fund | Nordea 1 -<br>Global Real<br>Estate Fund | Nordea 1 -<br>Global Small<br>Cap Fund | Nordea 1 -<br>Global Social<br>Empowerment Fund<br>(Anmerkung 1c) |
|--|--|--|--|---|
| 1,11%                                    |  | 1,86%                                    |  | 1,80%   |
| 1,26%                                    | 0,88%                                  | 1,28%                                    | 1,27%                                  | 1,16%   |
| 1,09%                                    |  | 1,11%                                    |  | 1,03%   |
| 1,06%                                    | 0,67%                                  | 1,07%                                    | 1,06%                                  | 0,99%   |
| 1,81%                                    | 1,03%                                  | 1,83%                                    | 1,81%                                  | 1,78%   |
| 2,56%                                    | 1,78%                                  | 2,57%                                    | 2,56%                                  | 2,52%   |
|  |  |  |  |   |
|  |  |  |  |   |
| 1,09%                                    |  |  |  |   |
|  |  |  |  |   |
|  |  |  |  |   |
|  |  |  |  |   |
|  |  | 1,08%                                    |  |   |
|  |  |  |  | 0,06%   |

# Total Expense Ratios

|   | Nordea 1 -<br>Global Stable<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Global Stable<br>Equity Fund -<br>Euro Hedged | Nordea 1 -<br>Global Stars<br>Equity Fund |
|---|--|---|---|
| <b>TER für das Jahr (Anmerkung 6) (*)</b> |  |   |   |
| AC-Anteile                                | 1,23%                                      |   |   |
| AF-Anteile                                |  |   | 0,98%                                     |
| AI-Anteile                                | 1,02%                                      | 1,02%   |   |
| AP-Anteile                                | 1,78%                                      | 1,78%   | 1,78%                                     |
| BC-Anteile                                | 1,23%                                      | 1,23%   | 1,13%                                     |
| BF-Anteile                                | 1,05%                                      |   | 0,97%                                     |
| BI-Anteile                                | 1,02%                                      | 1,02%   | 0,93%                                     |
| BN-Anteile                                |  |   |   |
| BP-Anteile                                | 1,78%                                      | 1,78%   | 1,78%                                     |
| E-Anteile                                 | 2,53%                                      | 2,53%   | 2,53%                                     |
| HA EUR-Anteile                            |  |   | 1,78%                                     |
| HAI GBP-Anteile                           |  |   |   |
| HB CHF-Anteile                            |  |   |   |
| HB EUR-Anteile                            |  |   |   |
| HB NOK-Anteile                            |  | 1,78%   |   |
| HB SEK-Anteile                            |  | 1,78%   |   |
| HB USD-Anteile                            | 1,78%                                      |   |   |
| HBC CHF-Anteile                           |  |   |   |
| HBC NOK-Anteile                           |  |   |   |
| HBC SEK-Anteile                           |  |   |   |
| HBC USD-Anteile                           |  |   |   |
| HBF SEK-Anteile                           |  |   |   |
| HBI CHF-Anteile                           |  |   |   |
| HBI EUR-Anteile                           |  |   |   |
| HBI NOK-Anteile                           |  |   |   |
| HBI SEK-Anteile                           |  |   |   |
| HBI USD-Anteile                           |  |   |   |
| HE PLN-Anteile                            |  | 2,53%   |   |
| HX USD-Anteile                            |  | 0,05%   |   |
| HY EUR-Anteile                            |  |   |   |
| HY SEK-Anteile                            | 0,02%                                      | 0,07%   |   |
| X-Anteile                                 | 0,05%                                      |   | 0,05%                                     |
| Y-Anteile                                 | 0,05%                                      |   | 0,05%                                     |
| Z-Anteile                                 | 0,67%                                      |   |   |

## Performancegebühr für das Jahr (\*\*)

(\*) Einschließlich Performancegebühr.

(\*\*) Im Berichtszeitraum wurde keine Performancegebühr erhoben, daher wurde keine Ratio berechnet.

Nur Anteilsklassen mit TER-Wert oder Performancegebühr.

| Nordea 1 -<br>Indian<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>International High Yield<br>Bond Fund -<br>USD Hedged | Nordea 1 -<br>Latin American<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Long Duration<br>US Bond Fund | Nordea 1 -<br>Low Duration European<br>Covered Bond Fund |
|-------------------------------------|---|---|---|--|
|                                     |   |   |   | 0,59%  |
|                                     |   |   |   | 0,34%  |
|                                     |   | 1,96%                                       |   | 0,71%  |
| 1,52%                               |   | 1,45%                                       |   | 0,55%  |
|                                     | 0,86%   | 1,36%                                       |   | 0,42%  |
| 1,32%                               | 0,80%   | 1,24%                                       | 0,46%                                       | 0,34%  |
|                                     |   |   |   | 0,45%  |
| 2,24%                               | 1,31%   | 1,96%                                       | 0,86%                                       | 0,70%  |
| 2,97%                               | 2,06%   | 2,71%                                       |   | 1,44%  |
|                                     |   |   |   | 0,35%  |
|                                     |   |   |   | 0,70%  |
|                                     | 1,31%   |   |   | 0,70%  |
|                                     | 1,31%   |   |   | 0,70%  |
|                                     | 1,31%   |   |   | 0,70%  |
|                                     |   |   |   | 0,55%  |
|                                     |   |   |   | 0,53%  |
|                                     |   |   |   | 0,53%  |
|                                     |   |   |   | 0,55%  |
|                                     |   |   |   | 1,76%  |
|                                     |   |   |   | 0,34%  |
|                                     | 0,80%   |   |   |  |
|                                     | 0,80%   |   |   |  |
|                                     |   |   |   | 0,34%  |
|                                     |   |   |   | 0,34%  |
|                                     |   | 2,71%                                       |   |  |
|                                     | 0,05%   |   |   |  |
|                                     |   |   |   |  |
| 0,09%                               |   |   |   | 0,06%  |

# Total Expense Ratios

|   | Nordea 1 -<br>Low Duration US<br>High Yield Bond Fund | Nordea 1 -<br>Nordic<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Nordic Equity<br>Small Cap Fund |
|---|---|-------------------------------------|---|
| <b>TER für das Jahr (Anmerkung 6) (*)</b> |   |                                     |   |
| AC-Anteile                                | 1,01%   | 1,23%                               |   |
| AF-Anteile                                |   |                                     |   |
| AI-Anteile                                |   |                                     |   |
| AP-Anteile                                | 1,31%   | 1,78%                               | 1,78%   |
| BC-Anteile                                | 1,01%   | 1,23%                               | 1,38%   |
| BF-Anteile                                |   |                                     |   |
| BI-Anteile                                | 0,80%   | 1,03%                               | 1,18%   |
| BP-Anteile                                | 1,31%   | 1,78%                               | 1,78%   |
| E-Anteile                                 | 2,06%   | 2,52%                               | 2,53%   |
| HA EUR-Anteile                            | 1,31%   |                                     |   |
| HAC EUR-Anteile                           | 1,01%   |                                     |   |
| HAF SEK-Anteile                           |   |                                     |   |
| HAI EUR-Anteile                           | 0,80%   |                                     |   |
| HB EUR-Anteile                            | 1,31%   |                                     |   |
| HB NOK-Anteile                            |   |                                     |   |
| HB SEK-Anteile                            | 1,31%   |                                     |   |
| HBF EUR-Anteile                           | 0,86%   |                                     |   |
| HBF NOK-Anteile                           |   |                                     |   |
| HBF SEK-Anteile                           |   |                                     |   |
| HBI EUR-Anteile                           | 0,80%   |                                     |   |
| HBI NOK-Anteile                           | 0,80%   |                                     |   |
| HBI SEK-Anteile                           |   |                                     |   |
| HX EUR-Anteile                            |   |                                     |   |
| HX NOK-Anteile                            |   |                                     |   |
| HX SEK-Anteile                            |   |                                     |   |
| HY DKK-Anteile                            |   |                                     |   |
| HY EUR-Anteile                            |   |                                     |   |
| HY SEK-Anteile                            |   |                                     |   |
| MX-Anteile                                |   |                                     |   |
| X-Anteile                                 |   |                                     |   |

## Performancegebühr für das Jahr (\*\*)

(\*) Einschließlich Performancegebühr.

(\*\*) Im Berichtszeitraum wurde keine Performancegebühr erhoben, daher wurde keine Ratio berechnet.

Nur Anteilsklassen mit TER-Wert oder Performancegebühr.

| Nordea 1 -<br>Nordic Ideas<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>Nordic Stars<br>Equity Fund | Nordea 1 -<br>North American High<br>Yield Bond Fund | Nordea 1 -<br>North American High<br>Yield Stars Bond Fund<br>(Anmerkung 1a) | Nordea 1 -<br>North American<br>Small Cap Fund |
|---|---|--|--|--|
|   | 0,89%                                     |  |  |  |
| 1,17%                                     |   |  |  |  |
| 1,78%                                     |   |  |  | 1,78%  |
| 1,38%                                     | 1,13%                                     | 1,01%  | 1,03%  |  |
|   | 0,97%                                     |  |  | 1,08%  |
| 1,17%                                     | 0,92%                                     | 0,80%  | 0,85%  | 1,05%  |
| 1,78%                                     | 1,78%                                     | 1,31%  | 1,31%  | 1,81%  |
| 2,53%                                     | 2,53%                                     | 2,06%  |  | 2,54%  |
|   |   |  | 0,88%  |  |
|   |   | 1,31%  | 1,34%  | 1,81%  |
|   |   |  | 1,35%  |  |
|   |   | 1,30%  | 1,34%  |  |
|   |   |  | 0,86%  |  |
|   |   |  | 0,86%  |  |
|   |   | 0,81%  | 0,82%  |  |
|   |   |  | 0,82%  |  |
|   |   |  | 0,85%  |  |
|   |   | 0,05%  |  |  |
|   |   |  | 0,05%  |  |
|   |   |  | 0,05%  |  |
|   |   | 0,05%  | 0,05%  |  |
|   |   |  | 0,05%  |  |
|   |   | 0,02%  |  |  |
|   |   | 0,05%  |  |  |
|   |   |  | 0,05%  |  |

# Total Expense Ratios

|   | Nordea 1 -<br>North American<br>Stars Equity Fund | Nordea 1 -<br>North American<br>Value Fund | Nordea 1 -<br>Norwegian<br>Bond Fund |
|---|---|--|--------------------------------------|
| <b>TER für das Jahr (Anmerkung 6) (*)</b> |   |  |                                      |
| AC-Anteile                                |   |  | 0,69%                                |
| AF-Anteile                                | 0,83%   |  |                                      |
| AI-Anteile                                | 0,92%   |  |                                      |
| AP-Anteile                                | 1,78%   | 1,81%                                      | 0,83%                                |
| AX-Anteile                                |   |  |                                      |
| AZ-Anteile                                |   |  |                                      |
| BC-Anteile                                | 1,13%   | 1,25%                                      | 0,63%                                |
| BD-Anteile                                |   |  |                                      |
| BF-Anteile                                | 0,96%   | 1,08%                                      |                                      |
| BI-Anteile                                | 0,92%   | 1,05%                                      | 0,42%                                |
| BN-Anteile                                |   |  |                                      |
| BP-Anteile                                | 1,78%   | 1,81%                                      | 0,83%                                |
| E-Anteile                                 | 2,53%   | 2,56%                                      | 1,58%                                |
| HA EUR-Anteile                            | 1,78%   | 1,81%                                      |                                      |
| HA NOK-Anteile                            |   |  |                                      |
| HAC GBP-Anteile                           |   |  |                                      |
| HAI GBP-Anteile                           |   |  |                                      |
| HAI USD-Anteile                           |   |  |                                      |
| HAX CAD-Anteile                           |   |  |                                      |
| HB CHF-Anteile                            |   |  |                                      |
| HB EUR-Anteile                            | 1,78%   | 1,81%                                      |                                      |
| HB NOK-Anteile                            |   |  |                                      |
| HB SEK-Anteile                            |   |  |                                      |
| HB SGD-Anteile                            |   |  |                                      |
| HB USD-Anteile                            |   |  |                                      |
| HBC CHF-Anteile                           |   |  |                                      |
| HBC EUR-Anteile                           | 1,14%   |  |                                      |
| HBC GBP-Anteile                           |   |  |                                      |
| HBC USD-Anteile                           |   |  |                                      |
| HBI CHF-Anteile                           | 0,92%   |  |                                      |
| HBI EUR-Anteile                           |   | 1,06%                                      |                                      |
| HBI GBP-Anteile                           |   |  |                                      |
| HBI NOK-Anteile                           |   |  |                                      |
| HBI SEK-Anteile                           |   |  |                                      |
| HBI SGD-Anteile                           |   |  |                                      |
| HBI USD-Anteile                           |   |  |                                      |
| HE PLN-Anteile                            |   |  |                                      |
| HM AUD-Anteile                            |   |  |                                      |
| HM GBP-Anteile                            |   |  |                                      |
| HM SGD-Anteile                            |   |  |                                      |
| HM USD-Anteile                            |   |  |                                      |
| ME-Anteile                                |   |  |                                      |
| MP-Anteile                                |   |  |                                      |
| X-Anteile                                 | 0,05%   |  |                                      |
| Y-Anteile                                 |   |  |                                      |

## Performancegebühr für das Jahr (\*\*)

(\*) Einschließlich Performancegebühr.

(\*\*) Im Berichtszeitraum wurde keine Performancegebühr erhoben, daher wurde keine Ratio berechnet.

Nur Anteilsklassen mit TER-Wert oder Performancegebühr.



| Nordea 1 - Norwegian Equity Fund | Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund | Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund | Nordea 1 - Stable Return Fund | Nordea 1 - Swedish Bond Fund |
|----------------------------------|---|--|-------------------------------|------------------------------|
|                                  | 0,35%                                     |  | 1,23%                         | 0,63%                        |
|                                  |   |  | 1,03%                         |                              |
| 1,78%                            | 0,36%                                     |  | 1,78%                         | 0,83%                        |
|                                  |   | 0,07%  |                               |                              |
| 1,23%                            | 0,35%                                     | 1,41%  | 1,24%                         | 0,63%                        |
|                                  |   |  | 0,68%                         |                              |
|                                  |   | 1,21%  |                               |                              |
| 1,02%                            | 0,25%                                     | 1,20%  | 1,03%                         | 0,43%                        |
|                                  |   |  | 1,12%                         |                              |
| 1,78%                            | 0,36%                                     | 2,10%  | 1,78%                         | 0,83%                        |
| 2,53%                            | 1,11%                                     | 2,85%  | 2,53%                         | 1,58%                        |
|                                  |   |  |                               |                              |
|                                  |   |  | 1,78%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,23%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,03%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,03%                         |                              |
|                                  |   |  | 0,06%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,78%                         |                              |
|                                  |   |  |                               |                              |
|                                  |   |  | 1,79%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,78%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,78%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,78%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,23%                         |                              |
|                                  |   |  |                               |                              |
|                                  |   |  | 1,23%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,23%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,03%                         |                              |
|                                  |   |  |                               |                              |
|                                  |   |  | 1,03%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,01%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,03%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,03%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,03%                         |                              |
|                                  |   |  | 2,53%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,78%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,79%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,79%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,78%                         |                              |
|                                  |   |  | 2,54%                         |                              |
|                                  |   |  | 1,78%                         |                              |
|                                  |   | 0,07%  | 0,05%                         |                              |
|                                  |   | 0,07%  |                               |                              |

# Total Expense Ratios

|   | Nordea 1 -<br>Swedish Short-Term<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>US Corporate<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>US Corporate Stars<br>Bond Fund<br>(Anmerkung 1a) |
|---|---|---|---|
| <b>TER für das Jahr (Anmerkung 6) (*)</b> |   |   |   |
| AC-Anteile                                |   |   |   |
| AD-Anteile                                |   |   |   |
| AI-Anteile                                |   | 0,55%                                   |   |
| AP-Anteile                                | 0,36%   | 1,01%                                   |   |
| BC-Anteile                                | 0,36%   | 0,76%                                   | 0,71%   |
| BD-Anteile                                |   |   |   |
| BF-Anteile                                |   | 0,61%                                   |   |
| BI-Anteile                                | 0,25%   | 0,55%                                   | 0,60%   |
| BP-Anteile                                | 0,36%   | 1,01%                                   | 1,04%   |
| E-Anteile                                 | 1,11%   | 1,76%                                   |   |
| HA EUR-Anteile                            |   | 1,01%                                   |   |
| HA GBP-Anteile                            |   |   |   |
| HAD EUR-Anteile                           |   |   |   |
| HAD GBP-Anteile                           |   |   |   |
| HAF SEK-Anteile                           |   |   | 0,63%   |
| HAI EUR-Anteile                           |   | 0,55%                                   |   |
| HAI GBP-Anteile                           |   | 0,55%                                   |   |
| HB CHF-Anteile                            |   | 1,01%                                   |   |
| HB EUR-Anteile                            |   | 1,01%                                   | 1,03%   |
| HB NOK-Anteile                            |   |   | 1,04%   |
| HB SEK-Anteile                            |   | 1,01%                                   | 1,04%   |
| HBC EUR-Anteile                           |   | 0,76%                                   |   |
| HBD EUR-Anteile                           |   |   |   |
| HBF EUR-Anteile                           |   | 0,61%                                   | 0,61%   |
| HBF NOK-Anteile                           |   |   | 0,61%   |
| HBF SEK-Anteile                           |   |   | 0,61%   |
| HBI CHF-Anteile                           |   | 0,55%                                   |   |
| HBI EUR-Anteile                           |   | 0,55%                                   | 0,57%   |
| HBI GBP-Anteile                           |   | 0,55%                                   |   |
| HBI NOK-Anteile                           |   | 0,55%                                   | 0,55%   |
| HBI SEK-Anteile                           |   | 0,55%                                   | 0,85%   |
| HE EUR-Anteile                            |   |   |   |
| HE PLN-Anteile                            |   | 1,76%                                   |   |
| HX EUR-Anteile                            |   | 0,05%                                   |   |
| HX NOK-Anteile                            |   |   | 0,06%   |
| HY DKK-Anteile                            |   |   |   |
| HY EUR-Anteile                            |   |   | 0,06%   |
| MI-Anteile                                |   |   |   |
| X-Anteile                                 |   | 0,05%                                   | 0,06%   |

## Performancegebühr für das Jahr (\*\*)

(\*) Einschließlich Performancegebühr.

(\*\*) Im Berichtszeitraum wurde keine Performancegebühr erhoben, daher wurde keine Ratio berechnet.

Nur Anteilsklassen mit TER-Wert oder Performancegebühr.

| Nordea 1 -<br>US High Yield<br>Bond Fund | Nordea 1 -<br>US Total Return<br>Bond Fund |
|--|--|
|  | 1,03%                                      |
|  | 0,67%                                      |
| 0,80%                                    | 0,82%                                      |
|  | 1,48%                                      |
| 1,02%                                    | 1,03%                                      |
|  | 0,67%                                      |
| 0,80%                                    | 0,82%                                      |
| 1,31%                                    | 1,48%                                      |
| 2,06%                                    | 2,23%                                      |
|  | 1,46%                                      |
|  | 1,48%                                      |
|  | 0,67%                                      |
|  | 0,67%                                      |
|  | 0,82%                                      |
|  | 0,82%                                      |
| 1,31%                                    | 1,48%                                      |
| 1,31%                                    |  |
| 1,31%                                    |  |
|  | 1,03%                                      |
|  | 0,67%                                      |
|  |  |
|  | 0,82%                                      |
| 0,80%                                    | 0,82%                                      |
|  |  |
| 0,81%                                    |  |
|  | 2,23%                                      |
| 2,06%                                    |  |
| 0,05%                                    |  |
| 0,05%                                    |  |
| 0,05%                                    |  |
|  | 0,82%                                      |
| 0,05%                                    |  |

# Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal         | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|----------------------------|--------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                            |              |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                            |              |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                            |              |                            |                              |
| 6.000.000,00  | Bundesobligation 0.000000% 13-10-2023              | 6.075.720,00               | 1,14                         |                            |              |                            |                              |
| 6.000.000,00  | Bundesobligation 0.000000% 14-04-2023              | 6.052.920,00               | 1,14                         |                            |              |                            |                              |
| 10.000.500,00   | Bundesrepublik Deutschland B 1.5% 04-09-2022       | 10.154.323,69              | 1,91                         |                            |              |                            |                              |
| 5.000.500,00  | Bundesrepublik Deutschland B 1.5% 15-02-2023       | 5.126.612,61               | 0,96                         |                            |              |                            |                              |
| 12.000.500,00   | Bundesrepublik Deutschland B 1.75% 04-07-2022      | 12.152.594,34              | 2,29                         |                            |              |                            |                              |
| 11.000.500,00   | Bundesrepublik Deutschland B 2% 04-01-2022         | 11.000.500,00              | 2,07                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>50.562.670,64</b>       | <b>9,51</b>                  |                            |              |                            |                              |
| <b>GBP</b>  |  |                            |                              |                            |              |                            |                              |
| 2.550.000,00  | United Kingdom Gilt 0.125% 31-01-2023              | 3.022.543,63               | 0,57                         |                            |              |                            |                              |
| 5.000.000,00  | United Kingdom Gilt 0.125% 31-01-2024              | 5.883.811,46               | 1,11                         |                            |              |                            |                              |
| 2.550.000,00  | United Kingdom Gilt 0.75% 22-07-2023               | 3.046.588,47               | 0,57                         |                            |              |                            |                              |
| 2.850.000,00  | United Kingdom Gilt 1.75% 07-09-2022               | 3.426.427,60               | 0,64                         |                            |              |                            |                              |
| 7.000.000,00  | United Kingdom Gilt 4% 07-03-2022                  | 8.389.695,55               | 1,58                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>23.769.066,71</b>       | <b>4,47</b>                  |                            |              |                            |                              |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              |                            |              |                            |                              |
| 5.000.000,00  | United States Treasury Note/ 0.125% 30-09-2022     | 4.409.425,64               | 0,83                         |                            |              |                            |                              |
| 4.000.000,00  | United States Treasury Note/ 0.125% 31-07-2022     | 3.529.333,87               | 0,66                         |                            |              |                            |                              |
| 5.000.000,00  | United States Treasury Note/ 0.125% 31-08-2022     | 4.410.632,72               | 0,83                         |                            |              |                            |                              |
| 2.000.000,00  | United States Treasury Note/ 0.375% 31-03-2022     | 1.766.989,63               | 0,33                         |                            |              |                            |                              |
| 2.000.000,00  | United States Treasury Note/ 1.125% 28-02-2022     | 1.768.706,22               | 0,33                         |                            |              |                            |                              |
| 500.000,00  | United States Treasury Note/ 1.75% 15-05-2022      | 444.029,22                 | 0,08                         |                            |              |                            |                              |
| 4.000.000,00  | United States Treasury Note/ 2% 30-11-2022         | 3.583.824,45               | 0,67                         |                            |              |                            |                              |
| 4.000.000,00  | United States Treasury Note/ 2% 31-10-2022         | 3.580.099,77               | 0,67                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>23.493.041,52</b>       | <b>4,42</b>                  |                            |              |                            |                              |
| <b>Summe Anleihen</b>   |  |                            |                              | <b>97.824.778,87 18,41</b> |              |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |  |                            |                              |                            |              |                            |                              |
| <b>BRL</b>  |  |                            |                              |                            |              |                            |                              |
| 35.297,00   | Banco Bradesco                                     | 107.476,68                 | 0,02                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>107.476,68</b>          | <b>0,02</b>                  |                            |              |                            |                              |
| <b>CAD</b>  |  |                            |                              |                            |              |                            |                              |
| 32.600,00   | Bank of Nova Scotia/The                            | 2.032.593,61               | 0,38                         |                            |              |                            |                              |
| 23.600,00   | Royal Bank of Canada                               | 2.199.060,31               | 0,41                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>4.231.653,92</b>        | <b>0,80</b>                  |                            |              |                            |                              |
| <b>CHF</b>  |  |                            |                              |                            |              |                            |                              |
| 31.277,00   | Nestle   | 3.858.905,08               | 0,73                         |                            |              |                            |                              |
| 10.370,00   | Roche Holding                                      | 3.805.973,71               | 0,72                         |                            |              |                            |                              |
| 1.264,00  | Sonova Holding                                     | 437.845,26                 | 0,08                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>8.102.724,05</b>        | <b>1,52</b>                  |                            |              |                            |                              |
| <b>DKK</b>  |  |                            |                              |                            |              |                            |                              |
| 100.334,00  | Novo Nordisk B                                     | 9.916.959,43               | 1,87                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>9.916.959,43</b>        | <b>1,87</b>                  |                            |              |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                            |              |                            |                              |
| 6.245,00  | Allianz  | 1.296.774,25               | 0,24                         |                            |              |                            |                              |
| 24.713,00   | Deutsche Post                                      | 1.397.273,02               | 0,26                         |                            |              |                            |                              |
| 36.200,00   | Iberdrola  | 376.842,00                 | 0,07                         |                            |              |                            |                              |
| 6.551,00  | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in M | 1.706.535,50               | 0,32                         |                            |              |                            |                              |
| 5.292,00  | Prosus   | 389.120,76                 | 0,07                         |                            |              |                            |                              |
| 22.416,00   | Sanofi   | 1.985.609,28               | 0,37                         |                            |              |                            |                              |
| 12.144,00   | Siemens  | 1.854.145,92               | 0,35                         |                            |              |                            |                              |
| 26.743,00   | Unilever   | 1.258.391,87               | 0,24                         |                            |              |                            |                              |
| 32.326,00   | Vinci  | 3.003.408,66               | 0,57                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>13.268.101,26</b>       | <b>2,50</b>                  |                            |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>GBP</b>                 |              |                            |                              |
| 103.618,00  | National Grid                                      | 1.307.223,74               | 0,25                         |                            |              |                            |                              |
| 12.215,00   | Reckitt Benckiser Group                            | 922.168,99                 | 0,17                         |                            |              |                            |                              |
| 130.804,00  | Rightmove  | 1.237.881,18               | 0,23                         |                            |              |                            |                              |
| 67.706,00   | Unilever   | 3.180.230,03               | 0,60                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>6.647.503,94</b>        | <b>1,25</b>                  |                            |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>HKD</b>                 |              |                            |                              |
| 141.000,00  | China Communications Construction                  | 67.676,70                  | 0,01                         |                            |              |                            |                              |
| 604.000,00  | China Construction Bank                            | 369.219,74                 | 0,07                         |                            |              |                            |                              |
| 191.723,00  | China Everbright Environment Group                 | 135.863,49                 | 0,03                         |                            |              |                            |                              |
| 73.000,00   | China Gas Holdings                                 | 133.872,72                 | 0,03                         |                            |              |                            |                              |
| 41.000,00   | China Longyuan Power Group                         | 84.471,35                  | 0,02                         |                            |              |                            |                              |
| 75.500,00   | China Mobile                                       | 399.988,05                 | 0,08                         |                            |              |                            |                              |
| 152.500,00  | China Overseas Land & Investment                   | 318.680,69                 | 0,06                         |                            |              |                            |                              |
| 73.500,00   | China Railway Construction                         | 42.433,78                  | 0,01                         |                            |              |                            |                              |
| 56.000,00   | China Resources Land                               | 207.929,49                 | 0,04                         |                            |              |                            |                              |
| 546.000,00  | China Telecom                                      | 160.701,60                 | 0,03                         |                            |              |                            |                              |
| 140.000,00  | CRRC   | 53.091,75                  | 0,01                         |                            |              |                            |                              |
| 100,00  | ENN Energy Holdings                                | 1.661,81                   | 0,00                         |                            |              |                            |                              |
| 31.500,00   | Hengan International Group                         | 143.169,44                 | 0,03                         |                            |              |                            |                              |
| 721.000,00  | Industrial & Commercial Bank of China              | 359.122,12                 | 0,07                         |                            |              |                            |                              |
| 82.500,00   | Ping An Insurance Group Co of China                | 524.394,25                 | 0,10                         |                            |              |                            |                              |
| 150.800,00  | Sinopharm Group                                    | 289.521,89                 | 0,05                         |                            |              |                            |                              |
| 95.000,00   | Techtronic Industries                              | 1.669.050,73               | 0,31                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>4.960.849,60</b>        | <b>0,93</b>                  |                            |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>IDR</b>                 |              |                            |                              |
| 2.291.900,00  | Telkom Indonesia Persero                           | 573.612,15                 | 0,11                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>573.612,15</b>          | <b>0,11</b>                  |                            |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>INR</b>                 |              |                            |                              |
| 10.049,00   | Axis Bank  | 80.986,35                  | 0,02                         |                            |              |                            |                              |
| 34.940,00   | HCL Technologies                                   | 547.403,72                 | 0,10                         |                            |              |                            |                              |
| 43.615,00   | Infosys  | 977.884,31                 | 0,18                         |                            |              |                            |                              |
| 144.348,00  | Power Grid Corp of India                           | 350.427,99                 | 0,07                         |                            |              |                            |                              |
| 41.883,00   | UPL  | 371.641,02                 | 0,07                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>2.328.343,39</b>        | <b>0,44</b>                  |                            |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>JPY</b>                 |              |                            |                              |
| 18.100,00   | Hoya   | 2.374.791,11               | 0,45                         |                            |              |                            |                              |
| 70.100,00   | KDDI   | 1.807.226,38               | 0,34                         |                            |              |                            |                              |
| 82.400,00   | Nippon Telegraph & Telephone                       | 1.990.373,57               | 0,37                         |                            |              |                            |                              |
| 16.900,00   | Seven & i Holdings                                 | 655.225,21                 | 0,12                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>6.827.616,27</b>        | <b>1,28</b>                  |                            |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>KRW</b>                 |              |                            |                              |
| 3.751,00  | BNK Financial Group                                | 23.401,29                  | 0,00                         |                            |              |                            |                              |
| 2.027,00  | Hyundai Glovis                                     | 252.916,09                 | 0,05                         |                            |              |                            |                              |
| 1.259,00  | Hyundai Mobis                                      | 237.972,59                 | 0,04                         |                            |              |                            |                              |
| 1.228,00  | LG   | 73.783,68                  | 0,01                         |                            |              |                            |                              |
| 595,00  | LX Holdings  | 4.419,07                   | 0,00                         |                            |              |                            |                              |
| 13.811,00   | Samsung Electronics                                | 803.156,75                 | 0,15                         |                            |              |                            |                              |
| 2.294,00  | Samsung Fire & Marine Insurance                    | 344.158,27                 | 0,06                         |                            |              |                            |                              |
| 9.028,00  | SK Square  | 445.218,35                 | 0,08                         |                            |              |                            |                              |
| 8.897,00  | SK Telecom   | 382.591,73                 | 0,07                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>2.567.617,82</b>        | <b>0,48</b>                  |                            |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>MXN</b>                 |              |                            |                              |
| 13.800,00   | Grupo Financiero Banorte                           | 79.765,20                  | 0,02                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>79.765,20</b>           | <b>0,02</b>                  |                            |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>PHP</b>                 |              |                            |                              |
| 1.085,00  | PLDT   | 34.039,71                  | 0,01                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>34.039,71</b>           | <b>0,01</b>                  |                            |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>THB</b>                 |              |                            |                              |
| 23.200,00   | Advanced Info Service                              | 141.029,04                 | 0,03                         |                            |              |                            |                              |
| 38.000,00   | Bangkok Bank                                       | 122.026,06                 | 0,02                         |                            |              |                            |                              |
| 111.200,00  | Thai Union Group                                   | 57.310,23                  | 0,01                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>320.365,33</b>          | <b>0,06</b>                  |                            |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>TRY</b>                 |              |                            |                              |
| 252.077,00  | Akbank TAS   | 118.599,00                 | 0,02                         |                            |              |                            |                              |
| 11.196,00   | BIM Birlesik Magazalar                             | 45.182,12                  | 0,01                         |                            |              |                            |                              |
| 145.274,00  | Turkcell Iletisim Hizmetleri                       | 170.921,55                 | 0,03                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>334.702,67</b>          | <b>0,06</b>                  |                            |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>TWD</b>                 |              |                            |                              |
| 43.000,00   | Taiwan Semiconductor Manufacturing                 | 843.889,83                 | 0,16                         |                            |              |                            |                              |
|   |  | <b>843.889,83</b>          | <b>0,16</b>                  |                            |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| USA                    | 55,04        | Staatsanleihen                                      | 18,41        |
| Deutschland            | 10,69        | Pharmazeutika                                       | 7,07         |
| Vereinigtes Königreich | 5,96         | Alkoholfreie Getränke                               | 5,45         |
| Irland                 | 2,15         | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 4,35         |
| Dänemark               | 1,87         | Haushaltsprodukte                                   | 3,67         |
| Schweiz                | 1,74         | Restaurants   | 3,32         |
| Japan                  | 1,28         | Systemsoftware                                      | 2,84         |
| Frankreich             | 0,94         | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen           | 2,45         |
| Kanada                 | 0,80         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 2,29         |
| Indien                 | 0,70         | Gesundheitswesen: Managed Health Care               | 2,27         |
| Republik Korea         | 0,50         | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 2,17         |
| Hongkong               | 0,47         | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 1,76         |
| China                  | 0,46         | Halbleiter  | 1,73         |
| Israel                 | 0,36         | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  | 1,62         |
| Taiwan, Provinz Chinas | 0,16         | Kraftfahrzeugeinzelhandel                           | 1,61         |
| Kaimaninseln           | 0,15         | Schuhe  | 1,41         |
| Indonesien             | 0,11         | Kommunikationsanlagen                               | 1,40         |
| Südafrika              | 0,10         | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 1,23         |
| Niederlande            | 0,07         | Bekleidung-Einzelhandel                             | 1,15         |
| Spanien                | 0,07         | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 1,14         |
| Thailand               | 0,06         | Verschiedene Banken                                 | 1,07         |
| Türkei                 | 0,06         | Anwendungssoftware                                  | 1,06         |
| Brasilien              | 0,04         | Luffracht und Logistik                              | 1,00         |
| Bermuda                | 0,03         | Integrierte Telekommunikationsdienste               | 0,98         |
| Mexiko                 | 0,02         | Biotechnologie                                      | 0,97         |
| Philippinen            | 0,01         | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie    | 0,91         |
|                        |              | Kabel und Satellitenübertragung                     | 0,87         |
|                        |              | Mehrsparren-Versorger                               | 0,82         |
|                        |              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 0,80         |
|                        |              | Versicherungsmakler                                 | 0,80         |
|                        |              | Handelsgesellschaften und Großhändler               | 0,75         |
|                        |              | Internet-Dienste und -Infrastruktur                 | 0,63         |
|                        |              | Bau- und Ingenieurwesen                             | 0,59         |
|                        |              | Landwirtschafts- und Landmaschinen                  | 0,57         |
|                        |              | Drahtlose Telekommunikationsdienste                 | 0,57         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Technologie                       | 0,49         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Produkte                          | 0,45         |
|                        |              | Industriekonglomerate                               | 0,36         |
|                        |              | Rückversicherungen                                  | 0,32         |
|                        |              | Industriemaschinen                                  | 0,31         |
|                        |              | Großmärkte  | 0,30         |
|                        |              | Warenhäuser   | 0,29         |
|                        |              | Sach- und Unfallversicherung                        | 0,28         |
|                        |              | Mehrsparrenversicherungen                           | 0,24         |
|                        |              | Landwirtschaftliche Produkte                        | 0,21         |
|                        |              | Stromversorger                                      | 0,14         |
|                        |              | Lebensmitteleinzelhandel                            | 0,13         |
|                        |              | Lebens- und Krankenversicherung                     | 0,12         |
|                        |              | Immobilienentwicklung                               | 0,10         |
|                        |              | Vermögensverwaltung und Depotbanken                 | 0,09         |
|                        |              | Dünger und Chemikalien für die Landwirtschaft       | 0,07         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Vertrieb                          | 0,05         |
|                        |              | Autoteile und -zubehör                              | 0,04         |
|                        |              | Gasversorger  | 0,03         |
|                        |              | Einzelhandel: Heimwerker und Garten                 | 0,02         |
|                        |              | Erneuerbare Elektrizität                            | 0,02         |
|                        |              | Wasserversorger                                     | 0,02         |
|                        |              | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 0,01         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 0,01         |
| <b>Summe</b>           | <b>83,85</b> | <b>Summe</b>  | <b>83,85</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 111.102,28  | EUR                | 1.118.459,16      | NOK                  | (805,39)  | 28.01.2022  |
| 1.906.540,69                                      | EUR                | 19.526.245,56     | SEK                  | 2.524,31  | 28.01.2022  |
| 6.292,72  | EUR                | 7.095,33          | USD                  | 31,85   | 28.01.2022  |
| 157.165.030,81                                    | NOK                | 15.570.621,66     | EUR                  | 154.579,10  | 28.01.2022  |
| 1.295.901.770,60                                  | SEK                | 127.906.031,78    | EUR                  | (1.542.548,97)  | 28.01.2022  |
| 960.966,87  | USD                | 853.028,77        | EUR                  | (5.078,09)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.391.297,19)</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 334.000,00  | GBP                | 3.885.137,77      | NOK                  | 8.545,67  | 14.01.2022  |
| 1.098.181.980,00                                  | KRW                | 921.000,00        | USD                  | 1.041,76  | 14.01.2022  |
| 923.000,00  | USD                | 1.091.955.150,00  | KRW                  | 5.340,32  | 14.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>14.927,75</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 336.122,33  | AUD                | 213.000,00        | EUR                  | 2.023,31  | 14.01.2022  |
| 9.714.000,00                                      | AUD                | 62.106.663,97     | SEK                  | 157.104,64  | 14.01.2022  |
| 644.000,00  | AUD                | 473.795,50        | USD                  | (6.216,14)  | 14.01.2022  |
| 2.440.272,90                                      | BRL                | 428.000,00        | USD                  | 7.508,39  | 14.01.2022  |
| 766.000,00  | CAD                | 5.270.693,39      | NOK                  | 4.123,89  | 14.01.2022  |
| 101.596.417,63                                    | CZK                | 3.988.000,00      | EUR                  | 90.196,41   | 14.01.2022  |
| 371.000,00  | EUR                | 133.369.953,40    | HUF                  | 10.341,69   | 14.01.2022  |
| 2.771.000,00                                      | EUR                | 12.787.478,13     | PLN                  | (8.034,09)  | 14.01.2022  |
| 2.691.000,00                                      | EUR                | 27.761.165,27     | SEK                  | (16.493,88)   | 14.01.2022  |
| 15.921.682,68                                     | EUR                | 25.326.264,00     | SGD                  | (640.683,65)  | 14.01.2022  |
| 420.775,12  | GBP                | 494.000,00        | EUR                  | 6.738,24  | 14.01.2022  |
| 1.565.000,00                                      | GBP                | 239.658.053,00    | JPY                  | 24.979,88   | 14.01.2022  |
| 933.266.416,45                                    | HUF                | 2.653.638,23      | EUR                  | (129.918,98)  | 14.01.2022  |
| 103.749.416,00                                    | JPY                | 1.209.000,00      | CAD                  | (43.859,49)   | 14.01.2022  |
| 68.567.000,00                                     | JPY                | 5.486.601,06      | SEK                  | (9.404,56)  | 14.01.2022  |
| 7.841.430,00                                      | JPY                | 69.000,00         | USD                  | (783,18)  | 14.01.2022  |
| 1.101.285.598,00                                  | KRW                | 931.000,00        | USD                  | (5.485,90)  | 14.01.2022  |
| 8.433.074,64                                      | MXN                | 407.000,00        | USD                  | 4.047,40  | 14.01.2022  |
| 7.523.423,04                                      | NOK                | 1.161.000,00      | AUD                  | 10.436,43   | 14.01.2022  |
| 1.832.082,92                                      | NOK                | 262.000,00        | CAD                  | 1.524,67  | 14.01.2022  |
| 9.523.879,88                                      | NOK                | 118.260.000,00    | JPY                  | 46.729,71   | 14.01.2022  |
| 13.028.324,79                                     | NOK                | 2.137.000,00      | NZD                  | 16.607,96   | 14.01.2022  |
| 74.297.000,00                                     | NOK                | 75.774.630,52     | SEK                  | 47.483,68   | 14.01.2022  |
| 1.102.841,35                                      | NZD                | 1.055.000,00      | AUD                  | (10.402,62)   | 14.01.2022  |
| 426.942,10  | NZD                | 259.000,00        | EUR                  | (1.752,96)  | 14.01.2022  |
| 1.402.000,00                                      | NZD                | 8.522.518,12      | NOK                  | (8.408,21)  | 14.01.2022  |
| 5.000,00  | NZD                | 3.515,27          | USD                  | (90,07)   | 14.01.2022  |
| 3.893.637,05                                      | PLN                | 841.000,00        | EUR                  | 5.183,98  | 14.01.2022  |
| 19.901.102,07                                     | SEK                | 2.873.000,00      | CAD                  | (53.523,64)   | 14.01.2022  |
| 986.409,56  | SGD                | 620.119,10        | EUR                  | 24.953,40   | 14.01.2022  |
| 1.345.043,79                                      | USD                | 1.156.000,00      | EUR                  | 31.199,52   | 14.01.2022  |
| 459.000,00  | USD                | 1.450.912,68      | ILS                  | (7.355,29)  | 14.01.2022  |
| 906.000,00  | USD                | 1.074.421.216,00  | KRW                  | 3.330,77  | 14.01.2022  |
| 1.167.000,00                                      | USD                | 24.307.203,99     | MXN                  | (17.071,71)   | 14.01.2022  |
| 1.261.919,79                                      | USD                | 1.759.000,00      | NZD                  | 53.977,89   | 14.01.2022  |
| 3.982.000,00                                      | USD                | 36.095.311,41     | SEK                  | (5.624,74)  | 14.01.2022  |
| 1.949.090,89                                      | CHF                | 3.132.000,00      | NZD                  | 1.266,09  | 01.02.2022  |
| 572.000,00  | CHF                | 5.669.062,77      | SEK                  | 1.101,43  | 01.02.2022  |
| 5.348.000,00                                      | EUR                | 5.578.688,65      | CHF                  | (53.907,21)   | 01.02.2022  |
| 1.723.000,00                                      | EUR                | 17.620.487,97     | NOK                  | (39.782,27)   | 01.02.2022  |
| 681.000,00  | EUR                | 772.379,78        | USD                  | (489,37)  | 01.02.2022  |
| 143.276,71  | GBP                | 169.000,00        | EUR                  | 1.437,03  | 01.02.2022  |
| 225.652.048,00                                    | JPY                | 1.822.000,00      | CHF                  | (34.616,33)   | 01.02.2022  |
| 70.876.120,00                                     | JPY                | 883.000,00        | NZD                  | 11.551,63   | 01.02.2022  |
| 7.421.365,65                                      | NOK                | 94.568.000,00     | JPY                  | 17.568,04   | 01.02.2022  |
| 16.625.541,45                                     | NOK                | 1.837.000,00      | USD                  | 42.420,21   | 01.02.2022  |
| 530.000,00  | NZD                | 358.043,30        | USD                  | 3.250,99  | 01.02.2022  |
| 5.573.123,29                                      | SEK                | 586.000,00        | CHF                  | (24.025,91)   | 01.02.2022  |
| 3.295.158,57                                      | SEK                | 540.000,00        | NZD                  | (3.884,24)  | 01.02.2022  |
| 47.990.502,65                                     | SEK                | 5.302.000,00      | USD                  | 1.302,13  | 01.02.2022  |
| 12.160.000,00                                     | USD                | 1.384.917.141,00  | JPY                  | 113.526,50  | 01.02.2022  |
| 498.115,01  | EUR                | 565.000,00        | USD                  | (185,54)  | 22.02.2022  |
| 34.667.080,80                                     | INR                | 456.000,00        | USD                  | 6.186,04  | 22.02.2022  |
| 2.448.000,00                                      | USD                | 186.030.864,00    | INR                  | (32.305,95)   | 22.02.2022  |
| 2.202.361,71                                      | USD                | 2.622.253.625,00  | KRW                  | 2.198,09  | 22.02.2022  |
| 90.000,00   | AUD                | 57.675,84         | EUR                  | (147,70)  | 28.02.2022  |
| 1.402.721,91                                      | EUR                | 2.191.000,00      | AUD                  | 2.229,96  | 28.02.2022  |
| 8.867.151,76                                      | EUR                | 9.300.000,00      | CHF                  | (139.515,44)  | 28.02.2022  |
| 55.138,69   | EUR                | 565.000,00        | SEK                  | 66,45   | 28.02.2022  |
| 125.201.096,16                                    | EUR                | 141.417.500,00    | USD                  | 493.998,24  | 28.02.2022  |
| 882.676,35  | CAD                | 609.737,87        | EUR                  | 2.390,58  | 01.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(44.983,80)</b>  |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                             | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|--|-------------|
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |                    |                   |                      |  |             |
| 647.000,00                                    | AUD                | 583.475,60        | CAD                  | 8.852,32   | 14.01.2022  |
| 627.943,25                                    | AUD                | 389.000,00        | EUR                  | 12.708,54  | 14.01.2022  |
| 1.161.007,85                                  | AUD                | 623.000,00        | GBP                  | 1.324,61   | 14.01.2022  |
| 1.266.000,00                                  | AUD                | 922.617,26        | USD                  | (4.461,12)   | 14.01.2022  |
| 2.595.760,46                                  | BRL                | 457.000,00        | USD                  | 6.460,34   | 14.01.2022  |
| 928.515,45                                    | CAD                | 618.888,59        | EUR                  | 25.689,25  | 14.01.2022  |
| 1.559.000,00                                  | CAD                | 11.041.355,59     | NOK                  | (23.067,12)  | 14.01.2022  |
| 392.000,00                                    | CAD                | 2.765.481,99      | SEK                  | 2.413,45   | 14.01.2022  |
| 595.520,18                                    | CAD                | 479.000,00        | USD                  | (9.380,27)   | 14.01.2022  |
| 924.000,00                                    | EUR                | 1.474.895,51      | AUD                  | (19.519,12)  | 14.01.2022  |
| 13.319.546,03                                 | EUR                | 19.957.662,08     | CAD                  | (535.110,48)   | 14.01.2022  |
| 8.237.346,58                                  | EUR                | 7.071.531,39      | GBP                  | (178.058,86)   | 14.01.2022  |
| 1.025.000,00                                  | EUR                | 380.219.697,00    | HUF                  | (3.196,43)   | 14.01.2022  |
| 41.946,48                                     | EUR                | 159.250,15        | ILS                  | (3.328,24)   | 14.01.2022  |
| 14.306.192,25                                 | EUR                | 1.860.251.346,00  | JPY                  | 43.883,25  | 14.01.2022  |
| 1.220.465,33                                  | EUR                | 29.317.938,72     | MXN                  | (42.508,88)  | 14.01.2022  |
| 3.546.366,25                                  | EUR                | 16.119.653,13     | PLN                  | 43.182,09  | 14.01.2022  |
| 582.000,00                                    | GBP                | 997.808,15        | CAD                  | (74,42)  | 14.01.2022  |
| 151.046.116,80                                | HUF                | 411.000,00        | EUR                  | (2.539,55)   | 14.01.2022  |
| 1.427.983,43                                  | ILS                | 459.000,00        | USD                  | 834,97   | 14.01.2022  |
| 7.078.992.117,00                              | JPY                | 54.440.719,75     | EUR                  | (166.993,15)   | 14.01.2022  |
| 87.792.412,00                                 | JPY                | 585.000,00        | GBP                  | (23.081,84)  | 14.01.2022  |
| 200.724.823,00                                | JPY                | 1.821.000,00      | USD                  | (68.375,01)  | 14.01.2022  |
| 554.978.130,00                                | KRW                | 467.000,00        | USD                  | (853,18)   | 14.01.2022  |
| 156.611.765,73                                | MXN                | 6.519.531,66      | EUR                  | 227.075,71   | 14.01.2022  |
| 3.937.249,14                                  | NOK                | 660.000,00        | NZD                  | (3.529,47)   | 14.01.2022  |
| 584.117,11                                    | NZD                | 349.000,00        | EUR                  | 2.951,66   | 14.01.2022  |
| 643.269,09                                    | NZD                | 338.000,00        | GBP                  | (14.643,08)  | 14.01.2022  |
| 5.170.000,00                                  | NZD                | 406.461.264,00    | JPY                  | (1.184,22)   | 14.01.2022  |
| 905.000,00                                    | NZD                | 5.497.647,85      | NOK                  | (5.057,83)   | 14.01.2022  |
| 669.000,00                                    | NZD                | 4.057.929,89      | SEK                  | 7.336,08   | 14.01.2022  |
| 689.000,00                                    | NZD                | 465.390,36        | USD                  | 4.374,76   | 14.01.2022  |
| 5.373.415,05                                  | PLN                | 1.178.024,99      | EUR                  | (10.252,99)  | 14.01.2022  |
| 6.692.193,28                                  | SEK                | 769.000,00        | USD                  | (26.082,10)  | 14.01.2022  |
| 953.281,07                                    | USD                | 1.289.000,00      | AUD                  | 16.815,99  | 14.01.2022  |
| 459.000,00                                    | USD                | 2.649.487,54      | BRL                  | (13.179,29)  | 14.01.2022  |
| 899.000,00                                    | USD                | 1.119.662,61      | CAD                  | 16.234,14  | 14.01.2022  |
| 19.000,00                                     | USD                | 17.467,15         | CHF                  | (141,59)   | 14.01.2022  |
| 1.322.119,45                                  | USD                | 1.173.000,00      | EUR                  | (6.044,01)   | 14.01.2022  |
| 1.763.000,00                                  | USD                | 36.873.095,58     | MXN                  | (32.336,96)  | 14.01.2022  |
| 149.630.595,00                                | ZAR                | 8.791.456,82      | EUR                  | (527.416,09)   | 14.01.2022  |
| 1.344.000,00                                  | AUD                | 1.223.710,66      | CAD                  | 10.349,46  | 01.02.2022  |
| 2.143.000,00                                  | AUD                | 1.532.004,77      | USD                  | 18.781,27  | 01.02.2022  |
| 118.972,83                                    | CAD                | 129.000,00        | AUD                  | 60,97  | 01.02.2022  |
| 3.314.824,14                                  | CAD                | 2.302.185,03      | EUR                  | (1.919,53)   | 01.02.2022  |
| 1.075.000,00                                  | CHF                | 132.356.365,00    | JPY                  | 26.412,64  | 01.02.2022  |
| 658.000,00                                    | CHF                | 6.496.426,10      | SEK                  | 3.704,00   | 01.02.2022  |
| 736.000,00                                    | EUR                | 1.151.671,46      | AUD                  | (518,94)   | 01.02.2022  |
| 21.061.227,48                                 | EUR                | 30.325.219,00     | CAD                  | 17.560,52  | 01.02.2022  |
| 12.455.157,90                                 | EUR                | 10.548.910,10     | GBP                  | (93.455,02)  | 01.02.2022  |
| 15.966.946,66                                 | EUR                | 156.272.498,67    | NOK                  | 333.596,03   | 01.02.2022  |
| 68.000,00                                     | GBP                | 10.211.179,00     | JPY                  | 2.621,37   | 01.02.2022  |
| 2.328.191.079,00                              | JPY                | 17.547.283,18     | EUR                  | 298.827,34   | 01.02.2022  |
| 15.883.045,30                                 | NOK                | 1.622.830,24      | EUR                  | (33.905,65)  | 01.02.2022  |
| 1.290.653,74                                  | NOK                | 152.000,00        | USD                  | (4.998,78)   | 01.02.2022  |
| 27.304.498,61                                 | SEK                | 341.911.000,00    | JPY                  | 41.589,29  | 01.02.2022  |
| 2.487.000,00                                  | USD                | 3.214.235,61      | CAD                  | (36.146,86)  | 01.02.2022  |
| 864.000,00                                    | USD                | 7.849.497,02      | SEK                  | (3.050,39)   | 01.02.2022  |
| 3.063.787.423,00                              | CLP                | 3.734.336,48      | USD                  | (147.772,79)   | 22.02.2022  |
| 9.280.344,66                                  | EUR                | 10.555.000,00     | USD                  | (28.639,70)  | 22.02.2022  |
| 546.171.553,70                                | INR                | 7.263.788,93      | USD                  | 27.179,47  | 22.02.2022  |
| 681.391.072,80                                | RUB                | 8.954.709,12      | USD                  | 24.205,86  | 22.02.2022  |
| 4.119.596,01                                  | SGD                | 3.007.000,00      | USD                  | 39.307,37  | 22.02.2022  |
| 775.000,00                                    | USD                | 684.998,95        | EUR                  | (1.491,07)   | 22.02.2022  |
| 793.792,23                                    | USD                | 59.686.031,60     | INR                  | (2.970,19)   | 22.02.2022  |
| 2.535.826,04                                  | USD                | 193.249.470,00    | RUB                  | (10.237,84)  | 22.02.2022  |
| 320.000,00                                    | AUD                | 201.703,00        | EUR                  | 2.845,15   | 28.02.2022  |
| 380.000,00                                    | CAD                | 263.891,45        | EUR                  | (360,18)   | 28.02.2022  |
| 5.250.000,00                                  | DKK                | 705.931,42        | EUR                  | 92,70  | 28.02.2022  |
| 192.251,00                                    | EUR                | 300.000,00        | AUD                  | 490,55   | 28.02.2022  |
| 39.249.239,78                                 | EUR                | 33.120.000,00     | GBP                  | (121.128,81)   | 28.02.2022  |
| 563.068,53                                    | EUR                | 5.709.770,00      | SEK                  | 6.526,61   | 28.02.2022  |
| 396.251,50                                    | CAD                | 272.000,00        | EUR                  | 2.798,92   | 01.03.2022  |
| 714.000,86                                    | CHF                | 685.756,67        | EUR                  | 5.721,97   | 01.03.2022  |
| 874.416,37                                    | EUR                | 21.580.081,04     | MXN                  | (46.846,60)  | 01.03.2022  |
| 23.740,86                                     | EUR                | 243.971,80        | NOK                  | (639,97)   | 01.03.2022  |
| 425.526,13                                    | EUR                | 4.351.288,51      | SEK                  | 1.399,52   | 01.03.2022  |
| 1.109.000,00                                  | EUR                | 1.257.174,27      | USD                  | 396,11   | 01.03.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                                | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|--|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| 1.841.855,00                                     | JPY               | 14.317,35          | EUR                | (204,55)   | 01.03.2022 |
| 5.975.255,19                                     | SEK               | 584.338,92         | EUR                | (1.921,85)   | 01.03.2022 |
| 29.000,00  | USD               | 37.513,12          | CAD                | (442,56)   | 01.03.2022 |
| 456.000,00                                       | USD               | 7.368.517,22       | ZAR                | (1.854,20)   | 01.03.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>(974.316,50)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                   |                    |                    |  |            |
| 2.050.000,00                                     | AUD               | 1.520.821,20       | USD                | (30.930,29)  | 14.01.2022 |
| 2.274.454,69                                     | CAD               | 1.758.000,00       | USD                | 27.239,39  | 14.01.2022 |
| 48.378.252,20                                    | EUR               | 77.515.409,17      | AUD                | (1.209.897,75)   | 14.01.2022 |
| 1.777.000,00                                     | EUR               | 2.008.877,18       | USD                | 3.882,57   | 14.01.2022 |
| 1.767.000,00                                     | GBP               | 21.236.260,12      | SEK                | 31.668,44  | 14.01.2022 |
| 705.000,00                                       | GBP               | 934.848,33         | USD                | 13.841,26  | 14.01.2022 |
| 176.197.991,00                                   | JPY               | 1.166.000,00       | GBP                | (36.700,04)  | 14.01.2022 |
| 53.759.878,00                                    | JPY               | 671.000,00         | NZD                | 7.871,58   | 14.01.2022 |
| 172.450.329,00                                   | JPY               | 1.515.000,00       | USD                | (15.050,13)  | 14.01.2022 |
| 9.536.730,11                                     | MXN               | 448.000,00         | USD                | 15.405,48  | 14.01.2022 |
| 61.174.000,00                                    | NOK               | 62.737.546,27      | SEK                | 5.254,77   | 14.01.2022 |
| 1.936.361,90                                     | NOK               | 226.000,00         | USD                | (5.635,92)   | 14.01.2022 |
| 655.000,00                                       | NZD               | 51.201.809,00      | JPY                | 2.102,83   | 14.01.2022 |
| 664.000,00                                       | NZD               | 474.947,25         | USD                | (19.129,95)  | 14.01.2022 |
| 1.902.928,50                                     | PLN               | 406.000,00         | EUR                | 7.554,88   | 14.01.2022 |
| 596.659,46                                       | SGD               | 436.000,00         | USD                | 5.357,29   | 14.01.2022 |
| 741.958,12                                       | USD               | 1.010.000,00       | AUD                | 8.772,24   | 14.01.2022 |
| 448.000,00                                       | USD               | 570.331,82         | CAD                | (498,51)   | 14.01.2022 |
| 2.654.638,78                                     | USD               | 2.250.000,00       | EUR                | 93.118,32  | 14.01.2022 |
| 470.331,73                                       | USD               | 352.000,00         | GBP                | (3.758,47)   | 14.01.2022 |
| 473.000,00                                       | USD               | 556.683.160,00     | KRW                | 4.886,28   | 14.01.2022 |
| 1.991.000,00                                     | USD               | 30.775.944,22      | ZAR                | 57.582,57  | 14.01.2022 |
| 71.670.257,46                                    | EUR               | 84.345.250,00      | USD                | (2.762.900,50)   | 24.01.2022 |
| 815.000,00                                       | EUR               | 8.317.309,72       | NOK                | (17.076,18)  | 01.02.2022 |
| 8.655.663,01                                     | EUR               | 10.000.000,00      | USD                | (167.673,95)   | 01.02.2022 |
| 1.143.702,24                                     | NOK               | 179.000,00         | AUD                | (58,07)  | 01.02.2022 |
| 6.761.679,25                                     | NOK               | 662.000,00         | EUR                | 14.448,90  | 01.02.2022 |
| 2.085.908,40                                     | BRL               | 360.000,00         | USD                | 8.597,89   | 22.02.2022 |
| 2.448.000,00                                     | USD               | 186.090.840,00     | INR                | (33.013,02)  | 22.02.2022 |
| 230.000,00                                       | AUD               | 145.067,94         | EUR                | 1.950,94   | 28.02.2022 |
| 271.799,25                                       | EUR               | 430.000,00         | AUD                | (3.061,50)   | 28.02.2022 |
| 5.357.247,29                                     | EUR               | 7.695.000,00       | CAD                | 20.753,67  | 28.02.2022 |
| 10.529.164,31                                    | EUR               | 78.300.000,00      | DKK                | (680,44)   | 28.02.2022 |
| 399.397,75                                       | EUR               | 1.423.347,75       | ILS                | (5.042,01)   | 01.03.2022 |
| 1.547.757,92                                     | EUR               | 28.293.293,39      | ZAR                | (3.364,83)   | 01.03.2022 |
| 5.015.167,53                                     | ILS               | 1.407.278,47       | EUR                | 17.765,52  | 01.03.2022 |
| 769.000,00                                       | USD               | 16.211.071,37      | MXN                | (13.912,68)  | 01.03.2022 |
| 9.845.645,49                                     | ZAR               | 538.596,75         | EUR                | 1.170,90   | 01.03.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>(3.979.158,52)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 199.663,81                                       | AUD               | 127.000,00         | EUR                | 728,30   | 14.01.2022 |
| 2.008.579,59                                     | AUD               | 1.066.000,00       | GBP                | 16.348,70  | 14.01.2022 |
| 2.939.000,00                                     | AUD               | 234.422.869,00     | JPY                | 82.854,73  | 14.01.2022 |
| 59.000,00  | AUD               | 372.833,37         | NOK                | 420,28   | 14.01.2022 |
| 1.188.000,00                                     | AUD               | 873.554,22         | USD                | (11.055,57)  | 14.01.2022 |
| 2.530.380,00                                     | BRL               | 466.000,00         | USD                | (11.810,37)  | 14.01.2022 |
| 895.472,13                                       | CAD               | 525.000,00         | GBP                | (3.135,70)   | 14.01.2022 |
| 128.000,00                                       | CAD               | 909.450,41         | SEK                | 160,23   | 14.01.2022 |
| 4.359.708,53                                     | CHF               | 4.016.106,53       | EUR                | 205.028,03   | 14.01.2022 |
| 167.000,00                                       | CHF               | 1.642.495,85       | SEK                | 1.500,99   | 14.01.2022 |
| 5.027.031,59                                     | EUR               | 5.457.124,30       | CHF                | (256.637,23)   | 14.01.2022 |
| 10.494.760,96                                    | EUR               | 107.978.154,79     | NOK                | (314.640,07)   | 14.01.2022 |
| 32.448.957,10                                    | EUR               | 54.126.621,15      | NZD                | (164.259,16)   | 14.01.2022 |
| 945.000,00                                       | EUR               | 4.376.526,70       | PLN                | (6.127,96)   | 14.01.2022 |
| 12.552.085,94                                    | EUR               | 128.048.041,16     | SEK                | 63.838,78  | 14.01.2022 |
| 6.167.862,26                                     | EUR               | 7.290.249,76       | USD                | (266.883,36)   | 14.01.2022 |
| 574.000,00                                       | GBP               | 86.539.081,00      | JPY                | 19.599,72  | 14.01.2022 |
| 800.000,00                                       | GBP               | 1.555.415,81       | NZD                | 14.838,48  | 14.01.2022 |
| 526.836.624,15                                   | HUF               | 1.437.000,00       | EUR                | (12.323,92)  | 14.01.2022 |
| 77.500.000,00                                    | JPY               | 601.912,44         | EUR                | (7.731,37)   | 14.01.2022 |
| 121.932.309,00                                   | JPY               | 795.000,00         | GBP                | (11.239,45)  | 14.01.2022 |
| 5.117.413,75                                     | NOK               | 516.000,00         | EUR                | (3.714,32)   | 14.01.2022 |
| 657.382,45                                       | NZD               | 630.000,00         | AUD                | (6.926,98)   | 14.01.2022 |
| 3.729.638,07                                     | NZD               | 2.234.870,50       | EUR                | 12.369,49  | 14.01.2022 |
| 680.000,00                                       | NZD               | 52.263.270,00      | JPY                | 9.029,88   | 14.01.2022 |
| 534.000,00                                       | NZD               | 3.273.793,96       | NOK                | (5.976,15)   | 14.01.2022 |
| 2.188.000,00                                     | NZD               | 1.550.730,57       | USD                | (50.405,92)  | 14.01.2022 |
| 12.265.141,50                                    | PLN               | 2.666.000,00       | EUR                | (484,62)   | 14.01.2022 |
| 219.240.517,90                                   | SEK               | 21.492.912,60      | EUR                | (110.861,78)   | 14.01.2022 |
| 3.758.778,30                                     | SEK               | 317.000,00         | GBP                | (10.657,41)  | 14.01.2022 |
| 22.105.731,20                                    | SEK               | 2.438.000,00       | USD                | 4.047,73   | 14.01.2022 |
| 586.170,42                                       | USD               | 796.000,00         | AUD                | 8.166,59   | 14.01.2022 |
| 876.000,00                                       | USD               | 4.912.797,60       | BRL                | (2.452,87)   | 14.01.2022 |
| 1.274.000,00                                     | USD               | 1.177.667,96       | CHF                | (15.740,15)  | 14.01.2022 |
| 89.656.466,65                                    | USD               | 75.581.211,07      | EUR                | 3.554.221,10   | 14.01.2022 |
| 310.113,81                                       | USD               | 230.000,00         | GBP                | 11,61  | 14.01.2022 |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) in der Basiswahrung des<br>Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|----------------------------------|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| 464.000,00                       | USD                | 9.690.232,14      | MXN                  | (7.893,87)  | 14.01.2022  |
| 657.777,89                       | USD                | 962.000,00        | NZD                  | 943,82  | 14.01.2022  |
| 1.918.000,00                     | USD                | 27.535.566,76     | TRY                  | (95.721,95)   | 14.01.2022  |
| 38.817.766,02                    | ZAR                | 2.407.000,00      | USD                  | 19.412,31   | 14.01.2022  |
| 565.000,00                       | AUD                | 44.987.504,00     | JPY                  | 16.503,37   | 01.02.2022  |
| 11.233.747,17                    | CHF                | 10.585.192,43     | EUR                  | 292.680,25  | 01.02.2022  |
| 5.372.377,86                     | CHF                | 5.911.000,00      | USD                  | (13.320,38)   | 01.02.2022  |
| 5.740.988,63                     | EUR                | 8.894.972,96      | AUD                  | 52.493,35   | 01.02.2022  |
| 710.000,00                       | EUR                | 1.033.655,63      | CAD                  | (7.292,29)  | 01.02.2022  |
| 14.216.055,82                    | EUR                | 15.087.073,56     | CHF                  | (393.073,51)  | 01.02.2022  |
| 12.581.942,34                    | EUR                | 20.507.748,19     | NZD                  | 232.576,08  | 01.02.2022  |
| 95.973.979,72                    | EUR                | 112.080.620,92    | USD                  | (2.919.141,24)  | 01.02.2022  |
| 197.000,00                       | GBP                | 333.701,45        | CAD                  | 2.778,36  | 01.02.2022  |
| 2.328.191.079,00                 | JPY                | 17.562.107,88     | EUR                  | 283.993,91  | 01.02.2022  |
| 238.193.000,00                   | JPY                | 18.974.749,76     | NOK                  | (72.497,13)   | 01.02.2022  |
| 12.608.298,36                    | NOK                | 1.223.000,00      | EUR                  | 38.360,50   | 01.02.2022  |
| 5.951.054,48                     | SEK                | 604.000,00        | CHF                  | (4.593,25)  | 01.02.2022  |
| 975.710,01                       | SEK                | 84.000,00         | GBP                  | (4.787,84)  | 01.02.2022  |
| 18.258.875,78                    | USD                | 15.634.968,47     | EUR                  | 475.552,66  | 01.02.2022  |
| 182.000,00                       | USD                | 1.667.385,94      | NOK                  | (6.226,52)  | 01.02.2022  |
| 260.154.813,00                   | CLP                | 319.000,00        | USD                  | (14.231,12)   | 22.02.2022  |
| 29.006.141,21                    | RUB                | 388.000,00        | USD                  | (4.978,16)  | 22.02.2022  |
| 4.083.939,51                     | ZAR                | 254.000,00        | USD                  | 130,50  | 22.02.2022  |
| 261.000,00                       | AUD                | 164.880,55        | EUR                  | 1.953,63  | 28.02.2022  |
| 340.370,49                       | EUR                | 3.000.000,00      | HKD                  | 1.132,32  | 28.02.2022  |
| 3.530.462,60                     | EUR                | 4.000.000,00      | USD                  | 3.105,18  | 28.02.2022  |
| 5.500.000,00                     | HKD                | 625.880,36        | EUR                  | (3.945,76)  | 28.02.2022  |
| 401.726,80                       | EUR                | 622.071,94        | SGD                  | (4.597,44)  | 01.03.2022  |
| 96.198,15                        | EUR                | 1.523.362,18      | TRY                  | 1.320,51  | 01.03.2022  |
| 7.463.070,05                     | EUR                | 8.470.779,29      | USD                  | (6.659,51)  | 01.03.2022  |
| 6.777.950,03                     | SGD                | 4.377.121,03      | EUR                  | 50.092,68   | 01.03.2022  |
| 9.736.270,12                     | TRY                | 614.831,58        | EUR                  | (8.439,77)  | 01.03.2022  |
| 1.764.807,52                     | USD                | 1.554.860,74      | EUR                  | 1.387,45  | 01.03.2022  |
| 7.412.455,00                     | ZAR                | 457.000,00        | USD                  | 3.382,88  | 01.03.2022  |
|                                  |                    |                   |                      | <b>630.500,30</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 170.000,00                       | AUD                | 1.076.991,46      | NOK                  | 938,05  | 14.01.2022  |
| 10.474.000,00                    | AUD                | 67.365.816,84     | SEK                  | 130.367,44  | 14.01.2022  |
| 375.000,00                       | AUD                | 268.018,80        | USD                  | 3.329,80  | 14.01.2022  |
| 575.875,87                       | CAD                | 655.000,00        | NZD                  | 5.111,44  | 14.01.2022  |
| 627.000,00                       | EUR                | 995.485,22        | AUD                  | (9.830,25)  | 14.01.2022  |
| 226.000,00                       | EUR                | 340.629,32        | CAD                  | (10.466,02)   | 14.01.2022  |
| 418.000,00                       | EUR                | 4.268.796,91      | NOK                  | (9.336,92)  | 14.01.2022  |
| 370.000,00                       | EUR                | 1.752.632,91      | PLN                  | (10.892,82)   | 14.01.2022  |
| 165.000,00                       | EUR                | 192.461,71        | USD                  | (4.875,94)  | 14.01.2022  |
| 348.000,00                       | GBP                | 646.647,89        | AUD                  | 460,87  | 14.01.2022  |
| 351.000,00                       | GBP                | 464.137,41        | USD                  | 8.036,89  | 14.01.2022  |
| 608.933.249,00                   | JPY                | 7.543.000,00      | AUD                  | (156.800,26)  | 14.01.2022  |
| 1.081.814.970,00                 | KRW                | 914.000,00        | USD                  | (4.912,17)  | 14.01.2022  |
| 7.954.671,69                     | NOK                | 1.115.000,00      | CAD                  | 22.292,46   | 14.01.2022  |
| 2.206.646,02                     | NOK                | 216.000,00        | EUR                  | 4.900,97  | 14.01.2022  |
| 3.596.094,49                     | NOK                | 45.268.000,00     | JPY                  | 12.931,69   | 14.01.2022  |
| 9.794.000,00                     | NZD                | 789.032.357,00    | JPY                  | (148.226,81)  | 14.01.2022  |
| 992.000,00                       | NZD                | 6.044.846,54      | SEK                  | 8.175,12  | 14.01.2022  |
| 2.576.000,00                     | NZD                | 1.808.120,68      | USD                  | (43.803,93)   | 14.01.2022  |
| 20.543.607,79                    | SEK                | 2.025.000,00      | EUR                  | (21.429,45)   | 14.01.2022  |
| 64.401.484,11                    | TRY                | 6.011.874,49      | EUR                  | (1.829.072,14)  | 14.01.2022  |
| 1.097.614,96                     | USD                | 941.000,00        | EUR                  | 27.807,68   | 14.01.2022  |
| 1.813.973,51                     | USD                | 1.317.000,00      | GBP                  | 33.822,80   | 14.01.2022  |
| 4.378.000,00                     | USD                | 39.072.949,79     | SEK                  | 53.513,47   | 14.01.2022  |
| 120.000,00                       | AUD                | 9.698.686,00      | JPY                  | 2.402,10  | 01.02.2022  |
| 147.000,00                       | EUR                | 18.850.469,00     | JPY                  | 2.509,80  | 01.02.2022  |
| 149.000,00                       | GBP                | 252.814,59        | CAD                  | 1.809,00  | 01.02.2022  |
| 3.116.000,00                     | NZD                | 1.950.808,57      | CHF                  | (12.570,99)   | 01.02.2022  |
| 1.528.719,02                     | USD                | 2.168.000,00      | AUD                  | (37.679,53)   | 01.02.2022  |
| 5.896.000,00                     | USD                | 5.429.144,70      | CHF                  | (54.922,31)   | 01.02.2022  |
| 16.523.366,00                    | BRL                | 2.901.472,92      | USD                  | 24.183,60   | 22.02.2022  |
| 546.171.553,50                   | INR                | 7.261.374,62      | USD                  | 29.310,62   | 22.02.2022  |
| 436.000,00                       | USD                | 372.165.240,00    | CLP                  | 2.398,31  | 22.02.2022  |
| 793.528,40                       | USD                | 59.686.032,00     | INR                  | (3.203,08)  | 22.02.2022  |
| 107.000,00                       | USD                | 972.623,42        | SEK                  | (443,99)  | 22.02.2022  |
| 5.000.000,00                     | DKK                | 672.254,79        | EUR                  | 149,20  | 28.02.2022  |
| 470.520,92                       | EUR                | 3.500.000,00      | DKK                  | (161,94)  | 28.02.2022  |
| 395.626,13                       | EUR                | 3.500.000,00      | HKD                  | (153,34)  | 28.02.2022  |
| 2.655.037,84                     | EUR                | 3.000.000,00      | USD                  | 9.527,63  | 28.02.2022  |
| 3.763.000,00                     | EUR                | 4.261.421,02      | USD                  | 5.189,62  | 01.03.2022  |
| 412.998,24                       | USD                | 366.000,00        | EUR                  | (1.810,94)  | 01.03.2022  |
|                                  |                    |                   |                      | <b>(1.971.424,27)</b>   |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                       | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 2.707.725,39                            | SEK                | 2.719.000,00      | NOK                  | (8.112,87)  | 14.01.2022  |
| 162.000,00                              | USD                | 1.375.362,46      | NOK                  | 5.306,51  | 14.01.2022  |
| 339.000,00                              | EUR                | 3.441.104,52      | NOK                  | (5.252,21)  | 01.02.2022  |
| 16.657.913,71                           | EUR                | 166.089.708,09    | SEK                  | 463.373,23  | 01.02.2022  |
| 125.110.246,90                          | SEK                | 12.564.598,63     | EUR                  | (365.761,35)  | 01.02.2022  |
| 1.623.711,69                            | SEK                | 190.000,00        | USD                  | (9.324,70)  | 01.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>80.228,61</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 711.000,00                              | EUR                | 738.852,36        | CHF                  | (4.360,05)  | 14.01.2022  |
| 444.000,00                              | EUR                | 378.376,80        | GBP                  | (6.282,70)  | 14.01.2022  |
| 1.081.000,00                            | EUR                | 922.230,29        | GBP                  | (16.057,40)   | 01.02.2022  |
| 205.617.600,00                          | CLP                | 240.000,00        | USD                  | (543,25)  | 22.02.2022  |
| 34.925.310,00                           | INR                | 459.000,00        | USD                  | 6.582,26  | 22.02.2022  |
| 716.591.640,00                          | KRW                | 604.000,00        | USD                  | (2.501,66)  | 22.02.2022  |
| 61.128.440,10                           | RUB                | 819.000,00        | USD                  | (11.653,47)   | 22.02.2022  |
| 1.298.000,00                            | USD                | 99.220.418,00     | INR                  | (23.985,12)   | 22.02.2022  |
| 1.271.000,00                            | USD                | 95.325.171,59     | RUB                  | 12.727,70   | 22.02.2022  |
| 4.435.421,86                            | EUR                | 39.000.000,00     | HKD                  | 25.337,26   | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(20.736,43)</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(6.264.962,86)</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(7.656.260,05)</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

## Credit Default Swaps

| Basiswert                                     | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal        | Wahrung | Kosten (EUR)        | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)     | Falligkeit |
|---|--------------|-----------------|----------------|----------|---------------------|--|---------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b> |              |                 |                |          |                     |  |                     |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.074.000,00) | USD      | 171.933,70          | (2.721,19)   | 169.212,51          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.706.000,00) | USD      | 224.420,31          | (3.644,48)   | 220.775,83          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (3.192.000,00) | USD      | 264.453,49          | (4.026,13)   | 260.427,36          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.533.000,00) | USD      | 204.640,93          | 2.020,25   | 206.661,18          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.669.000,00) | USD      | 216.593,47          | 1.163,62   | 217.757,09          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (414.000,00)   | USD      | 35.160,07           | (1.382,84)   | 33.777,23           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (517.000,00)   | USD      | 42.132,16           | 48,58  | 42.180,74           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (436.000,00)   | USD      | 34.750,69           | 821,47   | 35.572,16           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (3.645.000,00) | USD      | 272.766,69          | 24.619,82  | 297.386,51          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (882.000,00)   | USD      | 61.569,32           | 10.390,87  | 71.960,19           | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (3.202.000,00) | EUR      | 390.342,51          | (8.653,51)   | 381.689,00          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (3.912.000,00) | EUR      | 475.837,69          | (9.514,34)   | 466.323,35          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (774.000,00)   | EUR      | 94.358,57           | (2.095,21)   | 92.263,36           | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (1.285.000,00) | EUR      | 151.216,27          | 1.959,98   | 153.176,25          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (1.312.000,00) | EUR      | 155.890,64          | 504,10   | 156.394,74          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (2.591.000,00) | EUR      | 289.035,98          | 19.819,80  | 308.855,78          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (2.669.000,00) | EUR      | 291.388,07          | 26.765,57  | 318.153,64          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (1.000.000,00) | EUR      | 96.999,18           | 22.204,13  | 119.203,31          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (1.097.000,00) | EUR      | 110.156,68          | 20.609,35  | 130.766,03          | 20.12.2026  |
|   |              |                 |                |          | <b>3.583.646,42</b> | <b>98.889,84</b>                                     | <b>3.682.536,26</b> |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>            |              |                 |                |          |                     |  |                     |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.768.000,00) | USD      | 221.700,68          | 4.133,58   | 225.834,26          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (482.000,00)   | USD      | 38.962,05           | 363,13   | 39.325,18           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (881.000,00)   | USD      | 61.802,77           | 10.075,83  | 71.878,60           | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (1.096.000,00) | EUR      | 109.549,67          | 21.097,16  | 130.646,83          | 20.12.2026  |
|   |              |                 |                |          | <b>432.015,17</b>   | <b>35.669,70</b>                                     | <b>467.684,87</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |              |                 |                |          |                     |  |                     |             |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (3.159.000,00) | EUR      | 384.735,82          | (8.172,56)   | 376.563,26          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (1.097.000,00) | EUR      | 110.690,99          | 20.075,04  | 130.766,03          | 20.12.2026  |
|   |              |                 |                |          | <b>495.426,81</b>   | <b>11.902,48</b>                                     | <b>507.329,29</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>       |              |                 |                |          |                     |  |                     |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (250.000,00)   | USD      | 20.450,25           | (53,37)  | 20.396,88           | 20.12.2026  |
|   |              |                 |                |          | <b>20.450,25</b>    | <b>(53,37)</b>                                       | <b>20.396,88</b>    |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert  | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal        | Wahrung | Kosten (EUR)        | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)     | Falligkeit |
|--|--------------|-----------------|----------------|----------|---------------------|---|---------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |              |                 |                |          |                     |   |                     |             |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (2.484.000,00) | EUR      | 294.922,57          | 1.178,46  | 296.101,03          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (5.088.000,00) | EUR      | 606.191,37          | 315,08  | 606.506,45          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (3.410.000,00) | EUR      | 405.936,27          | 547,02  | 406.483,29          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (3.139.000,00) | EUR      | 375.384,15          | (1.204,96)  | 374.179,19          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.080.000,00) | EUR      | 128.974,69          | (235,11)  | 128.739,58          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (2.591.000,00) | EUR      | 290.745,40          | 18.110,38   | 308.855,78          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.097.000,00) | EUR      | 109.915,55          | 20.850,48   | 130.766,03          | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                |          | <b>2.212.070,00</b> | <b>39.561,35</b>                                    | <b>2.251.631,35</b> |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |              |                 |                |          |                     |   |                     |             |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (3.547.000,00) | EUR      | 427.367,94          | (4.553,79)  | 422.814,15          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (3.607.000,00) | EUR      | 439.644,96          | (9.678,62)  | 429.966,34          | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                |          | <b>867.012,90</b>   | <b>(14.232,41)</b>                                  | <b>852.780,49</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |              |                 |                |          |                     |   |                     |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (908.000,00)   | USD      | 64.146,51           | 9.934,95  | 74.081,46           | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                |          | <b>64.146,51</b>    | <b>9.934,95</b>                                     | <b>74.081,46</b>    |             |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>     |              |                 |                |          |                     |   |                     |             |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.120.000,00) | EUR      | 136.441,13          | (2.933,42)  | 133.507,71          | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                |          | <b>136.441,13</b>   | <b>(2.933,42)</b>                                   | <b>133.507,71</b>   |             |
|  |              |                 |                |          | <b>7.811.209,19</b> | <b>178.739,12</b>                                   | <b>7.989.948,31</b> |             |

## Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Falligkeit | Wahrung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) |
|--|-------------|----------|-------------------------------|---------------------------|--|---|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |             |          |                               |                           |  |   |
| AMSTERDAM IDX FUT 1/2022               | 21.01.2022  | EUR      | 81,00                         | 12.941.370,00             | (19.440,00)  | 277.048,96  |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022  | AUD      | 70,00                         | 6.879.250,00              | (22.480,14)  | 11.080,63   |
| CAC40 10 EURO FUT 1/2022               | 21.01.2022  | EUR      | (77,00)                       | (5.506.655,00)            | 10.010,00  | (189.805,00)  |
| CAC40 10 EURO FUT 1/2022               | 21.01.2022  | EUR      | 70,00                         | 5.006.050,00              | (9.100,00)   | 172.550,00  |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022  | CAD      | (157,00)                      | (22.333.250,00)           | 13.082,35  | (387.393,88)  |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022  | CAD      | 14,00                         | 1.991.500,00              | (1.166,58)   | 33.073,19   |
| CBOE VIX FUTURE 1/2022                 | 19.01.2022  | USD      | 23,00                         | 457.700,00                | (891,45)   | (149.997,77)  |
| DAX INDEX FUTURE 3/2022                | 18.03.2022  | EUR      | (21,00)                       | (8.312.850,00)            | 11.550,00  | (135.450,00)  |
| DAX INDEX FUTURE 3/2022                | 18.03.2022  | EUR      | 16,00                         | 6.333.600,00              | (8.800,00)   | 103.200,00  |
| DJIA MINI e-CBOT 3/2022                | 18.03.2022  | USD      | 110,00                        | 19.932.550,00             | (24.279,34)  | 201.730,19  |
| DJIA MINI e-CBOT 3/2022                | 18.03.2022  | USD      | (58,00)                       | (10.509.890,00)           | 12.801,84  | (106.366,84)  |
| E-Mini Russ 2000 3/2022                | 18.03.2022  | USD      | 83,00                         | 9.353.270,00              | 25.281,42  | 140.109,11  |
| E-Mini Russ 2000 3/2022                | 18.03.2022  | USD      | (99,00)                       | (11.156.310,00)           | (30.154,95)  | (164.552,09)  |
| EURO STOXX 50 3/2022                   | 18.03.2022  | EUR      | (903,00)                      | (38.648.400,00)           | 67.725,00  | (849.390,33)  |
| EURO STOXX 50 3/2022                   | 18.03.2022  | EUR      | 235,00                        | 10.058.000,00             | (17.625,00)  | 211.774,65  |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | 265,00                        | 45.413.050,00             | 0,00   | (806.693,05)  |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | (120,00)                      | (20.564.400,00)           | 0,00   | 353.947,03  |
| FTSE 100 IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022  | GBP      | 247,00                        | 18.121.155,00             | (35.283,28)  | 434.705,98  |
| FTSE 100 IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022  | GBP      | (173,00)                      | (12.692.145,00)           | 24.712,58  | (304.418,31)  |
| FTSE/MIB IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022  | EUR      | (68,00)                       | (9.237.800,00)            | 26.520,00  | (162.520,00)  |
| HANG SENG IDX FUT 1/2022               | 28.01.2022  | HKD      | (96,00)                       | (112.564.800,00)          | (167.901,25)   | 29.280,64   |
| HANG SENG IDX FUT 1/2022               | 28.01.2022  | HKD      | 16,00                         | 18.760.800,00             | 27.983,54  | (4.880,11)  |
| HSCFI Futures 1/2022                   | 28.01.2022  | HKD      | (206,00)                      | (85.150.100,00)           | (169.067,23)   | 114.370,59  |
| HSCFI Futures 1/2022                   | 28.01.2022  | HKD      | 20,00                         | 8.267.000,00              | 16.414,29  | (11.103,93)   |
| IBEX 35 INDX FUTR 1/2022               | 21.01.2022  | EUR      | (138,00)                      | (11.960.460,00)           | 24.012,00  | (473.128,16)  |
| JPN 10Y BOND(OSE) 3/2022               | 22.03.2022  | JPY      | (4,00)                        | (606.720.000,00)          | (2.760,57)   | 11.141,77   |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022  | GBP      | (36,00)                       | (4.497.480,00)            | (6.428,13)   | (1.286,25)  |
| MSCI EmgMkt 3/2022                     | 18.03.2022  | USD      | (281,00)                      | (17.343.320,00)           | (13.644,99)  | 5.530,51  |
| MSCI EmgMkt 3/2022                     | 18.03.2022  | USD      | 84,00                         | 5.184.480,00              | 4.078,93   | (5.021,17)  |
| NASDAQ 100 E-MINI 3/2022               | 18.03.2022  | USD      | 46,00                         | 15.084.780,00             | (27.413,59)  | 79.468,93   |
| NASDAQ 100 E-MINI 3/2022               | 18.03.2022  | USD      | (12,00)                       | (3.935.160,00)            | 7.151,37   | (20.731,02)   |
| NIKKEI 225 MINI 3/2022                 | 11.03.2022  | JPY      | (849,00)                      | (2.448.516.000,00)        | (39.062,12)  | (239.557,50)  |
| NIKKEI 225 MINI 3/2022                 | 11.03.2022  | JPY      | 725,00                        | 2.090.900.000,00          | 33.356,93  | 186.311,24  |
| OMXS30 IND FUTURE 1/2022               | 21.01.2022  | SEK      | 363,00                        | 87.982.125,00             | 15.933,81  | 391.971,71  |
| OMXS30 IND FUTURE 1/2022               | 21.01.2022  | SEK      | (331,00)                      | (80.226.125,00)           | (14.529,18)  | (357.417,71)  |
| S&P MID 400 EMINI 3/2022               | 18.03.2022  | USD      | (22,00)                       | (6.249.760,00)            | (8.157,86)   | (120.568,90)  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

| Beschreibung             | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>vom 30.12.2021 bis 31.12.2021<br>in der Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (EUR) |
|--------------------------|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| S&P MID 400 EMINI 3/2022 | 18.03.2022 | USD     | 11,00                                | 3.124.880,00                | 4.078,93  | 60.284,44  |
| S&P/TSX 60 IX FUT 3/2022 | 18.03.2022 | CAD     | (51,00)                              | (13.085.580,00)             | 21.956,69   | (187.969,79)   |
| S&P/TSX 60 IX FUT 3/2022 | 18.03.2022 | CAD     | 29,00                                | 7.440.820,00                | (12.485,18)   | 106.884,83   |
| S&P500 EMINI FUT 3/2022  | 18.03.2022 | USD     | (1.004,00)                           | (239.303.400,00)            | 232.684,41  | (3.269.729,34)   |
| S&P500 EMINI FUT 3/2022  | 18.03.2022 | USD     | 462,00                               | 110.117.700,00              | (107.071,91)  | 1.280.402,05   |
| SPI 200 FUTURES 3/2022   | 17.03.2022 | AUD     | (161,00)                             | (29.579.725,00)             | 221.491,38  | (412.355,92)   |
| SPI 200 FUTURES 3/2022   | 17.03.2022 | AUD     | 41,00                                | 7.532.725,00                | (56.404,64)   | 104.270,17   |
| SWISS MKT IX FUTR 3/2022 | 18.03.2022 | CHF     | 78,00                                | 9.974.640,00                | (7.551,41)  | 266.825,53   |
| SWISS MKT IX FUTR 3/2022 | 18.03.2022 | CHF     | (62,00)                              | (7.928.560,00)              | 6.002,40  | (212.092,11)   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022 | 31.03.2022 | USD     | 1.193,00                             | 155.574.656,25              | 0,00  | 1.121.421,02   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022 | 31.03.2022 | USD     | (298,00)                             | (38.861.062,50)             | 0,00  | (179.789,79)   |
|                          |            |         |                                      |                             | <b>5.129,07</b>   | <b>(3.054.835,80)</b>  |

### FX-Optionen (OTC)

| Beschreibung                           | Kauf/<br>Verkauf | Put/Call | Strike | Laufzeit   | Währung | Erworbener/<br>(veräußerter)<br>Betrag in Währung | Verpflichtung* in<br>der Basiswährung<br>des Teilfonds (EUR) | Marktwert in der<br>Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) |
|--|------------------|----------|--------|------------|---------|---|--|---|
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>       |                  |          |        |            |         |   |  |   |
| FXO USD/CAD with delta 25 and 20220429 | Kauf             | Call     | 1,285  | 29.04.2022 | USD     | 678.983,00  | -  | 6.398,74  |
|  |                  |          |        |            | CAD     | (872.493,16)                                      | -  | -   |
| FXO USD/CAD Delta 25 End 20220527      | Kauf             | Call     | 1,276  | 27.05.2022 | USD     | 312.267,00  | -  | 4.144,54  |
|  |                  |          |        |            | CAD     | (398.452,69)                                      | -  | -   |
| FXO AUD/USD Delta 25 End 20220325      | Kauf             | Put      | 0,7227 | 25.03.2022 | AUD     | 339.839,00  | -  | 3.023,60  |
|  |                  |          |        |            | USD     | (245.601,65)                                      | -  | -   |
| FXO USD/CAD Delta 25 End 20220906      | Kauf             | Call     | 1,3242 | 06.09.2022 | USD     | 627.482,00  | -  | 5.447,58  |
|  |                  |          |        |            | CAD     | (830.911,66)                                      | -  | -   |
|  |                  |          |        |            |         |   |  | <b>19.014,46</b>  |

(\*) Bei gekauften Optionen muss keine Verpflichtung ausgewiesen werden. Dies gilt lediglich für verkaufte (geschriebene) Optionen.

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 3.440.000,00 EUR gezahlt.  
 BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 480.000,00 EUR gezahlt.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 430.000,00 EUR gezahlt.  
 Deutsche Bank AG hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 2.340.000,00 EUR gezahlt.  
 Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 900.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal      | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|-------------------------|--------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                         |              |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                         |              |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                         |              |                            |                              |
| 90.000.000,00   | Bundesobligation 0.000000% 13-10-2023              | 91.135.800,00              | 1,79                         |                         |              |                            |                              |
| 90.000.000,00   | Bundesobligation 0.000000% 14-04-2023              | 90.793.800,00              | 1,78                         |                         |              |                            |                              |
| 115.001.000,00  | Bundesrepublik Deutschland B 1.5% 04-09-2022       | 116.769.899,38             | 2,29                         |                         |              |                            |                              |
| 61.001.000,00   | Bundesrepublik Deutschland B 1.5% 15-02-2023       | 62.539.445,22              | 1,23                         |                         |              |                            |                              |
| 138.001.000,00  | Bundesrepublik Deutschland B 1.75% 04-07-2022      | 139.750.024,67             | 2,74                         |                         |              |                            |                              |
| 135.001.000,00  | Bundesrepublik Deutschland B 2% 04-01-2022         | 135.001.000,00             | 2,65                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>635.989.969,27</b>      | <b>12,49</b>                 |                         |              |                            |                              |
| <b>GBP</b>  |  |                            |                              |                         |              |                            |                              |
| 17.250.000,00   | United Kingdom Gilt 0.125% 31-01-2023              | 20.446.618,66              | 0,40                         |                         |              |                            |                              |
| 20.000.000,00   | United Kingdom Gilt 0.125% 31-01-2024              | 23.535.245,83              | 0,46                         |                         |              |                            |                              |
| 17.250.000,00   | United Kingdom Gilt 0.75% 22-07-2023               | 20.609.274,96              | 0,40                         |                         |              |                            |                              |
| 33.750.000,00   | United Kingdom Gilt 1.75% 07-09-2022               | 40.576.116,30              | 0,80                         |                         |              |                            |                              |
| 67.500.000,00   | United Kingdom Gilt 4% 07-03-2022                  | 80.900.635,65              | 1,59                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>186.067.891,40</b>      | <b>3,65</b>                  |                         |              |                            |                              |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              |                         |              |                            |                              |
| 50.000.000,00   | United States Treasury Note/ 0.125% 30-09-2022     | 44.094.256,44              | 0,87                         |                         |              |                            |                              |
| 55.000.000,00   | United States Treasury Note/ 0.125% 31-07-2022     | 48.528.340,67              | 0,95                         |                         |              |                            |                              |
| 50.000.000,00   | United States Treasury Note/ 0.125% 31-08-2022     | 44.106.327,24              | 0,87                         |                         |              |                            |                              |
| 55.000.000,00   | United States Treasury Note/ 0.375% 31-03-2022     | 48.592.214,77              | 0,95                         |                         |              |                            |                              |
| 55.000.000,00   | United States Treasury Note/ 1.125% 28-02-2022     | 48.639.421,10              | 0,95                         |                         |              |                            |                              |
| 50.000.000,00   | United States Treasury Note/ 1.75% 15-05-2022      | 44.402.921,51              | 0,87                         |                         |              |                            |                              |
| 50.000.000,00   | United States Treasury Note/ 1.875% 31-01-2022     | 44.203.986,72              | 0,87                         |                         |              |                            |                              |
| 40.000.000,00   | United States Treasury Note/ 2% 30-11-2022         | 35.838.244,51              | 0,70                         |                         |              |                            |                              |
| 40.000.000,00   | United States Treasury Note/ 2% 31-10-2022         | 35.800.997,70              | 0,70                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>394.206.710,66</b>      | <b>7,74</b>                  |                         |              |                            |                              |
| <b>Summe Anleihen</b>   |  |                            |                              | <b>1.216.264.571,33</b> | <b>23,88</b> |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |  |                            |                              |                         |              |                            |                              |
| <b>BRL</b>  |  |                            |                              |                         |              |                            |                              |
| 498.171,00  | Banco Bradesco                                     | 1.516.892,78               | 0,03                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>1.516.892,78</b>        | <b>0,03</b>                  |                         |              |                            |                              |
| <b>CAD</b>  |  |                            |                              |                         |              |                            |                              |
| 428.500,00  | Bank of Nova Scotia/The                            | 26.716.759,54              | 0,52                         |                         |              |                            |                              |
| 319.600,00  | Royal Bank of Canada                               | 29.780.494,68              | 0,58                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>56.497.254,22</b>       | <b>1,11</b>                  |                         |              |                            |                              |
| <b>CHF</b>  |  |                            |                              |                         |              |                            |                              |
| 436.514,00  | Nestle   | 53.856.383,00              | 1,06                         |                         |              |                            |                              |
| 144.735,00  | Roche Holding                                      | 53.120.309,02              | 1,04                         |                         |              |                            |                              |
| 17.490,00   | Sonova Holding                                     | 6.058.475,96               | 0,12                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>113.035.167,98</b>      | <b>2,22</b>                  |                         |              |                            |                              |
| <b>DKK</b>  |  |                            |                              |                         |              |                            |                              |
| 1.302.471,00  | Novo Nordisk B                                     | 128.735.543,92             | 2,53                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>128.735.543,92</b>      | <b>2,53</b>                  |                         |              |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                         |              |                            |                              |
| 86.636,00   | Allianz  | 17.989.965,40              | 0,35                         |                         |              |                            |                              |
| 347.268,00  | Deutsche Post                                      | 19.634.532,72              | 0,39                         |                         |              |                            |                              |
| 504.810,00  | Iberdrola  | 5.255.072,10               | 0,10                         |                         |              |                            |                              |
| 91.766,00   | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in M | 23.905.043,00              | 0,47                         |                         |              |                            |                              |
| 74.778,00   | Prosus   | 5.498.426,34               | 0,11                         |                         |              |                            |                              |
| 311.522,00  | Sanofi   | 27.594.618,76              | 0,54                         |                         |              |                            |                              |
| 141.702,00  | Siemens  | 21.635.061,36              | 0,42                         |                         |              |                            |                              |
| 394.382,00  | Unilever   | 18.557.645,01              | 0,36                         |                         |              |                            |                              |
| 324.753,00  | Vinci  | 30.172.801,23              | 0,59                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>170.243.165,92</b>      | <b>3,34</b>                  |                         |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>GBP</b>              |              |                            |                              |
| 53.077,00   | National Grid                                      | 669.608,71                 | 0,01                         |                         |              |                            |                              |
| 368.148,00  | Rightmove  | 3.484.017,92               | 0,07                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>4.153.626,63</b>        | <b>0,08</b>                  |                         |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>HKD</b>              |              |                            |                              |
| 1.973.000,00  | China Communications Construction                  | 946.993,85                 | 0,02                         |                         |              |                            |                              |
| 8.568.000,00  | China Construction Bank                            | 5.237.540,96               | 0,10                         |                         |              |                            |                              |
| 2.735.986,00  | China Everbright Environment Group                 | 1.938.842,00               | 0,04                         |                         |              |                            |                              |
| 1.033.200,00  | China Gas Holdings                                 | 1.894.757,47               | 0,04                         |                         |              |                            |                              |
| 575.000,00  | China Longyuan Power Group                         | 1.184.659,24               | 0,02                         |                         |              |                            |                              |
| 1.067.000,00  | China Mobile                                       | 5.652.811,29               | 0,11                         |                         |              |                            |                              |
| 2.158.500,00  | China Overseas Land & Investment                   | 4.510.637,90               | 0,09                         |                         |              |                            |                              |
| 1.028.000,00  | China Railway Construction                         | 593.495,60                 | 0,01                         |                         |              |                            |                              |
| 766.000,00  | China Resources Land                               | 2.844.178,36               | 0,06                         |                         |              |                            |                              |
| 7.680.000,00  | China Telecom                                      | 2.260.418,14               | 0,04                         |                         |              |                            |                              |
| 1.983.000,00  | CRRC   | 752.006,75                 | 0,01                         |                         |              |                            |                              |
| 2.600,00  | ENN Energy Holdings                                | 43.206,95                  | 0,00                         |                         |              |                            |                              |
| 448.000,00  | Hengan International Group                         | 2.036.187,55               | 0,04                         |                         |              |                            |                              |
| 10.164.000,00   | Industrial & Commercial Bank of China              | 5.062.575,90               | 0,10                         |                         |              |                            |                              |
| 1.176.000,00  | Ping An Insurance Group Co of China                | 7.475.001,73               | 0,15                         |                         |              |                            |                              |
| 2.139.600,00  | Sinopharm Group                                    | 4.107.831,80               | 0,08                         |                         |              |                            |                              |
| 308.000,00  | Techtronic Industries                              | 5.411.238,16               | 0,11                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>51.952.383,65</b>       | <b>1,02</b>                  |                         |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>IDR</b>              |              |                            |                              |
| 32.360.400,00   | Telkom Indonesia Persero                           | 8.099.096,19               | 0,16                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>8.099.096,19</b>        | <b>0,16</b>                  |                         |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>INR</b>              |              |                            |                              |
| 143.317,00  | Axis Bank  | 1.155.012,50               | 0,02                         |                         |              |                            |                              |
| 495.090,00  | HCL Technologies                                   | 7.756.557,15               | 0,15                         |                         |              |                            |                              |
| 611.536,00  | Infosys  | 13.711.142,02              | 0,27                         |                         |              |                            |                              |
| 2.043.521,00  | Power Grid Corp of India                           | 4.960.975,92               | 0,10                         |                         |              |                            |                              |
| 591.723,00  | UPL  | 5.250.544,08               | 0,10                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>32.834.231,67</b>       | <b>0,64</b>                  |                         |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>JPY</b>              |              |                            |                              |
| 147.600,00  | Hoya   | 19.365.699,86              | 0,38                         |                         |              |                            |                              |
| 1.018.800,00  | KDDI   | 26.265.367,09              | 0,52                         |                         |              |                            |                              |
| 1.199.200,00  | Nippon Telegraph & Telephone                       | 28.966.698,78              | 0,57                         |                         |              |                            |                              |
| 235.600,00  | Seven & i Holdings                                 | 9.134.382,24               | 0,18                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>83.732.147,97</b>       | <b>1,64</b>                  |                         |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>KRW</b>              |              |                            |                              |
| 52.966,00   | BNK Financial Group                                | 330.437,92                 | 0,01                         |                         |              |                            |                              |
| 28.618,00   | Hyundai Glovis                                     | 3.570.770,88               | 0,07                         |                         |              |                            |                              |
| 17.787,00   | Hyundai Mobis                                      | 3.362.048,05               | 0,07                         |                         |              |                            |                              |
| 18.690,00   | LG   | 1.122.978,00               | 0,02                         |                         |              |                            |                              |
| 9.063,00  | LX Holdings  | 67.310,90                  | 0,00                         |                         |              |                            |                              |
| 195.438,00  | Samsung Electronics                                | 11.365.386,14              | 0,22                         |                         |              |                            |                              |
| 32.516,00   | Samsung Fire & Marine Insurance                    | 4.878.225,91               | 0,10                         |                         |              |                            |                              |
| 127.961,00  | SK Square  | 6.310.432,54               | 0,12                         |                         |              |                            |                              |
| 125.784,00  | SK Telecom   | 5.409.005,08               | 0,11                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>36.416.595,42</b>       | <b>0,71</b>                  |                         |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>MXN</b>              |              |                            |                              |
| 196.400,00  | Grupo Financiero Banorte                           | 1.135.209,07               | 0,02                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>1.135.209,07</b>        | <b>0,02</b>                  |                         |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>PHP</b>              |              |                            |                              |
| 15.640,00   | PLDT   | 490.673,79                 | 0,01                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>490.673,79</b>          | <b>0,01</b>                  |                         |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>THB</b>              |              |                            |                              |
| 325.800,00  | Advanced Info Service                              | 1.980.485,39               | 0,04                         |                         |              |                            |                              |
| 501.700,00  | Bangkok Bank                                       | 1.611.065,16               | 0,03                         |                         |              |                            |                              |
| 32.500,00   | Bangkok Bank                                       | 104.364,40                 | 0,00                         |                         |              |                            |                              |
| 1.545.000,00  | Thai Union Group                                   | 796.261,69                 | 0,02                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>4.492.176,64</b>        | <b>0,09</b>                  |                         |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>TRY</b>              |              |                            |                              |
| 3.556.753,00  | Akbank TAS   | 1.673.406,69               | 0,03                         |                         |              |                            |                              |
| 158.619,00  | BIM Birlesik Magazalar                             | 640.116,41                 | 0,01                         |                         |              |                            |                              |
| 2.054.660,00  | Turkcell Iletisim Hizmetleri                       | 2.417.402,09               | 0,05                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>4.730.925,19</b>        | <b>0,09</b>                  |                         |              |                            |                              |
|   |  |                            |                              | <b>TWD</b>              |              |                            |                              |
| 619.000,00  | Taiwan Semiconductor Manufacturing                 | 12.148.088,52              | 0,24                         |                         |              |                            |                              |
|   |  | <b>12.148.088,52</b>       | <b>0,24</b>                  |                         |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.





# Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| USA                    | 45,23        | Staatsanleihen                                      | 23,88        |
| Deutschland            | 14,12        | Pharmazeutika                                       | 8,32         |
| Vereinigtes Königreich | 4,10         | Alkoholfreie Getränke                               | 4,77         |
| Dänemark               | 2,53         | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 4,40         |
| Schweiz                | 2,45         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 2,59         |
| Japan                  | 1,64         | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  | 2,07         |
| Irland                 | 1,39         | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 1,71         |
| Frankreich             | 1,13         | Haushaltsprodukte                                   | 1,64         |
| Kanada                 | 1,11         | Systemsoftware                                      | 1,64         |
| Republik Korea         | 0,73         | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 1,59         |
| Indien                 | 0,72         | Verschiedene Banken                                 | 1,51         |
| China                  | 0,67         | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen           | 1,48         |
| Hongkong               | 0,34         | Gesundheitswesen: Managed Health Care               | 1,46         |
| Taiwan, Provinz Chinas | 0,24         | Kommunikationsanlagen                               | 1,29         |
| Kaimaninseln           | 0,22         | Kabel und Satellitenübertragung                     | 1,27         |
| Israel                 | 0,17         | Halbleiter  | 1,20         |
| Indonesien             | 0,16         | Integrierte Telekommunikationsdienste               | 1,16         |
| Südafrika              | 0,15         | Restaurants   | 1,10         |
| Niederlande            | 0,11         | Schuhe  | 1,08         |
| Spanien                | 0,10         | Internet-Dienste und -Infrastruktur                 | 0,88         |
| Thailand               | 0,09         | Drahtlose Telekommunikationsdienste                 | 0,85         |
| Türkei                 | 0,09         | Kraftfahrzeugeinzelhandel                           | 0,83         |
| Brasilien              | 0,06         | Luftfracht und Logistik                             | 0,74         |
| Bermuda                | 0,04         | Mehrsparren-Versorger                               | 0,74         |
| Mexiko                 | 0,02         | Bau- und Ingenieurwesen                             | 0,62         |
| Philippinen            | 0,01         | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 0,61         |
| <b>Summe</b>           | <b>77,64</b> | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 0,53         |
|                        |              | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie    | 0,49         |
|                        |              | Großmärkte  | 0,47         |
|                        |              | Rückversicherungen                                  | 0,47         |
|                        |              | Biotechnologie                                      | 0,46         |
|                        |              | Industriekonglomerate                               | 0,45         |
|                        |              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 0,42         |
|                        |              | Warenhäuser   | 0,42         |
|                        |              | Bekleidung-Einzelhandel                             | 0,39         |
|                        |              | Versicherungsmakler                                 | 0,39         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Produkte                          | 0,38         |
|                        |              | Mehrsparrenversicherungen                           | 0,35         |
|                        |              | Handelsgesellschaften und Großhändler               | 0,35         |
|                        |              | Sach- und Unfallversicherung                        | 0,33         |
|                        |              | Landwirtschaftliche Produkte                        | 0,30         |
|                        |              | Anwendungssoftware                                  | 0,27         |
|                        |              | Landwirtschafts- und Landmaschinen                  | 0,25         |
|                        |              | Stromversorger                                      | 0,20         |
|                        |              | Lebensmitteleinzelhandel                            | 0,19         |
|                        |              | Lebens- und Krankenversicherung                     | 0,17         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Technologie                       | 0,16         |
|                        |              | Immobilienentwicklung                               | 0,14         |
|                        |              | Vermögensverwaltung und Depotbanken                 | 0,13         |
|                        |              | Industriemaschinen                                  | 0,11         |
|                        |              | Dünger und Chemikalien für die Landwirtschaft       | 0,10         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Vertrieb                          | 0,08         |
|                        |              | Autoteile und -zubehör                              | 0,07         |
|                        |              | Gasversorger  | 0,04         |
|                        |              | Einzelhandel: Heimwerker und Garten                 | 0,03         |
|                        |              | Wasserversorger                                     | 0,03         |
|                        |              | Erneuerbare Elektrizität                            | 0,02         |
|                        |              | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 0,01         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 0,01         |
|                        |              | Freizeiteinrichtungen                               | 0,01         |
|                        |              | Regionale Banken                                    | 0,01         |
|                        |              | <b>Summe</b>  | <b>77,64</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 175.051.490,99                                    | CHF                | 166.989.971,21    | EUR                  | 2.510.402,20  | 28.01.2022  |
| 5.745.481,81                                      | EUR                | 6.000.572,59      | CHF                  | (64.793,63)   | 28.01.2022  |
| 6.933.596,23                                      | EUR                | 5.879.889,91      | GBP                  | (61.561,79)   | 28.01.2022  |
| 1.416.648,68                                      | EUR                | 182.407.891,00    | JPY                  | 18.403,70   | 28.01.2022  |
| 579.133,29  | EUR                | 5.891.431,39      | NOK                  | (10.338,23)   | 28.01.2022  |
| 111,57  | EUR                | 523,74            | PLN                  | (2,10)  | 28.01.2022  |
| 312.640.810,04                                    | EUR                | 3.215.173.549,78  | SEK                  | (873.429,38)  | 28.01.2022  |
| 468.502,37  | EUR                | 723.690,00        | SGD                  | (4.586,54)  | 28.01.2022  |
| 8.873.995,07                                      | EUR                | 10.058.495,09     | USD                  | (1.581,32)  | 28.01.2022  |
| 267.659.768,32                                    | GBP                | 317.282.853,34    | EUR                  | 1.144.428,14  | 28.01.2022  |
| 12.702.293.375,00                                 | JPY                | 98.203.231,52     | EUR                  | (833.759,93)  | 28.01.2022  |
| 373.199.929,12                                    | NOK                | 36.971.851,41     | EUR                  | 368.795,71  | 28.01.2022  |
| 33.786,65   | PLN                | 7.137,31          | EUR                  | 196,01  | 28.01.2022  |
| 13.525.434.612,21                                 | SEK                | 1.330.118.023,20  | EUR                  | (11.249.345,90)   | 28.01.2022  |
| 51.263.366,96                                     | SGD                | 33.266.116,97     | EUR                  | 245.610,00  | 28.01.2022  |
| 279.621.894,69                                    | USD                | 248.169.117,50    | EUR                  | (1.432.620,96)  | 28.01.2022  |
| 92.559.180,16                                     | BRL                | 14.505.467,11     | EUR                  | 46.664,00   | 31.01.2022  |
| 700.000,00  | EUR                | 4.531.739,00      | BRL                  | (12.483,96)   | 31.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(10.210.003,98)</b>  |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 4.407.000,00                                      | GBP                | 51.262.880,64     | NOK                  | 112.756,85  | 14.01.2022  |
| 16.341.567.900,00                                 | KRW                | 13.705.000,00     | USD                  | 15.502,01   | 14.01.2022  |
| 13.597.000,00                                     | USD                | 16.085.930.850,00 | KRW                  | 78.669,81   | 14.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>206.928,67</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 7.524.038,29                                      | AUD                | 4.783.000,00      | EUR                  | 30.254,69   | 14.01.2022  |
| 136.532.000,00                                    | AUD                | 872.920.222,83    | SEK                  | 2.208.133,69  | 14.01.2022  |
| 9.461.000,00                                      | AUD                | 6.960.526,77      | USD                  | (91.321,28)   | 14.01.2022  |
| 38.964.544,41                                     | BRL                | 6.834.000,00      | USD                  | 119.888,61  | 14.01.2022  |
| 7.723.000,00                                      | CAD                | 52.765.024,99     | NOK                  | 79.167,66   | 14.01.2022  |
| 1.453.531.896,74                                  | CZK                | 57.056.000,00     | EUR                  | 1.290.432,97  | 14.01.2022  |
| 5.748.000,00                                      | EUR                | 2.066.335.558,26  | HUF                  | 160.226,52  | 14.01.2022  |
| 40.749.000,00                                     | EUR                | 188.046.038,28    | PLN                  | (118.037,65)  | 14.01.2022  |
| 22.039.000,00                                     | EUR                | 227.270.863,17    | SEK                  | (126.294,76)  | 14.01.2022  |
| 235.439.962,19                                    | EUR                | 374.509.074,00    | SGD                  | (9.474.032,15)  | 14.01.2022  |
| 6.388.771,20                                      | GBP                | 7.512.000,00      | EUR                  | 90.875,54   | 14.01.2022  |
| 22.887.000,00                                     | GBP                | 3.504.826.749,00  | JPY                  | 365.312,78  | 14.01.2022  |
| 13.422.280.396,47                                 | HUF                | 38.164.746,78     | EUR                  | (1.868.500,62)  | 14.01.2022  |
| 1.531.526.750,00                                  | JPY                | 17.847.000,00     | CAD                  | (647.444,32)  | 14.01.2022  |
| 1.792.323.055,00                                  | JPY                | 13.908.738,83     | EUR                  | (167.259,39)  | 14.01.2022  |
| 986.729.000,00                                    | JPY                | 78.956.179,79     | SEK                  | (135.338,46)  | 14.01.2022  |
| 16.178.607.003,00                                 | KRW                | 13.677.000,00     | USD                  | (80.591,57)   | 14.01.2022  |
| 101.279.775,97                                    | MXN                | 4.888.000,00      | USD                  | 48.608,63   | 14.01.2022  |
| 105.716.729,88                                    | NOK                | 16.314.000,00     | AUD                  | 146.649,31  | 14.01.2022  |
| 143.568.019,65                                    | NOK                | 1.782.714.000,00  | JPY                  | 704.428,60  | 14.01.2022  |
| 184.358.347,47                                    | NOK                | 30.229.000,00     | NZD                  | 241.514,52  | 14.01.2022  |
| 1.051.552.000,00                                  | NOK                | 1.072.382.662,71  | SEK                  | 680.127,91  | 14.01.2022  |
| 16.276.237,34                                     | NZD                | 15.570.000,00     | AUD                  | (153.416,09)  | 14.01.2022  |
| 4.035.344,64                                      | NZD                | 2.448.000,00      | EUR                  | (16.568,57)   | 14.01.2022  |
| 4.355.000,00                                      | NZD                | 26.473.299,86     | NOK                  | (26.118,21)   | 14.01.2022  |
| 391.000,00  | NZD                | 274.893,96        | USD                  | (7.043,51)  | 14.01.2022  |
| 59.759.747,09                                     | PLN                | 12.905.000,00     | EUR                  | 82.277,03   | 14.01.2022  |
| 293.508.352,53                                    | SEK                | 42.372.000,00     | CAD                  | (789.385,10)  | 14.01.2022  |
| 14.482.195,09                                     | SGD                | 9.104.418,83      | EUR                  | 366.359,03  | 14.01.2022  |
| 5.693.487,99                                      | USD                | 7.939.000,00      | AUD                  | (53.409,27)   | 14.01.2022  |
| 17.925.528,37                                     | USD                | 15.405.000,00     | EUR                  | 416.922,69  | 14.01.2022  |
| 6.789.000,00                                      | USD                | 21.460.231,31     | ILS                  | (108.791,10)  | 14.01.2022  |
| 13.363.000,00                                     | USD                | 15.847.285.189,00 | KRW                  | 49.004,63   | 14.01.2022  |
| 19.304.000,00                                     | USD                | 402.690.814,07    | MXN                  | (308.752,65)  | 14.01.2022  |
| 19.086.626,54                                     | USD                | 26.605.000,00     | NZD                  | 816.419,57  | 14.01.2022  |
| 47.973.000,00                                     | USD                | 434.291.291,09    | SEK                  | (12.582,28)   | 14.01.2022  |
| 20.000.000,00                                     | USD                | 17.111.101,87     | EUR                  | 538.485,24  | 24.01.2022  |
| 27.546.155,59                                     | CHF                | 44.264.000,00     | NZD                  | 17.893,58   | 01.02.2022  |
| 77.083.000,00                                     | EUR                | 80.408.013,75     | CHF                  | (776.987,72)  | 01.02.2022  |
| 24.648.000,00                                     | EUR                | 252.066.040,32    | NOK                  | (569.096,56)  | 01.02.2022  |
| 9.783.000,00                                      | EUR                | 11.095.728,92     | USD                  | (7.030,09)  | 01.02.2022  |
| 4.320.343,96                                      | GBP                | 5.096.000,00      | EUR                  | 43.332,40   | 01.02.2022  |
| 3.069.833.882,00                                  | JPY                | 24.787.000,00     | CHF                  | (470.930,21)  | 01.02.2022  |
| 967.543.331,00                                    | JPY                | 12.054.000,00     | NZD                  | 157.693,55  | 01.02.2022  |
| 104.845.938,10                                    | NOK                | 1.336.017.000,00  | JPY                  | 248.193,79  | 01.02.2022  |
| 237.445.675,23                                    | NOK                | 26.236.000,00     | USD                  | 605.844,75  | 01.02.2022  |
| 7.555.000,00                                      | NZD                | 5.103.805,94      | USD                  | 46.341,93   | 01.02.2022  |
| 76.131.146,65                                     | SEK                | 8.005.000,00      | CHF                  | (328.203,83)  | 01.02.2022  |
| 36.124.701,36                                     | SEK                | 5.920.000,00      | NZD                  | (42.582,82)   | 01.02.2022  |
| 692.069.753,45                                    | SEK                | 76.460.000,00     | USD                  | 18.777,91   | 01.02.2022  |
| 175.240.000,00                                    | USD                | 19.958.289.369,00 | JPY                  | 1.636.102,46  | 01.02.2022  |
| 6.964.793,94                                      | EUR                | 7.900.000,00      | USD                  | (2.594,19)  | 22.02.2022  |
| 491.953.245,30                                    | INR                | 6.471.000,00      | USD                  | 87.784,81   | 22.02.2022  |
| 35.753.000,00                                     | USD                | 2.716.977.729,00  | INR                  | (471.827,78)  | 22.02.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                             | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| 32.364.181,17                                 | USD                | 38.534.583.514,00 | KRW                  | 32.301,52   | 22.02.2022  |
| 4.500.000,00                                  | AUD                | 2.883.791,84      | EUR                  | (7.385,15)  | 28.02.2022  |
| 21.674.646,37                                 | EUR                | 33.855.000,00     | AUD                  | 34.457,01   | 28.02.2022  |
| 108.970.620,93                                | EUR                | 114.290.000,00    | CHF                  | (1.714.539,72)  | 28.02.2022  |
| 358.095.346,59                                | EUR                | 404.493.500,00    | USD                  | 1.398.242,03  | 28.02.2022  |
| 12.978.197,75                                 | CAD                | 8.965.119,08      | EUR                  | 35.149,31   | 01.03.2022  |
| 8.430.000,00                                  | EUR                | 8.777.901,89      | CHF                  | (71.015,22)   | 01.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(5.849.875,60)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 9.478.000,00                                  | AUD                | 8.547.421,53      | CAD                  | 129.678,93  | 14.01.2022  |
| 9.191.539,50                                  | AUD                | 5.694.000,00      | EUR                  | 186.021,66  | 14.01.2022  |
| 15.296.231,81                                 | AUD                | 8.208.000,00      | GBP                  | 17.451,58   | 14.01.2022  |
| 18.575.000,00                                 | AUD                | 13.537.023,10     | USD                  | (65.632,77)   | 14.01.2022  |
| 75.391.194,23                                 | BRL                | 13.557.000,00     | USD                  | (63.013,87)   | 14.01.2022  |
| 13.645.183,78                                 | CAD                | 9.095.000,50      | EUR                  | 377.521,54  | 14.01.2022  |
| 23.362.000,00                                 | CAD                | 165.457.440,18    | NOK                  | (345.666,43)  | 14.01.2022  |
| 42.916.000,00                                 | CAD                | 302.763.839,72    | SEK                  | 264.224,09  | 14.01.2022  |
| 8.617.451,33                                  | CAD                | 6.932.000,00      | USD                  | (136.310,05)  | 14.01.2022  |
| 7.338.000,00                                  | EUR                | 11.761.948,12     | AUD                  | (186.353,01)  | 14.01.2022  |
| 188.918.940,83                                | EUR                | 283.151.524,73    | CAD                  | (7.645.535,01)  | 14.01.2022  |
| 121.215.886,32                                | EUR                | 104.060.444,36    | GBP                  | (2.620.208,20)  | 14.01.2022  |
| 14.775.000,00                                 | EUR                | 5.480.385.416,20  | HUF                  | (45.149,23)   | 14.01.2022  |
| 176.370.749,87                                | EUR                | 22.933.700.250,00 | JPY                  | 541.005,03  | 14.01.2022  |
| 17.941.884,31                                 | EUR                | 430.998.778,74    | MXN                  | (624.916,99)  | 14.01.2022  |
| 53.273.021,12                                 | EUR                | 242.147.190,22    | PLN                  | 648.675,33  | 14.01.2022  |
| 8.318.000,00                                  | GBP                | 14.260.770,15     | CAD                  | (1.063,53)  | 14.01.2022  |
| 2.248.418.838,40                              | HUF                | 6.118.000,00      | EUR                  | (37.802,88)   | 14.01.2022  |
| 121.709,45                                    | ILS                | 32.058,26         | EUR                  | 2.543,67  | 14.01.2022  |
| 20.834.869,28                                 | ILS                | 6.697.000,00      | USD                  | 12.182,64   | 14.01.2022  |
| 102.773.350.473,00                            | JPY                | 790.374.544,52    | EUR                  | (2.424.419,09)  | 14.01.2022  |
| 329.709.282,00                                | JPY                | 2.197.000,00      | GBP                  | (86.685,13)   | 14.01.2022  |
| 2.949.255.016,00                              | JPY                | 26.756.000,00     | USD                  | (1.004.635,75)  | 14.01.2022  |
| 8.134.529.550,00                              | KRW                | 6.845.000,00      | USD                  | (12.505,33)   | 14.01.2022  |
| 2.307.040.011,66                              | MXN                | 96.038.891,61     | EUR                  | 3.345.040,77  | 14.01.2022  |
| 96.080.582,92                                 | NOK                | 14.013.000,00     | CAD                  | (109.494,17)  | 14.01.2022  |
| 57.704.562,02                                 | NOK                | 9.673.000,00      | NZD                  | (51.728,09)   | 14.01.2022  |
| 9.494.880,21                                  | NZD                | 4.989.000,00      | GBP                  | (216.136,95)  | 14.01.2022  |
| 95.067.000,00                                 | NZD                | 7.474.091.486,00  | JPY                  | (21.775,58)   | 14.01.2022  |
| 13.103.000,00                                 | NZD                | 79.597.436,15     | NOK                  | (73.229,56)   | 14.01.2022  |
| 11.747.000,00                                 | NZD                | 71.274.030,68     | SEK                  | 126.798,66  | 14.01.2022  |
| 10.094.000,00                                 | NZD                | 6.818.070,02      | USD                  | 64.091,18   | 14.01.2022  |
| 89.909.907,95                                 | PLN                | 19.693.325,21     | EUR                  | (153.740,66)  | 14.01.2022  |
| 98.703.324,00                                 | SEK                | 11.342.000,00     | USD                  | (384.685,58)  | 14.01.2022  |
| 13.817.939,35                                 | USD                | 19.063.000,00     | AUD                  | 1.383,30  | 14.01.2022  |
| 6.733.000,00                                  | USD                | 38.864.922,83     | BRL                  | (193.324,91)  | 14.01.2022  |
| 418.000,00                                    | USD                | 540.897,94        | CAD                  | (6.546,44)  | 14.01.2022  |
| 15.977.433,12                                 | USD                | 13.778.000,00     | EUR                  | 324.429,21  | 14.01.2022  |
| 25.599.000,00                                 | USD                | 535.453.035,56    | MXN                  | (471.720,28)  | 14.01.2022  |
| 22.460,80                                     | USD                | 32.000,00         | NZD                  | 543,86  | 14.01.2022  |
| 2.217.637.704,00                              | ZAR                | 130.295.987,31    | EUR                  | (7.816.702,22)  | 14.01.2022  |
| 43.527.673,17                                 | EUR                | 51.000.000,00     | USD                  | (1.478.820,37)  | 24.01.2022  |
| 19.857.000,00                                 | AUD                | 18.079.778,64     | CAD                  | 152.908,64  | 01.02.2022  |
| 30.294.000,00                                 | AUD                | 21.656.814,04     | USD                  | 265.496,88  | 01.02.2022  |
| 2.690.261,59                                  | CAD                | 2.917.000,00      | AUD                  | 1.378,60  | 01.02.2022  |
| 46.448.233,69                                 | CAD                | 32.258.854,12     | EUR                  | (26.896,92)   | 01.02.2022  |
| 15.563.000,00                                 | CHF                | 1.916.146.206,00  | JPY                  | 382.416,62  | 01.02.2022  |
| 9.421.000,00                                  | CHF                | 93.013.419,95     | SEK                  | 53.032,42   | 01.02.2022  |
| 10.045.000,00                                 | EUR                | 15.718.124,70     | AUD                  | (7.082,41)  | 01.02.2022  |
| 303.550.270,17                                | EUR                | 437.069.892,00    | CAD                  | 253.095,40  | 01.02.2022  |
| 184.053.663,32                                | EUR                | 155.911.157,63    | GBP                  | (1.412.791,82)  | 01.02.2022  |
| 230.124.506,87                                | EUR                | 2.252.286.079,86  | NOK                  | 4.807.971,24  | 01.02.2022  |
| 977.000,00                                    | GBP                | 146.710.619,00    | JPY                  | 37.663,01   | 01.02.2022  |
| 33.562.262.904,00                             | JPY                | 252.954.551,92    | EUR                  | 4.307.774,40  | 01.02.2022  |
| 21.650.741,87                                 | NOK                | 3.047.000,00      | CAD                  | 51.562,43   | 01.02.2022  |
| 229.026.218,69                                | NOK                | 23.400.466,80     | EUR                  | (488.903,91)  | 01.02.2022  |
| 16.574.711,14                                 | NOK                | 1.952.000,00      | USD                  | (64.194,89)   | 01.02.2022  |
| 391.691.713,62                                | SEK                | 4.904.822.000,00  | JPY                  | 596.611,56  | 01.02.2022  |
| 12.357.000,00                                 | USD                | 112.264.160,56    | SEK                  | (43.626,97)   | 01.02.2022  |
| 45.159.178.319,00                             | CLP                | 55.051.281,22     | USD                  | (2.185.569,71)  | 22.02.2022  |
| 137.225.925,30                                | EUR                | 156.050.000,00    | USD                  | (402.382,79)  | 22.02.2022  |
| 7.823.841.763,80                              | INR                | 104.052.902,13    | USD                  | 389.342,73  | 22.02.2022  |
| 9.854.330.038,80                              | RUB                | 129.499.437,84    | USD                  | 353.821,49  | 22.02.2022  |
| 58.948.446,06                                 | SGD                | 43.028.000,00     | USD                  | 562.460,23  | 22.02.2022  |
| 7.600.000,00                                  | USD                | 6.732.804,06      | EUR                  | (30.032,13)   | 22.02.2022  |
| 11.362.772,93                                 | USD                | 854.378.259,30    | INR                  | (42.516,96)   | 22.02.2022  |
| 37.268.982,94                                 | USD                | 2.840.183.471,00  | RUB                  | (150.465,39)  | 22.02.2022  |
| 5.300.000,00                                  | AUD                | 3.355.317,79      | EUR                  | 32.495,00   | 28.02.2022  |
| 108.100.000,00                                | DKK                | 14.534.093,73     | EUR                  | 3.280,69  | 28.02.2022  |
| 4.519.287,29                                  | EUR                | 7.100.000,00      | AUD                  | (19.076,76)   | 28.02.2022  |
| 4.166.707,18                                  | EUR                | 6.000.000,00      | CAD                  | 5.687,07  | 28.02.2022  |
| 209.730.885,55                                | EUR                | 176.978.891,00    | GBP                  | (647.259,75)  | 28.02.2022  |
| 9.619.392,74                                  | EUR                | 97.545.000,00     | SEK                  | 111.499,84  | 28.02.2022  |
| 26.422.119,96                                 | EUR                | 30.000.000,00     | USD                  | (33.122,14)   | 28.02.2022  |
| 4.610.794,16                                  | CAD                | 3.165.000,00      | EUR                  | 32.568,31   | 01.03.2022  |
| 15.550.658,07                                 | CHF                | 14.935.510,68     | EUR                  | 124.622,26  | 01.03.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                                | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|--|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| 8.047.646,95                                     | EUR                | 8.379.104,58      | CHF                  | (67.149,77)   | 01.03.2022  |
| 5.515.837,38                                     | EUR                | 709.584.844,00    | JPY                  | 78.802,95   | 01.03.2022  |
| 12.042.081,17                                    | EUR                | 297.191.470,59    | MXN                  | (645.150,92)  | 01.03.2022  |
| 156.363,02                                       | EUR                | 1.606.857,12      | NOK                  | (4.214,99)  | 01.03.2022  |
| 6.118.000,00                                     | EUR                | 6.935.430,26      | USD                  | 2.185,28  | 01.03.2022  |
| 981.058,00                                       | JPY                | 7.626,09          | EUR                  | (108,95)  | 01.03.2022  |
| 378.343.144,60                                   | SEK                | 36.999.360,99     | EUR                  | (121.687,69)  | 01.03.2022  |
| 5.863.206,36                                     | USD                | 5.195.000,00      | EUR                  | (24.721,22)   | 01.03.2022  |
| 6.471.000,00                                     | USD                | 104.565.076,66    | ZAR                  | (26.312,64)   | 01.03.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(14.072.802,31)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                    |                   |                      |   |             |
| 29.496.000,00                                    | AUD                | 21.882.020,54     | USD                  | (445.033,99)  | 14.01.2022  |
| 704.926.634,91                                   | EUR                | 1.129.488.438,72  | AUD                  | (17.629.598,36)   | 14.01.2022  |
| 4.554.314,76                                     | EUR                | 600.000.000,00    | JPY                  | (45.823,83)   | 14.01.2022  |
| 7.974.000,00                                     | EUR                | 81.483.084,50     | NOK                  | (183.037,25)  | 14.01.2022  |
| 25.429.000,00                                    | EUR                | 28.747.179,35     | USD                  | 55.559,83   | 14.01.2022  |
| 25.478.000,00                                    | GBP                | 306.201.151,85    | SEK                  | 456.620,54  | 14.01.2022  |
| 9.864.000,00                                     | GBP                | 13.079.920,46     | USD                  | 193.659,82  | 14.01.2022  |
| 2.601.262.624,00                                 | JPY                | 17.214.000,00     | GBP                  | (541.813,53)  | 14.01.2022  |
| 789.012.345,00                                   | JPY                | 9.848.000,00      | NZD                  | 115.528,11  | 14.01.2022  |
| 2.513.449.316,00                                 | JPY                | 22.081.000,00     | USD                  | (219.354,45)  | 14.01.2022  |
| 139.985.574,14                                   | MXN                | 6.576.000,00      | USD                  | 226.130,41  | 14.01.2022  |
| 858.987.000,00                                   | NOK                | 880.941.848,73    | SEK                  | 73.785,99   | 14.01.2022  |
| 28.505.646,17                                    | NOK                | 3.327.000,00      | USD                  | (82.967,81)   | 14.01.2022  |
| 9.624.000,00                                     | NZD                | 752.314.817,00    | JPY                  | 30.897,10   | 14.01.2022  |
| 39.161.000,00                                    | NZD                | 26.746.452,01     | USD                  | (11.666,12)   | 14.01.2022  |
| 27.887.745,20                                    | PLN                | 5.950.000,00      | EUR                  | 110.718,10  | 14.01.2022  |
| 9.337.173,16                                     | SGD                | 6.823.000,00      | USD                  | 83.836,53   | 14.01.2022  |
| 10.917.803,54                                    | USD                | 14.862.000,00     | AUD                  | 129.082,21  | 14.01.2022  |
| 27.200.657,87                                    | USD                | 22.978.000,00     | EUR                  | 1.030.694,54  | 14.01.2022  |
| 6.916.014,37                                     | USD                | 5.176.000,00      | GBP                  | (55.266,45)   | 14.01.2022  |
| 6.932.000,00                                     | USD                | 8.158.409.440,00  | KRW                  | 71.610,28   | 14.01.2022  |
| 30.440.000,00                                    | USD                | 470.527.243,64    | ZAR                  | 880.368,43  | 14.01.2022  |
| 569.597.168,42                                   | EUR                | 668.648.050,00    | USD                  | (20.472.016,37)   | 24.01.2022  |
| 18.214.000,00                                    | EUR                | 185.879.115,63    | NOK                  | (381.626,58)  | 01.02.2022  |
| 12.133.466,80                                    | NOK                | 1.899.000,00      | AUD                  | (616,02)  | 01.02.2022  |
| 12.279.600,46                                    | NOK                | 1.723.000,00      | CAD                  | 32.827,24   | 01.02.2022  |
| 79.985.967,13                                    | NOK                | 7.831.000,00      | EUR                  | 170.920,52  | 01.02.2022  |
| 21.435.000,00                                    | USD                | 27.683.752,64     | CAD                  | (298.240,53)  | 01.02.2022  |
| 631.020.460,32                                   | EUR                | 724.000.000,00    | USD                  | (7.581.057,27)  | 17.02.2022  |
| 23.460.675,31                                    | BRL                | 4.049.000,00      | USD                  | 96.702,41   | 22.02.2022  |
| 35.753.000,00                                    | USD                | 2.717.853.677,50  | INR                  | (482.154,69)  | 22.02.2022  |
| 3.300.000,00                                     | AUD                | 2.081.409,61      | EUR                  | 27.991,72   | 28.02.2022  |
| 5.056.730,19                                     | EUR                | 8.000.000,00      | AUD                  | (56.958,12)   | 28.02.2022  |
| 68.554.664,11                                    | EUR                | 98.470.000,00     | CAD                  | 265.576,73  | 28.02.2022  |
| 131.417.398,33                                   | EUR                | 977.250.000,00    | DKK                  | (3.934,84)  | 28.02.2022  |
| 44.640.000,00                                    | HKD                | 5.047.572,08      | EUR                  | 310,55  | 28.02.2022  |
| 10.900.000,00                                    | SEK                | 1.066.069,20      | EUR                  | (3.616,25)  | 28.02.2022  |
| 5.827.762,76                                     | EUR                | 20.768.602,13     | ILS                  | (73.569,81)   | 01.03.2022  |
| 25.279.911,05                                    | EUR                | 462.121.324,35    | ZAR                  | (54.958,53)   | 01.03.2022  |
| 69.441.785,13                                    | ILS                | 19.485.675,88     | EUR                  | 245.987,61  | 01.03.2022  |
| 10.996.000,00                                    | USD                | 231.803.564,13    | MXN                  | (198.938,69)  | 01.03.2022  |
| 4.601.000,00                                     | USD                | 41.767.555,93     | NOK                  | (116.699,55)  | 01.03.2022  |
| 141.083.878,59                                   | ZAR                | 7.717.860,47      | EUR                  | 16.778,63   | 01.03.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(44.623.361,74)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 2.355.089,69                                     | AUD                | 1.498.000,00      | EUR                  | 8.590,52  | 14.01.2022  |
| 30.384.947,85                                    | AUD                | 16.126.000,00     | GBP                  | 247.316,22  | 14.01.2022  |
| 42.347.000,00                                    | AUD                | 3.377.715.292,00  | JPY                  | 1.193.823,99  | 14.01.2022  |
| 21.570.000,00                                    | AUD                | 15.860.744,55     | USD                  | (200.731,35)  | 14.01.2022  |
| 13.164.293,14                                    | CAD                | 7.718.000,00      | GBP                  | (46.097,84)   | 14.01.2022  |
| 1.629.000,00                                     | CAD                | 11.574.177,44     | SEK                  | 2.039,15  | 14.01.2022  |
| 63.137.837,10                                    | CHF                | 58.161.750,38     | EUR                  | 2.969.241,53  | 14.01.2022  |
| 5.897.000,00                                     | EUR                | 9.123.190,91      | AUD                  | 60.765,29   | 14.01.2022  |
| 74.550.385,96                                    | EUR                | 80.928.618,78     | CHF                  | (3.805.905,09)  | 14.01.2022  |
| 151.915.618,67                                   | EUR                | 1.562.937.297,19  | NOK                  | (4.545.804,62)  | 14.01.2022  |
| 472.902.097,13                                   | EUR                | 788.825.893,43    | NZD                  | (2.393.587,29)  | 14.01.2022  |
| 14.421.000,00                                    | EUR                | 66.799.197,69     | PLN                  | (96.125,52)   | 14.01.2022  |
| 210.919.223,44                                   | EUR                | 2.151.657.782,84  | SEK                  | 1.072.716,22  | 14.01.2022  |
| 105.441.501,37                                   | EUR                | 124.049.128,42    | USD                  | (4.050.449,68)  | 14.01.2022  |
| 8.218.000,00                                     | GBP                | 1.238.986.359,00  | JPY                  | 280.610,53  | 14.01.2022  |
| 11.531.000,00                                    | GBP                | 22.418.958,99     | NZD                  | 214.128,57  | 14.01.2022  |
| 7.687.189.067,85                                 | HUF                | 20.967.000,00     | EUR                  | (179.237,88)  | 14.01.2022  |
| 1.777.943.244,00                                 | JPY                | 11.593.000,00     | GBP                  | (164.827,45)  | 14.01.2022  |
| 9.626.000,00                                     | NZD                | 8.483.406,31      | CAD                  | (89.165,17)   | 14.01.2022  |
| 54.354.206,92                                    | NZD                | 32.570.528,43     | EUR                  | 179.820,17  | 14.01.2022  |
| 9.985.000,00                                     | NZD                | 767.424.634,00    | JPY                  | 132.593,12  | 14.01.2022  |
| 7.788.000,00                                     | NZD                | 48.297.656,96     | NOK                  | (88.164,98)   | 14.01.2022  |
| 25.054.000,00                                    | NZD                | 17.866.155,54     | USD                  | (673.676,11)  | 14.01.2022  |
| 182.495.866,81                                   | PLN                | 39.672.000,00     | EUR                  | (11.183,59)   | 14.01.2022  |
| 23.355.396,94                                    | SEK                | 2.477.000,00      | CHF                  | (120.465,14)  | 14.01.2022  |
| 3.256.331.432,55                                 | SEK                | 319.224.469,85    | EUR                  | (1.641.547,07)  | 14.01.2022  |
| 318.529.260,54                                   | SEK                | 35.130.000,00     | USD                  | 58.325,15   | 14.01.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|----------------------------------|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| 7.668.817,53                     | USD                | 10.414.000,00     | AUD                  | 106.842,85  | 14.01.2022  |
| 13.456.000,00                    | USD                | 75.438.870,40     | BRL                  | (33.683,93)   | 14.01.2022  |
| 1.278.549.070,11                 | USD                | 1.077.825.939,61  | EUR                  | 50.687.563,73   | 14.01.2022  |
| 3.065.057,66                     | USD                | 2.278.000,00      | GBP                  | (5.550,72)  | 14.01.2022  |
| 6.752.000,00                     | USD                | 141.009.584,99    | MXN                  | (114.869,49)  | 14.01.2022  |
| 6.988.035,38                     | USD                | 10.220.000,00     | NZD                  | 10.026,91   | 14.01.2022  |
| 1.619.000,00                     | USD                | 14.738.498,99     | SEK                  | (8.421,18)  | 14.01.2022  |
| 29.228.000,00                    | USD                | 411.395.439,50    | TRY                  | (925.046,48)  | 14.01.2022  |
| 568.558.513,16                   | ZAR                | 35.255.000,00     | USD                  | 284.329,41  | 14.01.2022  |
| 8.099.000,00                     | AUD                | 644.873.966,00    | JPY                  | 236.567,84  | 01.02.2022  |
| 161.923.305,55                   | CHF                | 152.575.033,26    | EUR                  | 4.218.695,02  | 01.02.2022  |
| 5.176.596,77                     | CHF                | 4.235.000,00      | GBP                  | (25.272,39)   | 01.02.2022  |
| 1.077.000,00                     | CHF                | 132.814.240,00    | JPY                  | 24.838,65   | 01.02.2022  |
| 77.413.683,65                    | CHF                | 85.175.000,00     | USD                  | (191.941,05)  | 01.02.2022  |
| 82.779.610,74                    | EUR                | 128.257.073,29    | AUD                  | 756.904,27  | 01.02.2022  |
| 10.216.000,00                    | EUR                | 14.872.994,25     | CAD                  | (104.926,79)  | 01.02.2022  |
| 204.970.394,80                   | EUR                | 217.528.930,89    | CHF                  | (5.667.425,17)  | 01.02.2022  |
| 181.411.610,56                   | EUR                | 295.689.133,46    | NZD                  | 3.353.377,44  | 01.02.2022  |
| 736.794.950,00                   | EUR                | 860.446.088,89    | USD                  | (22.410.329,65)   | 01.02.2022  |
| 2.816.000,00                     | GBP                | 4.770.067,46      | CAD                  | 39.715,04   | 01.02.2022  |
| 33.562.262.904,00                | JPY                | 253.168.258,82    | EUR                  | 4.093.941,57  | 01.02.2022  |
| 2.468.959.000,00                 | JPY                | 197.235.704,76    | NOK                  | (807.051,87)  | 01.02.2022  |
| 168.021.297,36                   | NOK                | 16.298.000,00     | EUR                  | 511.201,46  | 01.02.2022  |
| 85.285.310,52                    | SEK                | 8.656.000,00      | CHF                  | (65.826,47)   | 01.02.2022  |
| 13.880.636,38                    | SEK                | 1.195.000,00      | GBP                  | (68.112,70)   | 01.02.2022  |
| 263.178.300,96                   | USD                | 225.358.038,81    | EUR                  | 6.854.482,30  | 01.02.2022  |
| 1.463.000,00                     | USD                | 13.403.217,74     | NOK                  | (50.051,60)   | 01.02.2022  |
| 2.846.207.832,00                 | CLP                | 3.490.000,00      | USD                  | (155.694,72)  | 22.02.2022  |
| 398.086.860,67                   | RUB                | 5.325.000,00      | USD                  | (68.321,33)   | 22.02.2022  |
| 54.152.394,74                    | ZAR                | 3.368.000,00      | USD                  | 1.730,44  | 22.02.2022  |
| 7.420.000,00                     | AUD                | 4.683.833,05      | EUR                  | 59.119,70   | 28.02.2022  |
| 4.992.100,57                     | EUR                | 44.000.000,00     | HKD                  | 16.607,45   | 28.02.2022  |
| 48.543.860,70                    | EUR                | 55.000.000,00     | USD                  | 42.696,26   | 28.02.2022  |
| 61.900.000,00                    | HKD                | 7.043.998,93      | EUR                  | (44.407,69)   | 28.02.2022  |
| 6.031.133,69                     | EUR                | 9.339.180,37      | SGD                  | (69.021,54)   | 01.03.2022  |
| 1.204.644,76                     | EUR                | 19.076.356,95     | TRY                  | 16.536,11   | 01.03.2022  |
| 74.167.752,16                    | EUR                | 84.182.334,48     | USD                  | (66.181,99)   | 01.03.2022  |
| 108.757.802,55                   | SGD                | 70.234.519,68     | EUR                  | 803.778,30  | 01.03.2022  |
| 133.878.636,51                   | TRY                | 8.454.245,17      | EUR                  | (116.051,14)  | 01.03.2022  |
| 36.155.665,52                    | USD                | 31.854.479,40     | EUR                  | 28.424,65   | 01.03.2022  |
| 106.580.397,79                   | ZAR                | 6.571.000,00      | USD                  | 48.640,82   | 01.03.2022  |
|                                  |                    |                   |                      | <b>29.510.834,00</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 1.722.000,00                     | AUD                | 10.909.290,00     | NOK                  | 9.501,85  | 14.01.2022  |
| 160.493.000,00                   | AUD                | 1.032.387.435,34  | SEK                  | 1.983.797,85  | 14.01.2022  |
| 5.364.000,00                     | AUD                | 3.833.740,92      | USD                  | 47.629,35   | 14.01.2022  |
| 8.585.386,05                     | CAD                | 9.765.000,00      | NZD                  | 76.203,39   | 14.01.2022  |
| 3.118.000,00                     | EUR                | 4.945.383,72      | AUD                  | (45.652,30)   | 14.01.2022  |
| 4.250.000,00                     | EUR                | 6.405.639,95      | CAD                  | (196.816,92)  | 14.01.2022  |
| 5.310.000,00                     | EUR                | 54.228.018,17     | NOK                  | (118.610,13)  | 14.01.2022  |
| 5.428.000,00                     | EUR                | 25.711.598,46     | PLN                  | (159.800,72)  | 14.01.2022  |
| 3.853,85                         | EUR                | 41.283,88         | TRY                  | 1.172,51  | 14.01.2022  |
| 2.434.000,00                     | EUR                | 2.839.101,82      | USD                  | (71.927,62)   | 14.01.2022  |
| 10.270.000,00                    | GBP                | 19.083.545,57     | AUD                  | 13.600,77   | 14.01.2022  |
| 363.000,00                       | GBP                | 4.195.909,96      | NOK                  | 11.947,19   | 14.01.2022  |
| 6.967.864.145,00                 | JPY                | 86.311.000,00     | AUD                  | (1.793.213,99)  | 14.01.2022  |
| 1.450.000.000,00                 | JPY                | 11.117.861,06     | EUR                  | (888,08)  | 14.01.2022  |
| 15.778.638.255,00                | KRW                | 13.331.000,00     | USD                  | (71.645,64)   | 14.01.2022  |
| 114.718.493,98                   | NOK                | 16.080.000,00     | CAD                  | 321.491,13  | 14.01.2022  |
| 22.567.041,94                    | NOK                | 2.209.000,00      | EUR                  | 50.121,52   | 14.01.2022  |
| 51.011.947,16                    | NOK                | 4.285.000,00      | GBP                  | 7.337,96  | 14.01.2022  |
| 9.222.227,18                     | NOK                | 1.020.000,00      | USD                  | 22.916,85   | 14.01.2022  |
| 137.674.000,00                   | NZD                | 11.091.407.057,00 | JPY                  | (2.083.620,32)  | 14.01.2022  |
| 18.367.000,00                    | NZD                | 112.077.118,64    | SEK                  | 136.139,89  | 14.01.2022  |
| 37.999.000,00                    | NZD                | 26.671.885,69     | USD                  | (646.158,91)  | 14.01.2022  |
| 307.200.487,61                   | SEK                | 30.281.000,00     | EUR                  | (320.446,99)  | 14.01.2022  |
| 944.114.762,51                   | TRY                | 88.133.053,77     | EUR                  | (26.813.885,47)   | 14.01.2022  |
| 1.444.000,00                     | USD                | 1.784.585,88      | CAD                  | 35.692,03   | 14.01.2022  |
| 20.339.142,87                    | USD                | 17.548.000,00     | EUR                  | 404.275,86  | 14.01.2022  |
| 26.665.548,27                    | USD                | 19.360.000,00     | GBP                  | 497.197,76  | 14.01.2022  |
| 62.321.000,00                    | USD                | 556.089.702,04    | SEK                  | 773.009,92  | 14.01.2022  |
| 1.720.000,00                     | AUD                | 139.014.494,00    | JPY                  | 34.430,23   | 01.02.2022  |
| 10.219.000,00                    | EUR                | 104.781.697,82    | SEK                  | 2.112,67  | 01.02.2022  |
| 44.040.000,00                    | NZD                | 27.571.761,67     | CHF                  | (177.672,12)  | 01.02.2022  |
| 21.605.143,37                    | USD                | 30.640.000,00     | AUD                  | (532.518,83)  | 01.02.2022  |
| 86.143.000,00                    | USD                | 79.322.050,82     | CHF                  | (802.437,73)  | 01.02.2022  |
| 242.800.543,00                   | BRL                | 42.635.332,28     | USD                  | 355.362,90  | 22.02.2022  |
| 7.823.841.764,00                 | INR                | 104.018.317,43    | USD                  | 419.871,16  | 22.02.2022  |
| 6.571.000,00                     | USD                | 5.608.939.890,00  | CLP                  | 36.145,16   | 22.02.2022  |
| 9.700.000,00                     | USD                | 8.571.226,85      | EUR                  | (16.351,68)   | 22.02.2022  |
| 11.358.996,22                    | USD                | 854.378.259,50    | INR                  | (45.850,72)   | 22.02.2022  |
| 3.000.000,00                     | CAD                | 2.078.626,40      | EUR                  | 1.888,82  | 28.02.2022  |
| 88.000.000,00                    | DKK                | 11.831.684,29     | EUR                  | 2.626,01  | 28.02.2022  |
| 5.377.348,87                     | EUR                | 40.000.000,00     | DKK                  | (1.883,84)  | 28.02.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                       | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|---|------------|
| 2.600.431,67                            | EUR               | 26.700.000,00      | SEK                | (2.102,65)  | 28.02.2022 |
| 65.490.933,31                           | EUR               | 74.000.000,00      | USD                | 235.014,72  | 28.02.2022 |
| 30.000.000,00                           | SEK               | 2.914.460,33       | EUR                | 9.743,58  | 28.02.2022 |
| 30.000.000,00                           | USD               | 26.436.099,23      | EUR                | 19.127,62   | 28.02.2022 |
| 10.217.000,00                           | EUR               | 10.625.664,67      | CHF                | (73.479,07)   | 01.03.2022 |
| 54.491.000,00                           | EUR               | 61.708.501,87      | USD                | 75.149,56   | 01.03.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(28.391.455,47)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>     |                   |                    |                    |   |            |
| 1.752.000,00                            | CHF               | 17.115.767,87      | NOK                | (17.113,52)   | 14.01.2022 |
| 10.678.536,01                           | SEK               | 10.723.000,00      | NOK                | (31.994,95)   | 14.01.2022 |
| 2.096.000,00                            | USD               | 17.794.813,00      | NOK                | 68.656,94   | 14.01.2022 |
| 231.298.776,73                          | EUR               | 2.303.125.464,98   | SEK                | 6.733.215,78  | 01.02.2022 |
| 1.803.728.135,17                        | SEK               | 181.145.194,89     | EUR                | (5.273.221,50)  | 01.02.2022 |
| 23.526.727,80                           | SEK               | 2.753.000,00       | USD                | (135.109,97)  | 01.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>1.344.432,78</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b> |                   |                    |                    |   |            |
| 11.138.000,00                           | EUR               | 9.506.568,66       | GBP                | (175.180,81)  | 14.01.2022 |
| 2.644.000,00                            | EUR               | 27.100.791,39      | SEK                | 915,48  | 14.01.2022 |
| 15.165.000,00                           | EUR               | 17.174.442,87      | USD                | 6.125,01  | 14.01.2022 |
| 2.925.767.100,00                        | CLP               | 3.415.000,00       | USD                | (7.729,95)  | 22.02.2022 |
| 513.759.680,00                          | INR               | 6.752.000,00       | USD                | 96.826,68   | 22.02.2022 |
| 10.640.911.290,00                       | KRW               | 8.969.000,00       | USD                | (37.148,09)   | 22.02.2022 |
| 875.092.058,55                          | RUB               | 11.724.500,00      | USD                | (166.826,67)  | 22.02.2022 |
| 18.747.000,00                           | USD               | 1.433.039.427,00   | INR                | (346.416,86)  | 22.02.2022 |
| 18.272.000,00                           | USD               | 1.370.402.466,73   | RUB                | 182.974,56  | 22.02.2022 |
| 15.998.908,31                           | EUR               | 119.000.000,00     | DKK                | (4.307,58)  | 28.02.2022 |
| 48.081.262,61                           | EUR               | 422.870.000,00     | HKD                | 263.494,60  | 28.02.2022 |
| 33.000.000,00                           | HKD               | 3.735.380,87       | EUR                | (3.751,54)  | 28.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(191.025,17)</b>   |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(62.066.324,84)</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(72.276.328,82)</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

## Credit Default Swaps

| Basiswert                                     | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal          | Währung | Kosten (EUR)         | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)      | Fälligkeit |
|---|--------------|-----------------|------------------|---------|----------------------|---|----------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b> |              |                 |                  |         |                      |   |                      |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (30.131.000,00)  | USD     | 2.497.846,79         | (39.533,25)   | 2.458.313,54         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (40.132.000,00)  | USD     | 3.328.320,79         | (54.050,46)   | 3.274.270,33         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (46.855.000,00)  | USD     | 3.881.882,27         | (59.099,05)   | 3.822.783,22         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (37.567.000,00)  | USD     | 3.035.035,89         | 29.962,44   | 3.064.998,33         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (39.108.000,00)  | USD     | 3.173.674,46         | 17.050,24   | 3.190.724,70         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (6.730.000,00)   | USD     | 571.563,50           | (22.479,49)   | 549.084,01           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (7.585.000,00)   | USD     | 618.128,47           | 712,87  | 618.841,34           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (6.421.000,00)   | USD     | 511.775,59           | 12.097,88   | 523.873,47           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (45.608.000,00)  | USD     | 3.412.988,53         | 308.055,05  | 3.721.043,58         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (12.633.000,00)  | USD     | 881.865,33           | 148.829,80  | 1.030.695,13         | 20.12.2026 |
|   |              |                 |                  |         | <b>21.913.081,62</b> | <b>341.546,03</b>                                   | <b>22.254.627,65</b> |            |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>            |              |                 |                  |         |                      |   |                      |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (40.507.000,00)  | USD     | 3.244.374,86         | 60.490,79   | 3.304.865,65         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (7.302.000,00)   | USD     | 590.250,79           | 5.501,28  | 595.752,07           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (12.633.000,00)  | USD     | 886.213,80           | 144.481,33  | 1.030.695,13         | 20.12.2026 |
|   |              |                 |                  |         | <b>4.720.839,45</b>  | <b>210.473,40</b>                                   | <b>4.931.312,85</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>       |              |                 |                  |         |                      |   |                      |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.817.000,00)   | USD     | 230.433,41           | (601,37)  | 229.832,04           | 20.12.2026 |
|   |              |                 |                  |         | <b>230.433,41</b>    | <b>(601,37)</b>                                     | <b>229.832,04</b>    |            |
| <b>Gegenpartei: ICE Clear Europe Limited</b>  |              |                 |                  |         |                      |   |                      |            |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (721.634.000,00) | EUR     | 84.339.424,75        | 1.681.737,58  | 86.021.162,33        | 20.12.2026 |
|   |              |                 |                  |         | <b>84.339.424,75</b> | <b>1.681.737,58</b>                                 | <b>86.021.162,33</b> |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert                        | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal         | Währung | Kosten (EUR)          | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)       | Fälligkeit |
|----------------------------------|--------------|-----------------|-----------------|---------|-----------------------|---|-----------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b> |              |                 |                 |         |                       |   |                       |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                 | Verkauf      | 5,00%           | (13.015.000,00) | USD     | 919.456,79            | 142.404,77  | 1.061.861,56          | 20.12.2026 |
|                                  |              |                 |                 |         | <b>919.456,79</b>     | <b>142.404,77</b>                                   | <b>1.061.861,56</b>   |            |
|                                  |              |                 |                 |         | <b>112.123.236,02</b> | <b>2.375.560,41</b>                                 | <b>114.498.796,43</b> |            |

## Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|-------------------------------|--------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                               |                          |   |  |
| AMSTERDAM IDX FUT 1/2022               | 21.01.2022 | EUR     | 1.138,00                      | 181.818.260,00           | (273.120,00)  | 3.892.366,72   |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022 | AUD     | 1.002,00                      | 98.471.550,00            | (321.787,20)  | 183.028,03   |
| CAC40 10 EURO FUT 1/2022               | 21.01.2022 | EUR     | (1.073,00)                    | (76.735.595,00)          | 139.490,00  | (2.644.945,00)   |
| CAC40 10 EURO FUT 1/2022               | 21.01.2022 | EUR     | 979,00                        | 70.013.185,00            | (127.270,00)  | 2.413.235,00   |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | (2.194,00)                    | (312.096.500,00)         | 182.819,64  | (5.625.838,60)   |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | 196,00                        | 27.881.000,00            | (16.332,11)   | 478.015,50   |
| CBOE VIX FUTURE 1/2022                 | 19.01.2022 | USD     | 317,00                        | 6.308.300,00             | (12.286,50)   | (2.067.360,69)   |
| DAX INDEX FUTURE 3/2022                | 18.03.2022 | EUR     | (300,00)                      | (118.755.000,00)         | 165.000,00  | (1.935.000,00)   |
| DAX INDEX FUTURE 3/2022                | 18.03.2022 | EUR     | 235,00                        | 93.024.750,00            | (129.250,00)  | 1.515.750,00   |
| DJIA MINI e-CBOT 3/2022                | 18.03.2022 | USD     | 1.558,00                      | 282.317.390,00           | (343.883,81)  | 2.857.232,92   |
| DJIA MINI e-CBOT 3/2022                | 18.03.2022 | USD     | (837,00)                      | (151.668.585,00)         | 184.743,74  | (1.534.983,30)   |
| E-Mini Russ 2000 3/2022                | 18.03.2022 | USD     | 1.186,00                      | 133.650.340,00           | 361.250,17  | 1.987.794,17   |
| E-Mini Russ 2000 3/2022                | 18.03.2022 | USD     | (1.384,00)                    | (155.962.960,00)         | (421.560,06)  | (2.300.405,15)   |
| EURO STOXX 50 3/2022                   | 18.03.2022 | EUR     | (12.361,00)                   | (529.050.800,00)         | 927.075,00  | (11.399.262,39)  |
| EURO STOXX 50 3/2022                   | 18.03.2022 | EUR     | 3.353,00                      | 143.508.400,00           | (251.475,00)  | 3.021.618,89   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | 3.799,00                      | 651.034.630,00           | 0,00  | (11.564.770,54)  |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (1.674,00)                    | (286.873.380,00)         | 0,00  | 5.015.861,46   |
| FTSE 100 IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022 | GBP     | 3.484,00                      | 255.603.660,00           | (497.680,01)  | 6.140.596,53   |
| FTSE 100 IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022 | GBP     | (2.396,00)                    | (175.782.540,00)         | 342.262,14  | (4.241.162,98)   |
| FTSE/MIB IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022 | EUR     | (959,00)                      | (130.280.150,00)         | 374.010,00  | (2.292.010,00)   |
| HANG SENG IDX FUT 1/2022               | 28.01.2022 | HKD     | (1.351,00)                    | (1.584.115.050,00)       | (2.362.860,31)  | 412.064,07   |
| HANG SENG IDX FUT 1/2022               | 28.01.2022 | HKD     | 217,00                        | 254.443.350,00           | 379.526,79  | (66.186,45)  |
| HSCEI Futures 1/2022                   | 28.01.2022 | HKD     | (2.881,00)                    | (1.190.861.350,00)       | (2.364.479,10)  | 1.599.522,65   |
| HSCEI Futures 1/2022                   | 28.01.2022 | HKD     | 289,00                        | 119.458.150,00           | 237.186,55  | (160.451,95)   |
| IBEX 35 IND FUTURE 1/2022              | 21.01.2022 | EUR     | (1.922,00)                    | (166.579.740,00)         | 334.428,00  | (6.589.509,60)   |
| JPN 10Y BOND(OSE) 3/2022               | 22.03.2022 | JPY     | (56,00)                       | (8.494.080.000,00)       | (38.648,03)   | 170.145,63   |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022 | GBP     | (532,00)                      | (66.462.760,00)          | (94.993,46)   | (20.929,30)  |
| MSCI EmgMkt 3/2022                     | 18.03.2022 | USD     | (3.961,00)                    | (244.472.920,00)         | (192.340,97)  | 79.041,22  |
| MSCI EmgMkt 3/2022                     | 18.03.2022 | USD     | 1.179,00                      | 72.767.880,00            | 57.250,70   | (70.475,68)  |
| NASDAQ 100 E-MINI 3/2022               | 18.03.2022 | USD     | 658,00                        | 215.777.940,00           | (392.133,49)  | 1.163.162,10   |
| NASDAQ 100 E-MINI 3/2022               | 18.03.2022 | USD     | (174,00)                      | (57.059.820,00)          | 103.694,87  | (300.599,73)   |
| NIKKEI 225 MINI 3/2022                 | 11.03.2022 | JPY     | (12.327,00)                   | (35.551.068.000,00)      | (567.159,85)  | (3.417.180,87)   |
| NIKKEI 225 MINI 3/2022                 | 11.03.2022 | JPY     | 10.297,00                     | 29.696.548.000,00        | 473.760,44  | 2.646.133,43   |
| OMXS30 IND FUTURE 1/2022               | 21.01.2022 | SEK     | 5.066,00                      | 1.227.871.750,00         | 222.371,03  | 5.470.326,84   |
| OMXS30 IND FUTURE 1/2022               | 21.01.2022 | SEK     | (4.847,00)                    | (1.174.791.625,00)       | (212.758,07)  | (5.233.848,01)   |
| S&P MID 400 EMINI 3/2022               | 18.03.2022 | USD     | (303,00)                      | (86.076.240,00)          | (112.355,98)  | (1.660.562,45)   |
| S&P MID 400 EMINI 3/2022               | 18.03.2022 | USD     | 145,00                        | 41.191.600,00            | 53.767,71   | 794.658,58   |
| S&P/TSX 60 IX FUT 3/2022               | 18.03.2022 | CAD     | (725,00)                      | (186.020.500,00)         | 312.129,40  | (2.672.120,06)   |
| S&P/TSX 60 IX FUT 3/2022               | 18.03.2022 | CAD     | 408,00                        | 104.684.640,00           | (175.653,51)  | 1.503.758,60   |
| S&P500 EMINI FUT 3/2022                | 18.03.2022 | USD     | (13.981,00)                   | (3.332.371.350,00)       | 3.240.199,98  | (43.220.307,98)  |
| S&P500 EMINI FUT 3/2022                | 18.03.2022 | USD     | 9.902,00                      | 2.360.141.700,00         | (2.294.861,61)  | 28.145.731,96  |
| SPI 200 FUTURES 3/2022                 | 17.03.2022 | AUD     | (2.248,00)                    | (413.013.800,00)         | 3.092.625,00  | (5.751.100,79)   |
| SPI 200 FUTURES 3/2022                 | 17.03.2022 | AUD     | 559,00                        | 102.702.275,00           | (769.029,08)  | 1.421.634,91   |
| SWISS MKT IX FUTR 3/2022               | 18.03.2022 | CHF     | 1.084,00                      | 138.621.920,00           | (104.945,19)  | 3.708.190,82   |
| SWISS MKT IX FUTR 3/2022               | 18.03.2022 | CHF     | (857,00)                      | (109.593.160,00)         | 82.968,66   | (2.931.660,07)   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 16.735,00                     | 2182.348.593,75          | 0,00  | 16.025.746,37  |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (4.082,00)                    | (532.318.312,50)         | 0,00  | (2.620.400,17)   |
|  |            |         |                               |                          | <b>(810.303,52)</b>   | <b>(29.675.455,36)</b>   |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Equity Swaps

| Basiswert                                     | Währung | Stückzahl der zugrunde liegenden Aktien | Verpflichtung in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|---------|---|---|---|--|------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b> |         |   |   |   |  |            |
| Accenture                                     | USD     | 87.300,00                               | 31.826.174,05   | 2.580.500,60  | 1.134.167,04   | 06.09.2022 |
| Akamai Technologies                           | USD     | 18.782,00                               | 1.941.461,67  | 67.490,17   | 53.449,44  | 06.09.2022 |
| Alphabet                                      | USD     | 12.430,00                               | 31.964.409,25   | (519.741,14)  | 463.145,21   | 06.09.2022 |
| Amgen   | USD     | 109.567,00                              | 21.917.269,43   | 1.516.806,21  | (224.653,50)   | 06.09.2022 |
| Anthem  | USD     | 49.151,00                               | 20.264.454,16   | 1.561.341,08  | 263.239,12   | 06.09.2022 |
| Apple   | USD     | 25.540,00                               | 4.010.996,52  | (35.401,76)   | 711.689,09   | 06.09.2022 |
| Automatic Data Processing                     | USD     | 53.761,00                               | 11.651.183,23   | 414.842,31  | 336.867,42   | 06.09.2022 |
| AutoZone                                      | USD     | 18.323,00                               | 33.708.075,68   | 1.305.007,20  | 1.969.135,49   | 06.09.2022 |
| Bank of Nova Scotia/The                       | CAD     | 24.179,00                               | 1.507.548,49  | 61.618,25   | 57.268,33  | 19.09.2022 |
| Bristol-Myers Squibb                          | USD     | 88.865,00                               | 4.918.506,91  | 496.636,60  | (237.968,14)   | 06.09.2022 |
| Cadence Design Systems                        | USD     | 160.706,00                              | 26.342.361,71   | 215.665,14  | 945.914,24   | 06.09.2022 |
| Cerner  | USD     | 200.065,00                              | 16.427.003,06   | 3.290.699,65  | 1.768,14   | 06.09.2022 |
| Check Point Software Technologies             | USD     | 151.135,00                              | 15.577.186,17   | 817.955,72  | (893.586,52)   | 06.09.2022 |
| Chubb   | USD     | 26.137,00                               | 4.468.200,52  | 49.844,10   | (36.497,09)  | 06.09.2022 |
| Cigna   | USD     | 38.360,00                               | 7.833.209,21  | 553.733,28  | (98.315,51)  | 06.09.2022 |
| Cisco Systems                                 | USD     | 253.090,00                              | 14.182.335,51   | 942.956,61  | 331.041,27   | 06.09.2022 |
| Citrix Systems                                | USD     | 50.779,00                               | 4.292.666,98  | 638.408,12  | (337.928,30)   | 06.09.2022 |
| Cognizant Technology Solutions                | USD     | 276,00                                  | 21.643,33   | 1.637,50  | 353,69   | 06.09.2022 |
| Colgate-Palmolive                             | USD     | 133.946,00                              | 10.016.533,10   | 618.494,33  | 117.306,13   | 06.09.2022 |
| CVS Health                                    | USD     | 75.468,00                               | 6.884.168,78  | 297.167,95  | 393.514,10   | 06.09.2022 |
| eBay  | USD     | 571.830,00                              | 33.431.848,00   | (338.256,39)  | (3.204.067,35)   | 06.09.2022 |
| Estee Lauder Cos                              | USD     | 12.166,00                               | 3.955.869,99  | 74.114,16   | 175.044,17   | 06.09.2022 |
| Expeditors International of Washington        | USD     | 180.813,00                              | 21.204.600,55   | 290.539,58  | 877.298,60   | 06.09.2022 |
| F5  | USD     | 76.563,00                               | 16.596.930,57   | 1.086.273,26  | 270.660,19   | 06.09.2022 |
| Hershey                                       | USD     | 49.742,00                               | 8.396.830,80  | 205.968,29  | 291.343,25   | 06.09.2022 |
| Hoya  | JPY     | 101.700,00                              | 13.343.439,54   | (600.493,77)  | 277.433,84   | 16.06.2022 |
| Infosys ADR                                   | USD     | 7.406,00                                | 166.604,76  | 14.973,50   | 1.505,42   | 06.09.2022 |
| Intuit  | USD     | 8.113,00                                | 4.589.380,10  | (266.672,84)  | 530.374,38   | 06.09.2022 |
| Johnson & Johnson                             | USD     | 103.519,00                              | 15.727.320,48   | 602.295,69  | 111.615,71   | 06.09.2022 |
| Kellogg                                       | USD     | 27.060,00                               | 1.527.582,57  | 31.535,96   | (21.523,64)  | 06.09.2022 |
| Kimberly-Clark                                | USD     | 48.286,00                               | 6.051.043,88  | 250.243,96  | 49.229,14  | 06.09.2022 |
| Kyndryl Holdings                              | USD     | 4.101,00                                | 67.309,05   | 1.520,70  | (11.126,88)  | 06.09.2022 |
| Marsh & McLennan Cos                          | USD     | 52.126,00                               | 7.978.248,68  | 71.793,19   | 266.904,65   | 06.09.2022 |
| Mastercard                                    | USD     | 79.271,00                               | 25.310.170,37   | 820.249,96  | (561.867,80)   | 06.09.2022 |
| McDonald's                                    | USD     | 168.133,00                              | 39.686.008,56   | 353.292,28  | 1.459.422,64   | 06.09.2022 |
| Medtronic                                     | USD     | 57.547,00                               | 5.305.308,57  | (406.967,26)  | (507.573,19)   | 06.09.2022 |
| Microsoft                                     | USD     | 156.569,00                              | 46.636.868,65   | (713.279,51)  | 1.624.498,51   | 06.09.2022 |
| Mondelez International                        | USD     | 3.329,00                                | 193.379,74  | 10.389,80   | (1.382,79)   | 06.09.2022 |
| Monster Beverage                              | USD     | 573.856,00                              | 48.369.780,94   | 2.999.362,14  | (1.232.408,38)   | 06.09.2022 |
| National Grid                                 | GBP     | 1.396.814,00                            | 17.621.923,04   | 149.648,31  | 1.398.872,61   | 16.01.2023 |
| NIKE  | USD     | 110.263,00                              | 16.235.962,71   | (221.957,04)  | 77.958,82  | 06.09.2022 |
| Nippon Telegraph & Telephone                  | JPY     | 26.616,00                               | 642.909,99  | 13.062,30   | (28.835,54)  | 16.06.2022 |
| Novo Nordisk B                                | DKK     | 78.560,00                               | 7.764.828,80  | (169.030,29)  | 212.356,35   | 07.02.2022 |
| Oracle  | USD     | 65.207,00                               | 5.050.066,70  | (858.373,17)  | 507.133,54   | 06.09.2022 |
| PepsiCo                                       | USD     | 15.079,00                               | 2.292.370,11  | 42.867,95   | 65.699,93  | 06.09.2022 |
| Pfizer  | USD     | 151.378,00                              | 7.928.082,79  | 874.067,12  | 503.032,51   | 06.09.2022 |
| Procter & Gamble                              | USD     | 271.500,00                              | 38.970.970,77   | 1.706.687,89  | 1.008.405,75   | 06.09.2022 |
| Public Service Enterprise Group               | USD     | 100.086,00                              | 5.855.028,80  | 217.376,56  | 95.530,61  | 06.09.2022 |
| Reckitt Benckiser Group                       | GBP     | 168.373,00                              | 12.711.286,09   | 344.740,02  | (73.952,12)  | 16.01.2023 |
| Rightmove                                     | GBP     | 1.013.958,00                            | 9.595.727,37  | 284.854,29  | 882.282,19   | 16.01.2023 |
| Ross Stores                                   | USD     | 144.978,00                              | 14.589.319,26   | 143.358,81  | (744.429,68)   | 06.09.2022 |
| Royal Bank of Canada                          | CAD     | 8.341,00                                | 777.218,73  | 23.225,63   | (12.803,60)  | 19.09.2022 |
| Siemens                                       | EUR     | 26.473,00                               | 4.041.897,64  | 43.415,72   | 108.009,84   | 16.01.2023 |
| Starbucks                                     | USD     | 312.698,00                              | 32.198.797,32   | (27.607,65)   | 961.722,53   | 06.09.2022 |
| State Street                                  | USD     | 2.295,00                                | 188.479,14  | (992,85)  | (8.194,26)   | 06.09.2022 |
| Stryker                                       | USD     | 24.641,00                               | 5.875.637,92  | 214.941,14  | (208.012,16)   | 06.09.2022 |
| Techntron Industries                          | HKD     | 789.273,00                              | 13.866.701,86   | (1.036.428,75)  | (107.327,12)   | 16.06.2022 |
| Texas Roadhouse                               | USD     | 189.776,00                              | 15.245.414,08   | 494.273,78  | (771.515,33)   | 06.09.2022 |
| TJX Cos                                       | USD     | 275.492,00                              | 18.388.023,86   | 211.608,21  | 1.404.850,94   | 06.09.2022 |
| Toro  | USD     | 194.823,00                              | 17.081.951,31   | (99.763,69)   | (96.421,46)  | 06.09.2022 |
| Unilever                                      | GBP     | 289.298,00                              | 13.588.665,52   | (239.859,76)  | 328.711,61   | 16.01.2023 |
| UnitedHealth Group                            | USD     | 23.215,00                               | 10.336.429,31   | 534.540,41  | 380.839,91   | 06.09.2022 |
| Verizon Communications                        | USD     | 320.427,00                              | 14.775.881,54   | 577.116,57  | (682.482,61)   | 06.09.2022 |
| Vinci   | EUR     | 125.162,00                              | 11.628.801,42   | 934.960,14  | (1.221.581,12)   | 16.01.2023 |
| Visa  | USD     | 100.195,00                              | 19.201.277,29   | 323.766,12  | (191.269,29)   | 06.09.2022 |
| VMware  | USD     | 132.506,00                              | 13.705.096,82   | 473.799,76  | (1.387.711,98)   | 06.09.2022 |
| Waste Management                              | USD     | 56.856,00                               | 8.322.716,47  | 54.213,11   | 113.622,40   | 06.09.2022 |
| WW Grainger                                   | USD     | 17.679,00                               | 8.054.156,89  | 36.523,96   | 449.903,99   | 06.09.2022 |
| Xilinx  | USD     | 250.269,00                              | 46.874.202,73   | (1.113.632,42)  | 4.266.627,50   | 06.09.2022 |
| Zimmer Biomet Holdings                        | USD     | 27.331,00                               | 3.088.657,58  | 84.696,78   | (226.570,73)   | 06.09.2022 |
|   |         | <b>10.569.552,00</b>                    | <b>964.792.397,42</b>                                 | <b>23.378.643,58</b>  | <b>12.349.744,15</b>   |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Equity Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert                                     | Währung | Stückzahl der zugrunde liegenden Aktien | Verpflichtung in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|---------|---|---|---|--|------------|
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |         |   |   |   |  |            |
| Accenture                                     | USD     | 138.451,00                              | 50.473.833,03   | 4.598.531,43  | 839.654,14   | 15.12.2022 |
| Alphabet                                      | USD     | 12.906,00                               | 33.188.468,69   | (184.021,45)  | (459.565,58)   | 15.12.2022 |
| Amgen   | USD     | 130.319,00                              | 26.068.402,30   | 842.215,23  | 1.367.224,57   | 15.12.2022 |
| Anthem  | USD     | 75.065,00                               | 30.948.531,09   | 1.552.131,99  | 609.425,45   | 15.12.2022 |
| Apple   | USD     | 242.230,00                              | 38.041.647,86   | (303.683,04)  | 6.283.611,34   | 15.12.2022 |
| Automatic Data Processing                     | USD     | 133.512,00                              | 28.934.967,27   | 1.361.465,24  | 1.01.655,88  | 15.12.2022 |
| AutoZone                                      | USD     | 23.728,00                               | 43.651.433,69   | 735.313,47  | 2.872.779,11   | 15.12.2022 |
| Cadence Design Systems                        | USD     | 138.262,00                              | 22.663.420,25   | 169.676,58  | 236.251,14   | 15.12.2022 |
| Cerner  | USD     | 136.924,00                              | 11.242.600,99   | 1.702.105,61  | 607.338,86   | 15.12.2022 |
| Check Point Software Technologies             | USD     | 23.135,00                               | 2.384.478,79  | 68.017,08   | (73.122,58)  | 15.12.2022 |
| Cisco Systems                                 | USD     | 120,00                                  | 6.724,41  | 375,05  | 282,60   | 15.12.2022 |
| Citrix Systems                                | USD     | 23.799,00                               | 2.011.878,56  | 252.561,67  | (72.271,42)  | 15.12.2022 |
| Coca-Cola                                     | USD     | 991.485,00                              | 51.379.695,53   | 555.858,36  | 1.264.044,62   | 15.12.2022 |
| Cognizant Technology Solutions                | USD     | 90.823,00                               | 7.122.146,18  | 474.702,83  | 76.389,42  | 15.12.2022 |
| Colgate-Palmolive                             | USD     | 388.185,00                              | 29.028.622,73   | 664.882,27  | 1.532.806,64   | 15.12.2022 |
| eBay  | USD     | 335.554,00                              | 19.618.051,39   | 180.715,97  | (2.554.904,30)   | 15.12.2022 |
| Estee Lauder Cos                              | USD     | 50.556,00                               | 16.438.678,55   | 141.493,42  | 763.151,66   | 15.12.2022 |
| Expeditors International of Washington        | USD     | 127.997,00                              | 15.010.675,43   | (257.655,20)  | 704.861,75   | 15.12.2022 |
| F5  | USD     | 31.503,00                               | 6.829.057,17  | 268.122,47  | 137.224,22   | 15.12.2022 |
| Hershey                                       | USD     | 168.975,00                              | 28.524.274,96   | 213.335,32  | 1.840.099,60   | 15.12.2022 |
| Infosys ADR                                   | USD     | 683.952,00                              | 15.386.127,20   | 1.340.549,54  | (224.048,02)   | 15.12.2022 |
| Intuit  | USD     | 6.523,00                                | 3.689.945,32  | (38.988,84)   | 123.298,85   | 15.12.2022 |
| Johnson & Johnson                             | USD     | 408.785,00                              | 62.105.436,69   | 339.255,64  | 2.757.805,85   | 15.12.2022 |
| Kimberly-Clark                                | USD     | 244.029,00                              | 30.580.917,58   | 784.236,58  | 760.497,64   | 15.12.2022 |
| Marsh & McLennan Cos                          | USD     | 206.717,00                              | 31.639.481,89   | 536.571,74  | 561.860,28   | 15.12.2022 |
| McDonald's                                    | USD     | 275.791,00                              | 65.097.535,80   | 689.081,83  | 2.827.498,70   | 15.12.2022 |
| Microsoft                                     | USD     | 103.640,00                              | 30.871.022,15   | 249.801,09  | (130.295,53)   | 15.12.2022 |
| NIKE  | USD     | 219.901,00                              | 32.379.895,66   | 559.144,38  | (963.709,56)   | 15.12.2022 |
| Paychex                                       | USD     | 87.118,00                               | 10.473.542,64   | 837.606,52  | 61.703,76  | 15.12.2022 |
| PepsiCo                                       | USD     | 380.896,00                              | 57.905.339,08   | 208.498,23  | 2.620.240,75   | 15.12.2022 |
| Procter & Gamble                              | USD     | 426.873,00                              | 61.273.131,52   | 1.401.993,17  | 4.331.088,61   | 15.12.2022 |
| Rightmove                                     | GBP     | 561.295,00                              | 5.311.890,43  | 328.735,86  | 69.848,06  | 15.12.2022 |
| Ross Stores                                   | USD     | 162.558,00                              | 16.358.416,86   | 740.563,53  | (954.191,71)   | 15.12.2022 |
| Starbucks                                     | USD     | 114.378,00                              | 11.777.606,63   | 196.916,17  | 284.552,62   | 15.12.2022 |
| Stryker                                       | USD     | 122.068,00                              | 29.107.072,33   | 1.924.808,62  | (1.045.062,03)   | 15.12.2022 |
| Techtronic Industries                         | HKD     | 215.608,00                              | 3.788.007,26  | (178.173,02)  | (161.468,86)   | 15.07.2022 |
| Texas Roadhouse                               | USD     | 312.205,00                              | 25.080.592,40   | 1.904.680,66  | (2.017.792,39)   | 15.12.2022 |
| TJX Cos                                       | USD     | 229.414,00                              | 15.312.495,84   | 514.467,45  | 759.635,56   | 15.12.2022 |
| Toro  | USD     | 137.958,00                              | 12.096.065,86   | 155.905,39  | (472.684,78)   | 15.12.2022 |
| Unilever                                      | GBP     | 655.624,00                              | 30.795.426,31   | (184.576,67)  | 477.203,72   | 15.12.2022 |
| UnitedHealth Group                            | USD     | 73.066,00                               | 32.532.480,91   | 640.573,33  | 2.819.137,92   | 15.12.2022 |
| VMware  | USD     | 108.216,00                              | 11.192.781,90   | 368.793,33  | (1.089.345,66)   | 15.12.2022 |
| Waste Management                              | USD     | 205.038,00                              | 30.013.949,97   | 591.951,85  | (85.319,04)  | 15.12.2022 |
| WW Grainger                                   | USD     | 66.562,00                               | 30.324.158,09   | 121.059,22  | 1.740.217,67   | 15.12.2022 |
| Xilinx  | USD     | 105.745,00                              | 19.805.539,51   | (521.886,33)  | 230.307,84   | 15.12.2022 |
|   |         | <b>9.377.489,00</b>                     | <b>1.138.466.448,70</b>                               | <b>26.547.713,57</b>  | <b>29.357.917,37</b>   |            |
|   |         | <b>19.947.041,00</b>                    | <b>2.103.258.846,12</b>                               | <b>49.926.357,15</b>  | <b>41.707.661,52</b>   |            |

### Total Return Swaps

| Basiswert   | Währung | Stückzahl          | Verpflichtung in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|---------|--------------------|---|---|--|------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>                       |         |                    |   |   |  |            |
| S&P 500 Total Return 4 JAN 1988 Index against variable rate USONBFR | USD     | (66.495,00)        | (587.366.336,34)                                      | (8.122.065,00)  | (8.809.086,01)   | 14.09.2022 |
| S&P 500 Total Return 4 JAN 1988 Index against variable rate USONBFR | USD     | (16.774,00)        | (148.168.778,49)                                      | (2.048.868,61)  | (2.222.176,24)   | 08.07.2022 |
|   |         | <b>(83.269,00)</b> | <b>(735.535.114,83)</b>                               | <b>(10.170.933,61)</b>  | <b>(11.031.262,25)</b>   |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### FX-Optionen (OTC)

| Beschreibung                           | Kauf/<br>Verkauf | Put/Call | Strike | Laufzeit   | Währung | Erworbener/<br>(veräußerter)<br>Betrag in Währung | Verpflichtung* in<br>der Basiswährung<br>des Teilfonds (EUR) | Marktwert in der<br>Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) |
|--|------------------|----------|--------|------------|---------|---|--|---|
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>       |                  |          |        |            |         |   |  |   |
| FXO USD/CAD with delta 25 and 20220429 | Kauf             | Call     | 1,285  | 29.04.2022 | USD     | 9.644.649,00                                      | -  | 90.891,21   |
|  |                  |          |        |            | CAD     | (12.393.373,97)                                   | -  | -   |
| FXO USD/CAD Delta 25 End 20220527      | Kauf             | Call     | 1,276  | 27.05.2022 | USD     | 4.435.613,00                                      | -  | 58.871,35   |
|  |                  |          |        |            | CAD     | (5.659.842,19)                                    | -  | -   |
| FXO AUD/USD Delta 25 End 20220325      | Kauf             | Put      | 0,7227 | 25.03.2022 | AUD     | 4.827.257,00                                      | -  | 42.948,89   |
|  |                  |          |        |            | USD     | (3.488.658,63)                                    | -  | -   |
| FXO USD/CAD Delta 25 End 20220906      | Kauf             | Call     | 1,3242 | 06.09.2022 | USD     | 8.913.090,00                                      | -  | 77.380,33   |
|  |                  |          |        |            | CAD     | (11.802.713,78)                                   | -  | -   |
|  |                  |          |        |            |         |   |  | <b>270.091,78</b>                                       |

(\*) Bei gekauften Optionen muss keine Verpflichtung ausgewiesen werden. Dies gilt lediglich für verkaufte (geschriebene) Optionen.

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps, Equity Swaps, Devisenterminkontrakte und Total Return Swaps 37.990.000,00 EUR erhalten.  
 BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 4.610.000,00 EUR gezahlt.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Equity Swaps und Devisenterminkontrakte 31.960.000,00 EUR gezahlt.  
 J.P. Morgan SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps, Devisenterminkontrakte und FX-Optionen (OTC) 1.010.000,00 EUR gezahlt.  
 JP Morgan Chase Bank NA hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte 210.000,00 EUR erhalten.  
 Société Générale hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte 320.000,00 EUR erhalten.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal    | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|-----------------------|--------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 60.000.000,00   | Bundesobligation 0.000000% 13-10-2023              | 60.757.200,00              | 1,22                         |                       |              |                            |                              |
| 60.000.000,00   | Bundesobligation 0.000000% 14-04-2023              | 60.529.200,00              | 1,22                         |                       |              |                            |                              |
| 100.001.000,00  | Bundesrepublik Deutschland B 1.5% 04-09-2022       | 101.539.175,38             | 2,04                         |                       |              |                            |                              |
| 35.001.000,00   | Bundesrepublik Deutschland B 1.5% 15-02-2023       | 35.883.725,22              | 0,72                         |                       |              |                            |                              |
| 101.001.000,00  | Bundesrepublik Deutschland B 1.75% 04-07-2022      | 102.281.086,67             | 2,06                         |                       |              |                            |                              |
| 76.001.000,00   | Bundesrepublik Deutschland B 2% 04-01-2022         | 76.001.000,00              | 1,53                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>436.991.387,27</b>      | <b>8,79</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>GBP</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 17.500.000,00   | United Kingdom Gilt 0.125% 31-01-2023              | 20.742.946,47              | 0,42                         |                       |              |                            |                              |
| 20.000.000,00   | United Kingdom Gilt 0.125% 31-01-2024              | 23.535.245,83              | 0,47                         |                       |              |                            |                              |
| 17.500.000,00   | United Kingdom Gilt 0.75% 22-07-2023               | 20.907.960,10              | 0,42                         |                       |              |                            |                              |
| 33.500.000,00   | United Kingdom Gilt 1.75% 07-09-2022               | 40.275.552,48              | 0,81                         |                       |              |                            |                              |
| 67.000.000,00   | United Kingdom Gilt 4% 07-03-2022                  | 80.301.371,68              | 1,62                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>185.763.076,56</b>      | <b>3,74</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 50.000.000,00   | United States Treasury Note/ 0.125% 30-09-2022     | 44.094.256,44              | 0,89                         |                       |              |                            |                              |
| 35.000.000,00   | United States Treasury Note/ 0.125% 31-07-2022     | 30.881.671,33              | 0,62                         |                       |              |                            |                              |
| 50.000.000,00   | United States Treasury Note/ 0.125% 31-08-2022     | 44.106.327,24              | 0,89                         |                       |              |                            |                              |
| 30.000.000,00   | United States Treasury Note/ 0.375% 31-03-2022     | 26.504.844,42              | 0,53                         |                       |              |                            |                              |
| 30.000.000,00   | United States Treasury Note/ 1.125% 28-02-2022     | 26.530.593,33              | 0,53                         |                       |              |                            |                              |
| 20.000.000,00   | United States Treasury Note/ 1.75% 15-05-2022      | 17.761.168,61              | 0,36                         |                       |              |                            |                              |
| 20.000.000,00   | United States Treasury Note/ 1.875% 31-01-2022     | 17.681.594,69              | 0,36                         |                       |              |                            |                              |
| 40.000.000,00   | United States Treasury Note/ 2% 30-11-2022         | 35.838.244,51              | 0,72                         |                       |              |                            |                              |
| 40.000.000,00   | United States Treasury Note/ 2% 31-10-2022         | 35.800.997,70              | 0,72                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>279.199.698,27</b>      | <b>5,62</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>Summe Anleihen</b>   |  |                            |                              | <b>901.954.162,10</b> | <b>18,15</b> |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| <b>BRL</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 719.161,00  | Banco Bradesco                                     | 2.189.790,51               | 0,04                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>2.189.790,51</b>        | <b>0,04</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>CAD</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 429.700,00  | Bank of Nova Scotia/The                            | 26.791.578,94              | 0,54                         |                       |              |                            |                              |
| 227.400,00  | Royal Bank of Canada                               | 21.189.250,59              | 0,43                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>47.980.829,53</b>       | <b>0,97</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>CHF</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 631.784,00  | Nestle   | 77.948.476,06              | 1,57                         |                       |              |                            |                              |
| 209.481,00  | Roche Holding                                      | 76.883.238,01              | 1,55                         |                       |              |                            |                              |
| 25.749,00   | Sonova Holding                                     | 8.919.365,20               | 0,18                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>163.751.079,27</b>      | <b>3,30</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>DKK</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 2.037.909,00  | Novo Nordisk B                                     | 201.425.846,39             | 4,05                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>201.425.846,39</b>      | <b>4,05</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 126.828,00  | Allianz  | 26.335.834,20              | 0,53                         |                       |              |                            |                              |
| 502.662,00  | Deutsche Post                                      | 28.420.509,48              | 0,57                         |                       |              |                            |                              |
| 742.194,00  | Iberdrola  | 7.726.239,54               | 0,16                         |                       |              |                            |                              |
| 102.305,00  | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in M | 26.650.452,50              | 0,54                         |                       |              |                            |                              |
| 107.605,00  | Prosus   | 7.912.195,65               | 0,16                         |                       |              |                            |                              |
| 301.674,00  | Sanofi   | 26.722.282,92              | 0,54                         |                       |              |                            |                              |
| 126.742,00  | Siemens  | 19.350.968,56              | 0,39                         |                       |              |                            |                              |
| 560.508,00  | Unilever   | 26.374.703,94              | 0,53                         |                       |              |                            |                              |
| 296.934,00  | Vinci  | 27.588.137,94              | 0,56                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>197.081.324,73</b>      | <b>3,97</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>GBP</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 119.073,00  | National Grid                                      | 1.502.200,89               | 0,03                         |                       |              |                            |                              |
| 6.994,00  | Reckitt Benckiser Group                            | 528.010,64                 | 0,01                         |                       |              |                            |                              |
| 672.400,00  | Rightmove  | 6.363.347,48               | 0,13                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>8.393.559,01</b>        | <b>0,17</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>HKD</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 2.807.000,00  | China Communications Construction                  | 1.347.294,34               | 0,03                         |                       |              |                            |                              |
| 12.311.000,00   | China Construction Bank                            | 7.525.603,03               | 0,15                         |                       |              |                            |                              |
| 3.925.917,00  | China Everbright Environment Group                 | 2.782.080,31               | 0,06                         |                       |              |                            |                              |
| 1.482.600,00  | China Gas Holdings                                 | 2.718.899,94               | 0,05                         |                       |              |                            |                              |
| 841.000,00  | China Longyuan Power Group                         | 1.732.692,91               | 0,03                         |                       |              |                            |                              |
| 1.535.000,00  | China Mobile                                       | 8.132.207,43               | 0,16                         |                       |              |                            |                              |
| 3.098.500,00  | China Overseas Land & Investment                   | 6.474.964,80               | 0,13                         |                       |              |                            |                              |
| 1.457.500,00  | China Railway Construction                         | 841.458,99                 | 0,02                         |                       |              |                            |                              |
| 1.104.000,00  | China Resources Land                               | 4.099.181,35               | 0,08                         |                       |              |                            |                              |
| 11.056.000,00   | China Telecom                                      | 3.254.060,27               | 0,07                         |                       |              |                            |                              |
| 2.846.000,00  | CRRC   | 1.079.279,47               | 0,02                         |                       |              |                            |                              |
| 4.200,00  | ENN Energy Holdings                                | 69.795,84                  | 0,00                         |                       |              |                            |                              |
| 643.000,00  | Hengan International Group                         | 2.922.474,55               | 0,06                         |                       |              |                            |                              |
| 14.620.000,00   | Industrial & Commercial Bank of China              | 7.282.060,19               | 0,15                         |                       |              |                            |                              |
| 1.692.000,00  | Ping An Insurance Group Co of China                | 10.754.849,42              | 0,22                         |                       |              |                            |                              |
| 3.071.600,00  | Sinopharm Group                                    | 5.897.184,59               | 0,12                         |                       |              |                            |                              |
| 532.000,00  | Techtronic Industries                              | 9.346.684,09               | 0,19                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>76.260.771,52</b>       | <b>1,53</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>IDR</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 46.490.460,00   | Telkom Indonesia Persero                           | 11.635.539,35              | 0,23                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>11.635.539,35</b>       | <b>0,23</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>INR</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 204.116,00  | Axis Bank  | 1.645.000,47               | 0,03                         |                       |              |                            |                              |
| 709.975,00  | HCL Technologies                                   | 11.123.152,69              | 0,22                         |                       |              |                            |                              |
| 886.613,00  | Infosys  | 19.878.595,47              | 0,40                         |                       |              |                            |                              |
| 2.928.253,00  | Power Grid Corp of India                           | 7.108.805,15               | 0,14                         |                       |              |                            |                              |
| 849.665,00  | UPL  | 7.539.344,49               | 0,15                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>47.294.898,27</b>       | <b>0,95</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>JPY</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 261.700,00  | Hoya   | 34.336.068,11              | 0,69                         |                       |              |                            |                              |
| 700.800,00  | KDDI   | 18.067.107,64              | 0,36                         |                       |              |                            |                              |
| 861.200,00  | Nippon Telegraph & Telephone                       | 20.802.302,36              | 0,42                         |                       |              |                            |                              |
| 310.900,00  | Seven & i Holdings                                 | 12.053.817,64              | 0,24                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>85.259.295,75</b>       | <b>1,72</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>KRW</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 76.059,00   | BNK Financial Group                                | 474.507,76                 | 0,01                         |                       |              |                            |                              |
| 41.145,00   | Hyundai Glovis                                     | 5.133.809,77               | 0,10                         |                       |              |                            |                              |
| 25.538,00   | Hyundai Mobis                                      | 4.827.119,98               | 0,10                         |                       |              |                            |                              |
| 22.478,00   | LG   | 1.350.577,82               | 0,03                         |                       |              |                            |                              |
| 10.900,00   | LX Holdings  | 80.954,30                  | 0,00                         |                       |              |                            |                              |
| 280.618,00  | Samsung Electronics                                | 16.318.893,61              | 0,33                         |                       |              |                            |                              |
| 46.611,00   | Samsung Fire & Marine Insurance                    | 6.992.833,92               | 0,14                         |                       |              |                            |                              |
| 183.457,00  | SK Square  | 9.047.233,32               | 0,18                         |                       |              |                            |                              |
| 180.763,00  | SK Telecom   | 7.773.230,18               | 0,16                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>51.999.160,66</b>       | <b>1,05</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>MXN</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 281.100,00  | Grupo Financiero Banorte                           | 1.624.782,43               | 0,03                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>1.624.782,43</b>        | <b>0,03</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>PHP</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 22.525,00   | PLDT   | 706.676,92                 | 0,01                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>706.676,92</b>          | <b>0,01</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>THB</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 467.700,00  | Advanced Info Service                              | 2.843.072,49               | 0,06                         |                       |              |                            |                              |
| 684.300,00  | Bangkok Bank                                       | 2.197.432,51               | 0,04                         |                       |              |                            |                              |
| 84.700,00   | Bangkok Bank                                       | 271.989,67                 | 0,01                         |                       |              |                            |                              |
| 2.261.500,00  | Thai Union Group                                   | 1.165.531,27               | 0,02                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>6.478.025,94</b>        | <b>0,13</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>TRY</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 5.100.864,00  | Akbank TAS   | 2.399.891,12               | 0,05                         |                       |              |                            |                              |
| 227.627,00  | BIM Birlesik Magazalar                             | 918.602,30                 | 0,02                         |                       |              |                            |                              |
| 2.960.097,00  | Turkcell Iletisim Hizmetleri                       | 3.482.690,41               | 0,07                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>6.801.183,83</b>        | <b>0,14</b>                  |                       |              |                            |                              |
| <b>TWD</b>  |  |                            |                              |                       |              |                            |                              |
| 889.000,00  | Taiwan Semiconductor Manufacturing                 | 17.446.931,66              | 0,35                         |                       |              |                            |                              |
|   |  | <b>17.446.931,66</b>       | <b>0,35</b>                  |                       |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor   |              |
|------------------------|--------------|--|--------------|
| USA                    | 43,97        | Staatsanleihen                                       | 18,15        |
| Deutschland            | 10,82        | Pharmazeutika  | 8,36         |
| Vereinigtes Königreich | 4,44         | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen  | 5,88         |
| Dänemark               | 4,05         | Alkoholfreie Getränke                                | 4,53         |
| Schweiz                | 3,47         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                  | 3,20         |
| Japan                  | 1,72         | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen            | 2,23         |
| Irland                 | 1,22         | Halbleiter   | 2,10         |
| Frankreich             | 1,09         | Systemsoftware                                       | 1,98         |
| Republik Korea         | 1,07         | Gesundheitswesen: Managed Health Care                | 1,75         |
| Indien                 | 1,04         | Restaurants  | 1,69         |
| China                  | 0,99         | Verschiedene Banken                                  | 1,56         |
| Kanada                 | 0,97         | Interaktive Medien und Dienstleistungen              | 1,56         |
| Hongkong               | 0,54         | Haushaltsprodukte                                    | 1,50         |
| Taiwan, Provinz Chinas | 0,35         | Schuhe   | 1,36         |
| Kaimaninseln           | 0,33         | Kraftfahrzeugeinzelhandel                            | 1,27         |
| Israel                 | 0,27         | Integrierte Telekommunikationsdienste                | 1,25         |
| Indonesien             | 0,23         | Internet-Dienste und -Infrastruktur                  | 1,08         |
| Südafrika              | 0,22         | Luftfracht und Logistik                              | 1,06         |
| Niederlande            | 0,16         | Gesundheitswesen: Ausstattung                        | 1,05         |
| Spanien                | 0,16         | Produkte für den persönlichen Gebrauch               | 0,90         |
| Türkei                 | 0,14         | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                   | 0,89         |
| Thailand               | 0,13         | Drahtlose Telekommunikationsdienste                  | 0,86         |
| Brasilien              | 0,09         | Bekleidung-Einzelhandel                              | 0,80         |
| Bermuda                | 0,05         | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie     | 0,73         |
| Mexiko                 | 0,03         | Gesundheitswesen: Produkte                           | 0,69         |
| Philippinen            | 0,01         | Großmärkte   | 0,69         |
|                        |              | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)          | 0,62         |
| <b>Summe</b>           | <b>77,57</b> | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen            | 0,61         |
|                        |              | Bau- und Ingenieurwesen                              | 0,60         |
|                        |              | Mehrsparren-Versorger                                | 0,60         |
|                        |              | Rückversicherungen                                   | 0,54         |
|                        |              | Versicherungsmakler                                  | 0,53         |
|                        |              | Mehrsparrenversicherungen                            | 0,53         |
|                        |              | Biotechnologie                                       | 0,50         |
|                        |              | Kabel und Satellitenübertragung                      | 0,48         |
|                        |              | Handelsgesellschaften und Großhändler                | 0,47         |
|                        |              | Landwirtschafts- und Landmaschinen                   | 0,45         |
|                        |              | Kommunikationsanlagen                                | 0,45         |
|                        |              | Anwendungssoftware                                   | 0,44         |
|                        |              | Warenhäuser  | 0,42         |
|                        |              | Industriekonglomerate                                | 0,42         |
|                        |              | Sach- und Unfallversicherung                         | 0,32         |
|                        |              | Stromversorger                                       | 0,30         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Technologie                        | 0,28         |
|                        |              | Lebensmitteleinzelhandel                             | 0,26         |
|                        |              | Lebens- und Krankenversicherung                      | 0,26         |
|                        |              | Landwirtschaftliche Produkte                         | 0,24         |
|                        |              | Immobilienentwicklung                                | 0,21         |
|                        |              | Industriemaschinen                                   | 0,19         |
|                        |              | Dünger und Chemikalien für die Landwirtschaft        | 0,15         |
|                        |              | Vermögensverwaltung und Depotbanken                  | 0,12         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Vertrieb                           | 0,12         |
|                        |              | Autoteile und -zubehör                               | 0,10         |
|                        |              | Gasversorger   | 0,06         |
|                        |              | Einzelhandel: Heimwerker und Garten                  | 0,05         |
|                        |              | Wasserversorger                                      | 0,04         |
|                        |              | Erneuerbare Elektrizität                             | 0,03         |
|                        |              | Baummaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 0,02         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Einrichtungen                      | 0,01         |
|                        |              | Freizeiteinrichtungen                                | 0,01         |
|                        |              | Sonstige verschiedene Finanzdienstleistungen         | 0,01         |
|                        |              | Regionale Banken                                     | 0,01         |
|                        |              | <b>Summe</b>   | <b>77,57</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 3.794.512,61                                      | CHF                | 3.624.587,51      | EUR                  | 49.593,55   | 28.01.2022  |
| 142.509,87  | EUR                | 148.569,37        | CHF                  | (1.347,78)  | 28.01.2022  |
| 13.391.826,79                                     | EUR                | 11.357.105,17     | GBP                  | (119.437,51)  | 28.01.2022  |
| 3.921.548,64                                      | EUR                | 505.121.109,00    | JPY                  | 49.549,54   | 28.01.2022  |
| 594.419,64  | EUR                | 6.033.192,80      | NOK                  | (9.235,22)  | 28.01.2022  |
| 305.722.519,92                                    | EUR                | 3.146.296.831,42  | SEK                  | (1.075.607,09)  | 28.01.2022  |
| 751.837,78  | EUR                | 1.159.581,19      | SGD                  | (6.200,32)  | 28.01.2022  |
| 24.142.209,00                                     | EUR                | 27.301.524,94     | USD                  | 51.479,92   | 28.01.2022  |
| 284.611.012,91                                    | GBP                | 337.296.874,05    | EUR                  | 1.296.866,45  | 28.01.2022  |
| 12.884.113.039,00                                 | JPY                | 99.626.436,04     | EUR                  | (863.234,23)  | 28.01.2022  |
| 151.364.796,21                                    | NOK                | 14.995.219,14     | EUR                  | 149.637,57  | 28.01.2022  |
| 6.845.747.683,42                                  | SEK                | 670.784.186,84    | EUR                  | (3.252.279,65)  | 28.01.2022  |
| 30.248.698,16                                     | SGD                | 19.628.214,41     | EUR                  | 145.869,87  | 28.01.2022  |
| 545.261.874,93                                    | USD                | 483.882.766,46    | EUR                  | (2.747.297,72)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(6.331.642,62)</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 6.974.000,00                                      | GBP                | 81.122.607,13     | NOK                  | 178.435,72  | 14.01.2022  |
| 23.115.478.680,00                                 | KRW                | 19.386.000,00     | USD                  | 21.927,90   | 14.01.2022  |
| 83.835.455,68                                     | NOK                | 1.055.436.000,00  | JPY                  | 300.656,04  | 14.01.2022  |
| 19.272.000,00                                     | USD                | 22.799.739.600,00 | KRW                  | 111.504,34  | 14.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>612.524,00</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 9.587.825,64                                      | AUD                | 6.097.000,00      | EUR                  | 36.493,87   | 14.01.2022  |
| 195.123.000,00                                    | AUD                | 1.247.523.017,60  | SEK                  | 3.155.726,64  | 14.01.2022  |
| 13.429.000,00                                     | AUD                | 9.879.813,33      | USD                  | (129.621,97)  | 14.01.2022  |
| 55.179.815,75                                     | BRL                | 9.678.000,00      | USD                  | 169.780,80  | 14.01.2022  |
| 16.191.000,00                                     | CAD                | 111.468.865,77    | NOK                  | 80.976,80   | 14.01.2022  |
| 2.070.804.012,87                                  | CZK                | 81.286.000,00     | EUR                  | 1.838.441,77  | 14.01.2022  |
| 8.169.000,00                                      | EUR                | 2.936.655.388,91  | HUF                  | 227.712,32  | 14.01.2022  |
| 6.021.291,59                                      | EUR                | 800.000.000,00    | JPY                  | (112.239,64)  | 14.01.2022  |
| 58.900.000,00                                     | EUR                | 271.814.326,88    | PLN                  | (171.951,19)  | 14.01.2022  |
| 28.711.000,00                                     | EUR                | 296.341.195,17    | SEK                  | (190.599,44)  | 14.01.2022  |
| 338.323.796,68                                    | EUR                | 538.164.084,93    | SGD                  | (13.614.046,23)   | 14.01.2022  |
| 8.149.255,28                                      | GBP                | 9.582.000,00      | EUR                  | 115.917,12  | 14.01.2022  |
| 31.934.000,00                                     | GBP                | 4.890.249.373,00  | JPY                  | 509.717,23  | 14.01.2022  |
| 2.015.000,00                                      | GBP                | 23.996.013,78     | SEK                  | 57.650,30   | 14.01.2022  |
| 19.539.392.810,41                                 | HUF                | 55.558.068,89     | EUR                  | (2.720.057,00)  | 14.01.2022  |
| 2.185.431.262,00                                  | JPY                | 25.467.000,00     | CAD                  | (923.878,76)  | 14.01.2022  |
| 4.271.944.799,00                                  | JPY                | 33.125.298,96     | EUR                  | (372.914,67)  | 14.01.2022  |
| 3.207.172.000,00                                  | JPY                | 257.558.434,61    | SEK                  | (530.286,54)  | 14.01.2022  |
| 22.908.159.920,00                                 | KRW                | 19.366.000,00     | USD                  | (114.113,94)  | 14.01.2022  |
| 149.536.854,17                                    | MXN                | 7.217.000,00      | USD                  | 71.769,34   | 14.01.2022  |
| 153.436.357,13                                    | NOK                | 23.678.000,00     | AUD                  | 212.845,56  | 14.01.2022  |
| 37.284.985,22                                     | NOK                | 5.332.000,00      | CAD                  | 31.028,69   | 14.01.2022  |
| 202.729.063,29                                    | NOK                | 2.517.329.000,00  | JPY                  | 994.707,25  | 14.01.2022  |
| 264.419.502,43                                    | NOK                | 43.370.000,00     | NZD                  | 338.275,08  | 14.01.2022  |
| 1.315.297.000,00                                  | NOK                | 1.343.485.238,50  | SEK                  | 642.640,21  | 14.01.2022  |
| 23.112.910,80                                     | NZD                | 22.109.000,00     | AUD                  | (217.200,89)  | 14.01.2022  |
| 5.799.159,50                                      | NZD                | 3.518.000,00      | EUR                  | (23.810,55)   | 14.01.2022  |
| 28.081.000,00                                     | NZD                | 170.699.594,34    | NOK                  | (168.409,96)  | 14.01.2022  |
| 142.103.000,00                                    | NZD                | 862.314.128,21    | SEK                  | 1.522.663,43  | 14.01.2022  |
| 89.107.052,35                                     | PLN                | 19.238.000,00     | EUR                  | 127.176,37  | 14.01.2022  |
| 418.740.522,48                                    | SEK                | 60.451.000,00     | CAD                  | (1.126.194,61)  | 14.01.2022  |
| 20.717.329,02                                     | SGD                | 13.024.216,23     | EUR                  | 524.090,49  | 14.01.2022  |
| 6.725.473,03                                      | USD                | 9.378.000,00      | AUD                  | (63.090,07)   | 14.01.2022  |
| 40.309.782,04                                     | USD                | 34.662.000,00     | EUR                  | 917.322,90  | 14.01.2022  |
| 9.622.000,00                                      | USD                | 30.415.428,74     | ILS                  | (154.188,83)  | 14.01.2022  |
| 18.839.000,00                                     | USD                | 22.341.056.681,00 | KRW                  | 69.278,40   | 14.01.2022  |
| 29.927.000,00                                     | USD                | 624.932.353,99    | MXN                  | (506.262,37)  | 14.01.2022  |
| 26.826.018,65                                     | USD                | 37.393.000,00     | NZD                  | 1.147.467,67  | 14.01.2022  |
| 93.724.000,00                                     | USD                | 850.358.774,02    | SEK                  | (209.110,47)  | 14.01.2022  |
| 38.565.180,51                                     | EUR                | 45.000.000,00     | USD                  | (1.146.361,83)  | 24.01.2022  |
| 39.561.193,22                                     | CHF                | 63.571.000,00     | NZD                  | 25.698,37   | 01.02.2022  |
| 108.837.000,00                                    | EUR                | 113.531.738,41    | CHF                  | (1.097.064,35)  | 01.02.2022  |
| 35.114.000,00                                     | EUR                | 359.097.977,12    | NOK                  | (810.745,56)  | 01.02.2022  |
| 13.813.000,00                                     | EUR                | 15.666.493,26     | USD                  | (9.926,06)  | 01.02.2022  |
| 6.839.131,61                                      | GBP                | 8.067.000,00      | EUR                  | 68.595,45   | 01.02.2022  |
| 4.630.077.851,00                                  | JPY                | 37.385.000,00     | CHF                  | (710.280,61)  | 01.02.2022  |
| 1.400.345.192,00                                  | JPY                | 17.446.000,00     | NZD                  | 228.233,07  | 01.02.2022  |
| 150.572.546,64                                    | NOK                | 1.918.696.000,00  | JPY                  | 356.438,91  | 01.02.2022  |
| 324.256.885,66                                    | NOK                | 35.828.000,00     | USD                  | 827.344,33  | 01.02.2022  |
| 9.038.000,00                                      | NZD                | 6.105.651,63      | USD                  | 55.438,58   | 01.02.2022  |
| 110.073.940,20                                    | SEK                | 11.574.000,00     | CHF                  | (474.532,30)  | 01.02.2022  |
| 68.740.669,06                                     | SEK                | 11.265.000,00     | NZD                  | (81.029,63)   | 01.02.2022  |
| 977.170.630,96                                    | SEK                | 107.958.000,00    | USD                  | 26.513,54   | 01.02.2022  |
| 247.432.000,00                                    | USD                | 28.180.321.611,00 | JPY                  | 2.310.107,90  | 01.02.2022  |
| 9.993.156,87                                      | EUR                | 11.335.000,00     | USD                  | (3.722,19)  | 22.02.2022  |
| 735.687.151,10                                    | INR                | 9.677.000,00      | USD                  | 131.277,02  | 22.02.2022  |
| 50.936.500,00                                     | USD                | 3.870.817.444,50  | INR                  | (672.202,50)  | 22.02.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                             | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|--|-------------|
| 46.555.191,51                                 | USD                | 55.431.185.044,00 | KRW                  | 46.465,07  | 22.02.2022  |
| 1.800.000,00                                  | AUD                | 1.153.516,74      | EUR                  | (2.954,06)   | 28.02.2022  |
| 10.000.000,00                                 | CHF                | 9.533.472,83      | EUR                  | 151.116,75   | 28.02.2022  |
| 30.259.995,88                                 | EUR                | 47.265.000,00     | AUD                  | 48.105,46  | 28.02.2022  |
| 157.415.780,17                                | EUR                | 165.100.000,00    | CHF                  | (2.476.774,05)   | 28.02.2022  |
| 3.398.456,91                                  | EUR                | 35.000.000,00     | SEK                  | (13.116,22)  | 28.02.2022  |
| 482.544.380,43                                | EUR                | 545.375.000,00    | USD                  | 1.612.539,37   | 28.02.2022  |
| 18.678.971,05                                 | CAD                | 12.903.116,67     | EUR                  | 50.588,92  | 01.03.2022  |
| 516.216,09                                    | EUR                | 747.291,19        | CAD                  | (2.023,91)   | 01.03.2022  |
| 9.643.000,00                                  | EUR                | 10.040.961,79     | CHF                  | (81.233,66)  | 01.03.2022  |
| 35.679.000,00                                 | EUR                | 368.101.131,41    | SEK                  | (200.722,72)   | 01.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(10.400.521,80)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |                    |                   |                      |  |             |
| 12.983.412,75                                 | AUD                | 8.043.000,00      | EUR                  | 262.762,94   | 14.01.2022  |
| 23.643.188,71                                 | AUD                | 12.687.000,00     | GBP                  | 26.974,68  | 14.01.2022  |
| 26.150.000,00                                 | AUD                | 19.059.830,52     | USD                  | (94.451,41)  | 14.01.2022  |
| 53.965.689,50                                 | BRL                | 9.501.000,00      | USD                  | 134.309,98   | 14.01.2022  |
| 19.634.492,14                                 | CAD                | 13.087.087,63     | EUR                  | 543.227,83   | 14.01.2022  |
| 2.360.103,36                                  | CAD                | 1.378.000,00      | GBP                  | (1.493,51)   | 14.01.2022  |
| 32.982.000,00                                 | CAD                | 233.589.474,02    | NOK                  | (488.004,89)   | 14.01.2022  |
| 3.849.000,00                                  | CAD                | 27.153.929,05     | SEK                  | 23.697,43  | 14.01.2022  |
| 10.454.000,00                                 | EUR                | 16.756.528,43     | AUD                  | (265.485,73)   | 14.01.2022  |
| 266.865.724,32                                | EUR                | 400.109.938,09    | CAD                  | (10.891.588,59)  | 14.01.2022  |
| 174.342.174,72                                | EUR                | 149.667.875,41    | GBP                  | (3.768.588,51)   | 14.01.2022  |
| 20.971.000,00                                 | EUR                | 7.778.914.600,60  | HUF                  | (64.870,21)  | 14.01.2022  |
| 200.751.492,68                                | EUR                | 26.103.957.496,00 | JPY                  | 615.791,28   | 14.01.2022  |
| 25.819.527,61                                 | EUR                | 620.235.014,02    | MXN                  | (899.295,81)   | 14.01.2022  |
| 76.561.643,11                                 | EUR                | 348.003.292,60    | PLN                  | 932.247,66   | 14.01.2022  |
| 11.848.000,00                                 | GBP                | 20.312.768,06     | CAD                  | (1.514,87)   | 14.01.2022  |
| 3.183.728.734,40                              | HUF                | 8.663.000,00      | EUR                  | (53.528,34)  | 14.01.2022  |
| 31.373.394,23                                 | ILS                | 8.263.750,33      | EUR                  | 655.687,80   | 14.01.2022  |
| 29.990.763,00                                 | ILS                | 9.640.000,00      | USD                  | 17.536,31  | 14.01.2022  |
| 147.660.643.942,00                            | JPY                | 1.135.423.910,12  | EUR                  | (3.328.610,57)   | 14.01.2022  |
| 2.903.795.097,00                              | JPY                | 19.193.000,00     | GBP                  | (577.419,53)   | 14.01.2022  |
| 4.243.770.300,00                              | JPY                | 38.500.000,00     | USD                  | (1.445.600,11)   | 14.01.2022  |
| 11.519.064.270,00                             | KRW                | 9.693.000,00      | USD                  | (17.708,42)  | 14.01.2022  |
| 3.313.189.864,05                              | MXN                | 137.923.521,32    | EUR                  | 4.803.885,12   | 14.01.2022  |
| 126.160.188,80                                | NOK                | 18.400.000,00     | CAD                  | (143.773,14)   | 14.01.2022  |
| 82.300.438,08                                 | NOK                | 13.796.000,00     | NZD                  | (73.776,56)  | 14.01.2022  |
| 14.141.000,00                                 | NZD                | 12.159.322,68     | CAD                  | 79.518,18  | 14.01.2022  |
| 18.510.000,00                                 | NZD                | 112.443.603,99    | NOK                  | (103.448,00)   | 14.01.2022  |
| 16.659.000,00                                 | NZD                | 101.077.379,84    | SEK                  | 179.803,63   | 14.01.2022  |
| 14.289.000,00                                 | NZD                | 9.651.615,08      | USD                  | 90.727,04  | 14.01.2022  |
| 134.831.195,34                                | PLN                | 29.521.887,48     | EUR                  | (219.824,48)   | 14.01.2022  |
| 140.849.347,47                                | SEK                | 16.185.000,00     | USD                  | (548.945,17)   | 14.01.2022  |
| 19.706.424,96                                 | USD                | 27.186.000,00     | AUD                  | 2.393,25   | 14.01.2022  |
| 9.425.000,00                                  | USD                | 54.403.965,20     | BRL                  | (270.620,42)   | 14.01.2022  |
| 46.008.613,37                                 | USD                | 40.216.000,00     | EUR                  | 393.213,76   | 14.01.2022  |
| 35.955.000,00                                 | USD                | 752.084.341,92    | MXN                  | (663.215,14)   | 14.01.2022  |
| 3.094.724.530,00                              | ZAR                | 181.828.703,29    | EUR                  | (10.908.247,13)  | 14.01.2022  |
| 11.086.536,90                                 | EUR                | 13.000.000,00     | USD                  | (385.710,40)   | 24.01.2022  |
| 28.288.000,00                                 | AUD                | 25.756.195,71     | CAD                  | 217.831,47   | 01.02.2022  |
| 43.508.000,00                                 | AUD                | 31.103.342,75     | USD                  | 381.304,49   | 01.02.2022  |
| 3.628.210,18                                  | CAD                | 3.934.000,00      | AUD                  | 1.859,25   | 01.02.2022  |
| 66.376.857,51                                 | CAD                | 46.099.521,84     | EUR                  | (38.437,05)  | 01.02.2022  |
| 21.920.000,00                                 | CHF                | 2.698.838.624,00  | JPY                  | 538.572,30   | 01.02.2022  |
| 13.415.000,00                                 | CHF                | 132.446.134,02    | SEK                  | 75.515,32  | 01.02.2022  |
| 15.090.000,00                                 | EUR                | 23.612.394,39     | AUD                  | (10.639,47)  | 01.02.2022  |
| 428.599.713,86                                | EUR                | 617.123.584,00    | CAD                  | 357.359,63   | 01.02.2022  |
| 253.122.505,03                                | EUR                | 214.380.055,41    | GBP                  | (1.896.476,92)   | 01.02.2022  |
| 324.918.156,59                                | EUR                | 3.180.055.228,09  | NOK                  | 6.788.486,69   | 01.02.2022  |
| 1.389.000,00                                  | GBP                | 208.578.352,00    | JPY                  | 53.545,47  | 01.02.2022  |
| 47.420.175.752,00                             | JPY                | 357.399.897,14    | EUR                  | 6.086.461,43   | 01.02.2022  |
| 2.951.266.375,00                              | JPY                | 19.625.000,00     | GBP                  | (723.634,10)   | 01.02.2022  |
| 30.845.379,21                                 | NOK                | 4.341.000,00      | CAD                  | 73.459,97  | 01.02.2022  |
| 323.942.200,22                                | NOK                | 33.098.388,23     | EUR                  | (691.521,74)   | 01.02.2022  |
| 26.679.171,31                                 | NOK                | 3.142.000,00      | USD                  | (103.330,09)   | 01.02.2022  |
| 547.613.672,38                                | SEK                | 6.857.300.000,00  | JPY                  | 834.106,60   | 01.02.2022  |
| 17.629.000,00                                 | USD                | 160.160.628,51    | SEK                  | (62.240,03)  | 01.02.2022  |
| 64.884.345.833,00                             | CLP                | 79.098.890,76     | USD                  | (3.141.666,15)   | 22.02.2022  |
| 196.449.801,15                                | EUR                | 223.400.000,00    | USD                  | (577.845,76)   | 22.02.2022  |
| 11.126.622.649,80                             | INR                | 147.978.117,72    | USD                  | 553.701,08   | 22.02.2022  |
| 14.064.074.010,10                             | RUB                | 184.820.136,19    | USD                  | 505.963,66   | 22.02.2022  |
| 83.983.862,60                                 | SGD                | 61.302.000,00     | USD                  | 801.337,19   | 22.02.2022  |
| 24.300.000,00                                 | USD                | 21.498.693,26     | EUR                  | (67.433,97)  | 22.02.2022  |
| 16.188.587,68                                 | USD                | 1.217.236.096,30  | INR                  | (60.574,08)  | 22.02.2022  |
| 53.479.558,82                                 | USD                | 4.075.554.175,00  | RUB                  | (215.912,07)   | 22.02.2022  |
| 21.442.000,00                                 | USD                | 331.922.160,00    | TRY                  | (1.892.130,12)   | 22.02.2022  |
| 7.900.000,00                                  | AUD                | 4.999.025,30      | EUR                  | 50.735,89  | 28.02.2022  |
| 3.845.020,06                                  | EUR                | 6.000.000,00      | AUD                  | 9.811,10   | 28.02.2022  |
| 6.950.158,78                                  | EUR                | 10.000.000,00     | CAD                  | 15.131,42  | 28.02.2022  |
| 226.204.555,85                                | EUR                | 190.880.000,00    | GBP                  | (698.099,87)   | 28.02.2022  |
| 8.485.138,56                                  | EUR                | 86.043.148,80     | SEK                  | 98.352,52  | 28.02.2022  |
| 35.229.493,29                                 | EUR                | 40.000.000,00     | USD                  | (44.162,85)  | 28.02.2022  |
| 30.000.000,00                                 | HKD                | 3.384.548,32      | EUR                  | 7.854,26   | 28.02.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                                | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|--|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| 5.994.760,81                                     | CAD                | 4.115.000,00      | EUR                  | 42.343,95   | 01.03.2022  |
| 19.213.094,19                                    | CHF                | 18.453.069,46     | EUR                  | 153.972,86  | 01.03.2022  |
| 13.032.215,75                                    | EUR                | 13.568.972,31     | CHF                  | (108.741,11)  | 01.03.2022  |
| 8.026.127,80                                     | EUR                | 1.032.521.131,00  | JPY                  | 114.666,62  | 01.03.2022  |
| 16.904.891,70                                    | EUR                | 417.202.770,21    | MXN                  | (905.674,54)  | 01.03.2022  |
| 493.850,87                                       | EUR                | 5.075.034,79      | NOK                  | (13.312,45)   | 01.03.2022  |
| 12.918.519,41                                    | EUR                | 132.100.477,62    | SEK                  | 42.487,89   | 01.03.2022  |
| 32.103.000,00                                    | EUR                | 36.392.304,30     | USD                  | 11.466,81   | 01.03.2022  |
| 3.028.249,00                                     | JPY                | 23.539,58         | EUR                  | (336,30)  | 01.03.2022  |
| 450.798.689,59                                   | SEK                | 44.085.015,64     | EUR                  | (144.991,79)  | 01.03.2022  |
| 598.000,00                                       | USD                | 773.546,43        | CAD                  | (9.125,84)  | 01.03.2022  |
| 159.000,00                                       | USD                | 18.064.810,00     | JPY                  | 1.791,96  | 01.03.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(20.042.110,52)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                    |                   |                      |   |             |
| 41.330.000,00                                    | AUD                | 30.661.239,12     | USD                  | (623.584,74)  | 14.01.2022  |
| 52.614.476,37                                    | BRL                | 9.693.000,00      | USD                  | (248.584,58)  | 14.01.2022  |
| 46.485.299,82                                    | CAD                | 35.930.000,00     | USD                  | 556.718,70  | 14.01.2022  |
| 1.007.703.875,11                                 | EUR                | 1.614.621.749,60  | AUD                  | (25.201.792,25)   | 14.01.2022  |
| 12.226.303,40                                    | EUR                | 1.600.000.000,00  | JPY                  | (40.711,95)   | 14.01.2022  |
| 7.270.868,48                                     | EUR                | 84.722.471,70     | TRY                  | 1.768.077,77  | 14.01.2022  |
| 36.229.000,00                                    | EUR                | 40.956.449,75     | USD                  | 79.156,76   | 14.01.2022  |
| 35.974.000,00                                    | GBP                | 432.344.777,32    | SEK                  | 644.731,43  | 14.01.2022  |
| 14.618.000,00                                    | GBP                | 19.383.848,07     | USD                  | 286.995,05  | 14.01.2022  |
| 3.711.189.078,00                                 | JPY                | 24.559.000,00     | GBP                  | (772.998,63)  | 14.01.2022  |
| 1.117.740.782,00                                 | JPY                | 13.951.000,00     | NZD                  | 163.660,92  | 14.01.2022  |
| 3.555.663.978,00                                 | JPY                | 31.237.000,00     | USD                  | (310.310,90)  | 14.01.2022  |
| 198.206.459,98                                   | MXN                | 9.311.000,00      | USD                  | 320.179,48  | 14.01.2022  |
| 136.058.332,06                                   | NOK                | 21.124.000,00     | AUD                  | 106.998,73  | 14.01.2022  |
| 88.135.390,50                                    | NOK                | 8.625.000,00      | EUR                  | 197.980,47  | 14.01.2022  |
| 1.227.585.000,00                                 | NOK                | 1.258.960.845,02  | SEK                  | 105.448,14  | 14.01.2022  |
| 40.672.167,83                                    | NOK                | 4.747.000,00      | USD                  | (118.379,37)  | 14.01.2022  |
| 13.360.000,00                                    | NZD                | 1.044.360.552,00  | JPY                  | 42.891,23   | 14.01.2022  |
| 27.149.000,00                                    | NZD                | 19.419.191,02     | USD                  | (782.167,08)  | 14.01.2022  |
| 39.483.422,78                                    | PLN                | 8.424.000,00      | EUR                  | 156.754,49  | 14.01.2022  |
| 12.447.739,56                                    | SGD                | 9.096.000,00      | USD                  | 111.765,65  | 14.01.2022  |
| 819.826,99                                       | USD                | 1.116.000,00      | AUD                  | 9.692,89  | 14.01.2022  |
| 57.041.717,31                                    | USD                | 48.362.000,00     | EUR                  | 1.985.897,82  | 14.01.2022  |
| 9.663.179,27                                     | USD                | 7.232.000,00      | GBP                  | (77.219,28)   | 14.01.2022  |
| 9.815.000,00                                     | USD                | 11.551.469.800,00 | KRW                  | 101.392,80  | 14.01.2022  |
| 63.315.000,00                                    | USD                | 978.693.575,26    | ZAR                  | 1.831.160,55  | 14.01.2022  |
| 478.040.347,49                                   | EUR                | 562.582.500,00    | USD                  | (18.428.535,92)   | 24.01.2022  |
| 40.179.000,00                                    | EUR                | 410.038.266,55    | NOK                  | (841.845,53)  | 01.02.2022  |
| 139.867.608,17                                   | EUR                | 161.578.617,45    | USD                  | (2.698.644,41)  | 01.02.2022  |
| 19.353.486,54                                    | NOK                | 3.029.000,00      | AUD                  | (982,59)  | 01.02.2022  |
| 17.496.470,76                                    | NOK                | 2.455.000,00      | CAD                  | 46.773,57   | 01.02.2022  |
| 125.213.634,40                                   | NOK                | 12.259.000,00     | EUR                  | 267.566,69  | 01.02.2022  |
| 51.028.000,00                                    | USD                | 65.903.733,59     | CAD                  | (709.989,16)  | 01.02.2022  |
| 399.878.711,59                                   | EUR                | 458.800.000,00    | USD                  | (4.804.128,56)  | 17.02.2022  |
| 29.938.579,73                                    | BRL                | 5.167.000,00      | USD                  | 123.403,64  | 22.02.2022  |
| 50.936.500,00                                    | USD                | 3.872.065.388,75  | INR                  | (686.915,01)  | 22.02.2022  |
| 4.600.000,00                                     | AUD                | 2.901.358,85      | EUR                  | 39.018,76   | 28.02.2022  |
| 7.585.095,29                                     | EUR                | 12.000.000,00     | AUD                  | (85.437,16)   | 28.02.2022  |
| 62.737.925,83                                    | EUR                | 90.115.000,00     | CAD                  | 243.043,04  | 28.02.2022  |
| 208.968.778,64                                   | EUR                | 1.553.985.000,00  | DKK                  | (12.328,45)   | 28.02.2022  |
| 20.000.000,00                                    | HKD                | 2.260.259,88      | EUR                  | 1.337,59  | 28.02.2022  |
| 50.000.000,00                                    | USD                | 44.124.979,59     | EUR                  | (33.005,59)   | 28.02.2022  |
| 17.126.269,73                                    | EUR                | 61.033.486,85     | ILS                  | (216.202,41)  | 01.03.2022  |
| 32.913.885,97                                    | EUR                | 601.671.759,95    | ZAR                  | (71.554,79)   | 01.03.2022  |
| 98.874.968,07                                    | ILS                | 27.744.758,82     | EUR                  | 350.250,45  | 01.03.2022  |
| 7.817.000,00                                     | USD                | 70.962.178,81     | NOK                  | (198.270,00)  | 01.03.2022  |
| 225.593.646,13                                   | ZAR                | 12.340.887,57     | EUR                  | 26.829,09   | 01.03.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(47.395.862,65)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 8.052.688,34                                     | AUD                | 5.115.000,00      | EUR                  | 36.442,12   | 14.01.2022  |
| 43.350.272,55                                    | AUD                | 23.007.000,00     | GBP                  | 352.846,60  | 14.01.2022  |
| 214.123.000,00                                   | AUD                | 17.536.018.042,00 | JPY                  | 2.532.024,74  | 14.01.2022  |
| 33.019.000,00                                    | AUD                | 24.279.365,99     | USD                  | (307.276,23)  | 14.01.2022  |
| 18.943.073,29                                    | CAD                | 11.106.000,00     | GBP                  | (66.333,57)   | 14.01.2022  |
| 2.304.000,00                                     | CAD                | 16.370.107,32     | SEK                  | 2.884,10  | 14.01.2022  |
| 2.089.316,13                                     | CHF                | 2.917.000,00      | CAD                  | (2.087,09)  | 14.01.2022  |
| 92.242.952,37                                    | CHF                | 84.973.002,19     | EUR                  | 4.337.994,74  | 14.01.2022  |
| 9.302.000,00                                     | EUR                | 14.438.577,25     | AUD                  | 65.429,32   | 14.01.2022  |
| 103.969.969,45                                   | EUR                | 112.865.224,16    | CHF                  | (5.307.817,41)  | 14.01.2022  |
| 6.680.427,83                                     | EUR                | 860.000.000,00    | JPY                  | 86.934,97   | 14.01.2022  |
| 219.133.081,32                                   | EUR                | 2.254.486.730,37  | NOK                  | (6.557.484,38)  | 14.01.2022  |
| 675.105.994,88                                   | EUR                | 1.126.111.456,46  | NZD                  | (3.416.249,04)  | 14.01.2022  |
| 21.185.000,00                                    | EUR                | 98.140.066,36     | PLN                  | (143.275,58)  | 14.01.2022  |
| 299.045.693,88                                   | EUR                | 3.050.665.482,90  | SEK                  | 1.520.919,53  | 14.01.2022  |
| 138.166.328,74                                   | EUR                | 163.009.709,45    | USD                  | (5.714.275,73)  | 14.01.2022  |
| 11.708.000,00                                    | GBP                | 1.765.156.035,00  | JPY                  | 399.779,51  | 14.01.2022  |
| 15.840.000,00                                    | GBP                | 30.808.464,48     | NZD                  | 287.032,74  | 14.01.2022  |
| 578.000,00                                       | GBP                | 777.701,20        | USD                  | 1.408,39  | 14.01.2022  |
| 10.479.444.114,70                                | HUF                | 28.582.000,00     | EUR                  | (243.397,76)  | 14.01.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|----------------------------------|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| 1.300.000.000,00                 | JPY                | 10.121.361,62     | EUR                  | (154.459,73)  | 14.01.2022  |
| 2.599.259.496,00                 | JPY                | 16.950.000,00     | GBP                  | (242.925,77)  | 14.01.2022  |
| 29.414.119,63                    | MXN                | 1.375.000,00      | USD                  | 53.488,22   | 14.01.2022  |
| 29.087.935,11                    | NOK                | 2.933.000,00      | EUR                  | (21.112,63)   | 14.01.2022  |
| 21.065.061,41                    | NZD                | 20.395.000,00     | AUD                  | (354.663,65)  | 14.01.2022  |
| 91.334.436,14                    | NZD                | 54.918.744,39     | EUR                  | 113.463,10  | 14.01.2022  |
| 11.240.000,00                    | NZD                | 68.909.071,37     | NOK                  | (125.790,10)  | 14.01.2022  |
| 36.195.000,00                    | NZD                | 25.810.270,68     | USD                  | (972.718,26)  | 14.01.2022  |
| 260.070.447,71                   | PLN                | 56.534.000,00     | EUR                  | (14.328,97)   | 14.01.2022  |
| 28.484.721,10                    | SEK                | 3.021.000,00      | CHF                  | (146.921,74)  | 14.01.2022  |
| 4.627.008.678,21                 | SEK                | 453.581.462,58    | EUR                  | (2.319.365,59)  | 14.01.2022  |
| 81.602.246,91                    | SEK                | 6.882.000,00      | GBP                  | (231.370,17)  | 14.01.2022  |
| 449.740.103,96                   | SEK                | 49.601.000,00     | USD                  | 82.350,88   | 14.01.2022  |
| 11.902.352,39                    | USD                | 16.163.000,00     | AUD                  | 165.824,94  | 14.01.2022  |
| 19.023.000,00                    | USD                | 106.650.390,60    | BRL                  | (47.784,20)   | 14.01.2022  |
| 1.828.336.024,29                 | USD                | 1.541.312.597,81  | EUR                  | 72.471.289,16   | 14.01.2022  |
| 3.931.562,10                     | USD                | 2.922.000,00      | GBP                  | (7.119,94)  | 14.01.2022  |
| 25.273.000,00                    | USD                | 527.804.390,03    | MXN                  | (429.961,02)  | 14.01.2022  |
| 9.883.762,36                     | USD                | 14.455.000,00     | NZD                  | 14.181,90   | 14.01.2022  |
| 10.737.000,00                    | USD                | 162.035.932,32    | TRY                  | (1.048.573,92)  | 14.01.2022  |
| 1.106.794.154,20                 | ZAR                | 68.742.000,00     | USD                  | 454.391,67  | 14.01.2022  |
| 11.539.000,00                    | AUD                | 918.780.182,00    | JPY                  | 337.048,57  | 01.02.2022  |
| 228.624.984,58                   | CHF                | 215.425.843,17    | EUR                  | 5.956.518,00  | 01.02.2022  |
| 1.513.000,00                     | CHF                | 186.581.193,00    | JPY                  | 34.894,05   | 01.02.2022  |
| 109.308.030,43                   | CHF                | 120.267.000,00    | USD                  | (271.020,54)  | 01.02.2022  |
| 117.079.923,28                   | EUR                | 181.401.291,53    | AUD                  | 1.070.532,86  | 01.02.2022  |
| 14.422.000,00                    | EUR                | 20.996.311,97     | CAD                  | (148.125,91)  | 01.02.2022  |
| 289.902.071,73                   | EUR                | 307.664.371,67    | CHF                  | (8.015.783,46)  | 01.02.2022  |
| 256.577.924,53                   | EUR                | 418.205.339,42    | NZD                  | 4.742.820,06  | 01.02.2022  |
| 720.033.716,13                   | EUR                | 840.871.934,48    | USD                  | (21.900.520,58)   | 01.02.2022  |
| 4.013.000,00                     | GBP                | 6.797.684,91      | CAD                  | 56.596,76   | 01.02.2022  |
| 47.420.175.753,00                | JPY                | 357.701.843,97    | EUR                  | 5.784.336,69  | 01.02.2022  |
| 1.917.722.000,00                 | JPY                | 154.653.049,12    | NOK                  | (772.364,40)  | 01.02.2022  |
| 228.506.077,80                   | NOK                | 22.165.000,00     | EUR                  | 695.225,20  | 01.02.2022  |
| 10.831.341,95                    | NOK                | 1.188.000,00      | USD                  | 35.390,81   | 01.02.2022  |
| 1.778.000,00                     | NZD                | 137.454.353,00    | JPY                  | 17.090,62   | 01.02.2022  |
| 121.454.716,12                   | SEK                | 12.327.000,00     | CHF                  | (93.743,41)   | 01.02.2022  |
| 30.138.518,32                    | SEK                | 2.586.000,00      | GBP                  | (137.583,18)  | 01.02.2022  |
| 371.588.322,15                   | USD                | 318.188.905,47    | EUR                  | 9.678.022,72  | 01.02.2022  |
| 2.073.000,00                     | USD                | 18.991.709,07     | NOK                  | (70.920,69)   | 01.02.2022  |
| 4.314.981.558,00                 | CLP                | 5.291.000,00      | USD                  | (236.040,32)  | 22.02.2022  |
| 567.040.157,40                   | RUB                | 7.585.000,00      | USD                  | (97.317,79)   | 22.02.2022  |
| 3120.000,00                      | USD                | 2.876.203,51      | CHF                  | (33.709,04)   | 22.02.2022  |
| 74.202.286,73                    | ZAR                | 4.615.000,00      | USD                  | 2.371,13  | 22.02.2022  |
| 9.855.000,00                     | AUD                | 6.248.575,69      | EUR                  | 50.828,00   | 28.02.2022  |
| 4.538.273,24                     | EUR                | 40.000.000,00     | HKD                  | 15.097,68   | 28.02.2022  |
| 72.374.483,23                    | EUR                | 82.000.000,00     | USD                  | 63.656,25   | 28.02.2022  |
| 99.000.000,00                    | HKD                | 11.265.846,44     | EUR                  | (71.023,61)   | 28.02.2022  |
| 8.217.041,00                     | EUR                | 12.724.046,91     | SGD                  | (94.037,51)   | 01.03.2022  |
| 1.579.654,27                     | EUR                | 25.014.883,78     | TRY                  | 21.683,87   | 01.03.2022  |
| 141.051.245,70                   | EUR                | 160.096.845,30    | USD                  | (125.864,02)  | 01.03.2022  |
| 159.474.057,77                   | SGD                | 102.986.485,44    | EUR                  | 1.178.598,52  | 01.03.2022  |
| 167.202.615,95                   | TRY                | 10.558.606,99     | EUR                  | (144.937,64)  | 01.03.2022  |
| 46.396.180,47                    | USD                | 40.876.752,06     | EUR                  | 36.475,48   | 01.03.2022  |
| 1.819.000,00                     | USD                | 16.552.196,05     | SEK                  | (9.348,83)  | 01.03.2022  |
|                                  |                    |                   |                      | <b>52.658.240,49</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 2.465.000,00                     | AUD                | 15.616.376,21     | NOK                  | 13.601,66   | 14.01.2022  |
| 98.024.000,00                    | AUD                | 629.556.503,15    | SEK                  | 1.308.488,93  | 14.01.2022  |
| 2.645.000,00                     | AUD                | 1.890.425,94      | USD                  | 23.486,13   | 14.01.2022  |
| 11.949.204,48                    | CAD                | 13.591.000,00     | NZD                  | 106.060,44  | 14.01.2022  |
| 6.063.000,00                     | EUR                | 9.138.210,59      | CAD                  | (280.776,70)  | 14.01.2022  |
| 6.119.000,00                     | EUR                | 62.489.876,30     | NOK                  | (136.680,86)  | 14.01.2022  |
| 7.686.000,00                     | EUR                | 36.407.396,05     | PLN                  | (226.276,40)  | 14.01.2022  |
| 6.043,30                         | EUR                | 64.738,09         | TRY                  | 1.838,64  | 14.01.2022  |
| 3.471.000,00                     | EUR                | 4.048.694,50      | USD                  | (102.572,21)  | 14.01.2022  |
| 14.446.000,00                    | GBP                | 26.843.320,29     | AUD                  | 19.131,14   | 14.01.2022  |
| 1.994.000,00                     | GBP                | 23.048.607,32     | NOK                  | 65.627,26   | 14.01.2022  |
| 11.137.618.607,00                | JPY                | 137.963.000,00    | AUD                  | (2.867.095,94)  | 14.01.2022  |
| 22.290.832.965,00                | KRW                | 18.833.000,00     | USD                  | (101.215,38)  | 14.01.2022  |
| 161.975.664,63                   | NOK                | 22.704.000,00     | CAD                  | 453.926,30  | 14.01.2022  |
| 44.944.795,42                    | NOK                | 4.971.000,00      | USD                  | 111.685,91  | 14.01.2022  |
| 196.728.000,00                   | NZD                | 15.848.964.420,00 | JPY                  | (2.977.370,17)  | 14.01.2022  |
| 54.214.000,00                    | NZD                | 38.053.359,58     | USD                  | (921.888,96)  | 14.01.2022  |
| 446.227.451,13                   | SEK                | 43.985.000,00     | EUR                  | (465.468,80)  | 14.01.2022  |
| 1.350.633.917,70                 | TRY                | 126.081.591,37    | EUR                  | (38.359.471,34)   | 14.01.2022  |
| 2.066.000,00                     | USD                | 2.553.292,54      | CAD                  | 51.066,28   | 14.01.2022  |
| 23.467.497,72                    | USD                | 20.119.000,00     | EUR                  | 594.540,54  | 14.01.2022  |
| 38.370.291,52                    | USD                | 27.858.000,00     | GBP                  | 715.440,88  | 14.01.2022  |
| 81.869.000,00                    | USD                | 729.120.728,31    | SEK                  | 1.151.621,60  | 14.01.2022  |
| 2.450.000,00                     | AUD                | 198.014.831,00    | JPY                  | 49.043,05   | 01.02.2022  |
| 1.569.000,00                     | EUR                | 201.199.899,00    | JPY                  | 26.788,31   | 01.02.2022  |
| 23.655.000,00                    | EUR                | 242.549.277,02    | SEK                  | 4.890,43  | 01.02.2022  |
| 63.249.000,00                    | NZD                | 39.597.782,79     | CHF                  | (255.167,66)  | 01.02.2022  |
| 31.029.188,44                    | USD                | 44.005.000,00     | AUD                  | (764.800,63)  | 01.02.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                       | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| 121.622.000,00                          | USD                | 111.991.763,28    | CHF                  | (1.132.931,06)  | 01.02.2022  |
| 349.405.978,00                          | BRL                | 61.355.052,14     | USD                  | 511.390,62  | 22.02.2022  |
| 11.126.622.650,00                       | INR                | 147.928.933,34    | USD                  | 597.116,85  | 22.02.2022  |
| 9.096.000,00                            | USD                | 7.764.254.640,00  | CLP                  | 50.034,45   | 22.02.2022  |
| 16.183.206,98                           | USD                | 1.217.236.096,00  | INR                  | (65.323,70)   | 22.02.2022  |
| 5.000.000,00                            | CAD                | 3.457.336,23      | EUR                  | 10.196,81   | 28.02.2022  |
| 101.000.000,00                          | DKK                | 13.579.546,74     | EUR                  | 3.013,95  | 28.02.2022  |
| 7.706.481,69                            | EUR                | 8.000.000,00      | CHF                  | (41.103,00)   | 28.02.2022  |
| 10.147.230,39                           | EUR                | 90.000.000,00     | HKD                  | (29.984,35)   | 28.02.2022  |
| 71.686.021,60                           | EUR                | 81.000.000,00     | USD                  | 257.245,85  | 28.02.2022  |
| 14.557.000,00                           | EUR                | 15.139.258,16     | CHF                  | (104.691,67)  | 01.03.2022  |
| 70.493.000,00                           | EUR                | 79.830.016,38     | USD                  | 97.218,21   | 01.03.2022  |
| 8.833.197,40                            | USD                | 7.828.000,00      | EUR                  | (38.732,39)   | 01.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(42.648.096,98)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 15.277.387,01                           | SEK                | 15.341.000,00     | NOK                  | (45.773,99)   | 14.01.2022  |
| 1.363.000,00                            | USD                | 11.571.722,39     | NOK                  | 44.646,67   | 14.01.2022  |
| 12.382.000,00                           | CHF                | 121.053.535,55    | NOK                  | (120.742,73)  | 01.02.2022  |
| 326.575.630,22                          | EUR                | 3.251.831.509,22  | SEK                  | 9.506.769,62  | 01.02.2022  |
| 2.550.939.974,75                        | SEK                | 256.186.345,31    | EUR                  | (7.457.704,55)  | 01.02.2022  |
| 33.149.356,03                           | SEK                | 3.879.000,00      | USD                  | (190.371,09)  | 01.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>1.736.823,93</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 3.553.000,00                            | EUR                | 3.027.866,60      | GBP                  | (50.275,81)   | 14.01.2022  |
| 3.443.000,00                            | EUR                | 35.290.478,35     | SEK                  | 1.192,14  | 14.01.2022  |
| 9.517.000,00                            | USD                | 152.693.883,85    | ZAR                  | (33.272,04)   | 14.01.2022  |
| 154.421.202,62                          | ZAR                | 9.643.000,00      | USD                  | 17.455,88   | 14.01.2022  |
| 3.081.693.780,00                        | CLP                | 3.597.000,00      | USD                  | (8.141,91)  | 22.02.2022  |
| 732.137.980,00                          | INR                | 9.622.000,00      | USD                  | 137.983,76  | 22.02.2022  |
| 15.658.239.180,00                       | KRW                | 13.198.000,00     | USD                  | (54.663,89)   | 22.02.2022  |
| 1.246.751.481,60                        | RUB                | 16.704.000,00     | USD                  | (237.679,45)  | 22.02.2022  |
| 26.712.000,00                           | USD                | 2.041.891.992,00  | INR                  | (493.598,28)  | 22.02.2022  |
| 26.093.000,00                           | USD                | 1.956.978.522,56  | RUB                  | 261.293,53  | 22.02.2022  |
| 8.261.353,89                            | EUR                | 8.600.000,00      | CHF                  | (67.324,87)   | 28.02.2022  |
| 66.842.603,55                           | EUR                | 587.737.000,00    | HKD                  | 381.837,08  | 28.02.2022  |
| 47.000.000,00                           | HKD                | 5.320.087,90      | EUR                  | (5.343,10)  | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(150.536,96)</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(65.629.540,49)</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(71.961.183,11)</b>  |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

## Credit Default Swaps

| Basiswert                                     | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal         | Wahrung | Kosten (EUR)         | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)      | Falligkeit |
|---|--------------|-----------------|-----------------|----------|----------------------|--|----------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b> |              |                 |                 |          |                      |  |                      |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (43.853.000,00) | USD      | 3.635.394,62         | (57.537,14)  | 3.577.857,48         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (57.181.000,00) | USD      | 4.742.268,30         | (77.012,36)  | 4.665.255,94         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (67.304.000,00) | USD      | 5.576.058,14         | (84.891,74)  | 5.491.166,40         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (55.260.000,00) | USD      | 4.464.452,40         | 44.073,92  | 4.508.526,32         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (52.884.000,00) | USD      | 4.291.618,08         | 23.056,29  | 4.314.674,37         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (8.176.000,00)  | USD      | 694.368,97           | (27.309,41)  | 667.059,56           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (10.917.000,00) | USD      | 889.664,93           | 1.026,02   | 890.690,95           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (9.230.000,00)  | USD      | 735.662,46           | 17.390,35  | 753.052,81           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (60.936.000,00) | USD      | 4.560.030,46         | 411.586,62   | 4.971.617,08         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (8.340.000,00)  | USD      | 557.773,05           | 122.666,86   | 680.439,91           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (13.142.000,00) | USD      | 917.396,83           | 154.826,35   | 1.072.223,18         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (14.688.000,00) | USD      | 1.126.388,36         | 71.969,12  | 1.198.357,48         | 20.12.2026  |
|   |              |                 |                 |          | <b>32.191.076,60</b> | <b>599.844,88</b>                                    | <b>32.790.921,48</b> |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>            |              |                 |                 |          |                      |  |                      |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (60.681.000,00) | USD      | 4.860.194,80         | 90.617,46  | 4.950.812,26         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.036.000,00)  | USD      | 155.159,00           | 10.953,19  | 166.112,19           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (10.003.000,00) | USD      | 808.583,77           | 7.536,19   | 816.119,96           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (13.141.000,00) | USD      | 921.850,36           | 150.291,23   | 1.072.141,59         | 20.12.2026  |
|   |              |                 |                 |          | <b>6.745.787,93</b>  | <b>259.398,07</b>                                    | <b>7.005.186,00</b>  |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert                                    | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal            | Wahrung | Kosten (EUR)          | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)       | Falligkeit |
|--|--------------|-----------------|--------------------|----------|-----------------------|---|-----------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>      |              |                 |                    |          |                       |   |                       |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (4.046.000,00)     | USD      | 330.966,83            | (863,73)  | 330.103,10            | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                    |          | <b>330.966,83</b>     | <b>(863,73)</b>                                     | <b>330.103,10</b>     |             |
| <b>Gegenpartei: ICE Clear Europe Limited</b> |              |                 |                    |          |                       |   |                       |             |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                         | Verkauf      | 5,00%           | (1.045.657.000,00) | EUR      | 122.185.306,89        | 2.460.469,96  | 124.645.776,85        | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                    |          | <b>122.185.306,89</b> | <b>2.460.469,96</b>                                 | <b>124.645.776,85</b> |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>             |              |                 |                    |          |                       |   |                       |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (13.539.000,00)    | USD      | 956.475,26            | 148.138,16  | 1.104.613,42          | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                    |          | <b>956.475,26</b>     | <b>148.138,16</b>                                   | <b>1.104.613,42</b>   |             |
|  |              |                 |                    |          | <b>162.409.613,51</b> | <b>3.466.987,34</b>                                 | <b>165.876.600,85</b> |             |

## Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Falligkeit | Wahrung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) |
|--|-------------|----------|-------------------------------|---------------------------|--|---|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |             |          |                               |                           |  |   |
| AMSTERDAM IDX FUT 1/2022               | 21.01.2022  | EUR      | 1.641,00                      | 262.182.570,00            | (393.840,00)   | 5.612.806,50  |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022  | AUD      | 1.426,00                      | 140.140.150,00            | (457.952,64)   | 247.753,98  |
| CAC40 10 EURO FUT 1/2022               | 21.01.2022  | EUR      | (1.553,00)                    | (111.062.795,00)          | 201.890,00   | (3.828.145,00)  |
| CAC40 10 EURO FUT 1/2022               | 21.01.2022  | EUR      | 1.417,00                      | 101.336.755,00            | (184.210,00)   | 3.492.905,00  |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022  | CAD      | (3.199,00)                    | (455.057.750,00)          | 266.563,37   | (7.951.709,26)  |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022  | CAD      | 280,00                        | 39.830.000,00             | (23.331,59)  | 682.593,50  |
| CBOE VIX FUTURE 1/2022                 | 19.01.2022  | USD      | 455,00                        | 9.054.500,00              | (17.635,19)  | (2.967.347,38)  |
| DAX INDEX FUTURE 3/2022                | 18.03.2022  | EUR      | (431,00)                      | (170.611.350,00)          | 237.050,00   | (2.779.950,00)  |
| DAX INDEX FUTURE 3/2022                | 18.03.2022  | EUR      | 336,00                        | 133.005.600,00            | (184.800,00)   | 2.167.200,00  |
| DJIA MINI e-CBOT 3/2022                | 18.03.2022  | USD      | 2.252,00                      | 408.073.660,00            | (497.064,41)   | 4.129.966,98  |
| DJIA MINI e-CBOT 3/2022                | 18.03.2022  | USD      | (1.200,00)                    | (217.446.000,00)          | 264.865,58   | (2.200.692,87)  |
| E-Mini Russ 2000 3/2022                | 18.03.2022  | USD      | 1.697,00                      | 191.234.930,00            | 516.898,42   | 2.852.207,97  |
| E-Mini Russ 2000 3/2022                | 18.03.2022  | USD      | (2.001,00)                    | (225.492.690,00)          | (609.495,43)   | (3.325.947,05)  |
| EURO STOXX 50 3/2022                   | 18.03.2022  | EUR      | (18.332,00)                   | (784.609.600,00)          | 1.374.900,00   | (17.182.087,42)   |
| EURO STOXX 50 3/2022                   | 18.03.2022  | EUR      | 4.841,00                      | 207.194.800,00            | (363.075,00)   | 4.362.558,01  |
| EURO-BUND FUTURE 1/2022                | 10.03.2022  | EUR      | 5.384,00                      | 922.656.080,00            | 0,00   | (16.389.740,30)   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | (2.447,00)                    | (419.342.390,00)          | 0,00   | 7.312.651,64  |
| FTSE 100 IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022  | GBP      | 5.055,00                      | 370.860.075,00            | (722.093,13)   | 8.892.989,27  |
| FTSE 100 IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022  | GBP      | (3.518,00)                    | (258.098.070,00)          | 502.536,82   | (6.195.489,33)  |
| FTSE/MIB IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022  | EUR      | (1.387,00)                    | (188.423.950,00)          | 540.930,00   | (3.314.930,00)  |
| HANG SENG IDX FUT 1/2022               | 28.01.2022  | HKD      | (1.955,00)                    | (2.292.335.250,00)        | (3.419.239,02)   | 596.288,13  |
| HANG SENG IDX FUT 1/2022               | 28.01.2022  | HKD      | 314,00                        | 368.180.700,00            | 549.177,01   | (95.772,11)   |
| HSCEI Futures 1/2022                   | 28.01.2022  | HKD      | (4.167,00)                    | (1.722.429.450,00)        | (3.419.918,23)   | 2.313.506,01  |
| HSCEI Futures 1/2022                   | 28.01.2022  | HKD      | 415,00                        | 171.540.250,00            | 340.596,61   | (230.406,77)  |
| IBEX 35 INDX FUTR 1/2022               | 21.01.2022  | EUR      | (2.782,00)                    | (241.115.940,00)          | 484.068,00   | (9.537.989,44)  |
| JPN 10Y BOND(OSE) 3/2022               | 22.03.2022  | JPY      | (80,00)                       | (12.134.400.000,00)       | (55.211,47)  | 238.766,34  |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022  | GBP      | (754,00)                      | (94.197.220,00)           | (134.633,59)   | (28.440,99)   |
| MSCI EmgMkt 3/2022                     | 18.03.2022  | USD      | (5.701,00)                    | (351.865.720,00)          | (276.833,09)   | 115.452,27  |
| MSCI EmgMkt 3/2022                     | 18.03.2022  | USD      | 1.706,00                      | 105.294.320,00            | 82.841,12  | (101.977,53)  |
| NASDAQ 100 E-MINI 3/2022               | 18.03.2022  | USD      | 957,00                        | 313.829.010,00            | (570.321,81)   | 1.765.546,72  |
| NASDAQ 100 E-MINI 3/2022               | 18.03.2022  | USD      | (251,00)                      | (82.310.430,00)           | 149.582,84   | (433.623,77)  |
| NIKKEI 225 MINI 3/2022                 | 11.03.2022  | JPY      | (17.536,00)                   | (50.573.824.000,00)       | (806.823,64)   | (4.889.413,95)  |
| NIKKEI 225 MINI 3/2022                 | 11.03.2022  | JPY      | 14.750,00                     | 42.539.000.000,00         | 678.641,01   | 7.990.469,84  |
| OMXS30 IND FUTURE 1/2022               | 21.01.2022  | SEK      | 7.328,00                      | 1.776.124.000,00          | 321.661,06   | 7.912.861,27  |
| OMXS30 IND FUTURE 1/2022               | 21.01.2022  | SEK      | (6.979,00)                    | (1.691.535.125,00)        | (306.341,78)   | (7.536.006,92)  |
| S&P MID 400 EMINI 3/2022               | 18.03.2022  | USD      | (437,00)                      | (124.142.960,00)          | (162.044,76)   | (2.394.936,61)  |
| S&P MID 400 EMINI 3/2022               | 18.03.2022  | USD      | 211,00                        | 59.940.880,00             | 78.241,29  | 1.156.365,28  |
| S&P/TSX 60 IX FUT 3/2022               | 18.03.2022  | CAD      | (1.046,00)                    | (268.382.680,00)          | 450.327,39   | (3.855.224,27)  |
| S&P/TSX 60 IX FUT 3/2022               | 18.03.2022  | CAD      | 590,00                        | 151.382.200,00            | (254.008,75)   | 2.174.552,87  |
| S&P500 EMINI FUT 3/2022                | 18.03.2022  | USD      | (20.451,00)                   | (4.874.495.850,00)        | 4.739.670,25   | (65.503.593,69)   |
| S&P500 EMINI FUT 3/2022                | 18.03.2022  | USD      | 17.636,00                     | 4.203.540.600,00          | (4.087.273,21)   | 51.464.114,93   |
| SPI 200 FUTURES 3/2022                 | 17.03.2022  | AUD      | (3.264,00)                    | (599.678.400,00)          | 4.490.359,43   | (8.365.019,67)  |
| SPI 200 FUTURES 3/2022                 | 17.03.2022  | AUD      | 809,00                        | 148.633.525,00            | (1.112.959,80)   | 2.057.428,64  |
| SWISS MKT IX FUTR 3/2022               | 18.03.2022  | CHF      | 1.570,00                      | 200.771.600,00            | (151.996,26)   | 5.370.719,15  |
| SWISS MKT IX FUTR 3/2022               | 18.03.2022  | CHF      | (1.239,00)                    | (158.443.320,00)          | 119.951,19   | (4.238.421,05)  |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022  | USD      | 24.283,00                     | 3.166.654.968,75          | 0,00   | 23.009.499,51   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022  | USD      | (5.995,00)                    | (781.785.468,75)          | 0,00   | (3.686.700,90)  |
|  |             |          |                               |                           | <b>(1.820.351,41)</b>  | <b>(35.314.362,47)</b>  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Equity Swaps

| Basiswert   | Währung | Stückzahl der zugrunde liegenden Aktien | Verpflichtung in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|---------|---|---|---|--|------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |         |   |   |   |  |            |
| Accenture   | USD     | 87.453,00                               | 31.881.951,88   | 2.585.023,13  | 1.136.154,75   | 06.09.2022 |
| Akamai Technologies                               | USD     | 64.943,00                               | 6.713.041,49  | 233.362,48  | 205.938,57   | 06.09.2022 |
| Alphabet  | USD     | 32.553,00                               | 83.711.779,11   | (1.361.153,12)  | 1.152.258,71   | 06.09.2022 |
| Amgen   | USD     | 162.321,00                              | 32.469.932,47   | 2.247.113,66  | (296.634,18)   | 06.09.2022 |
| Anthem  | USD     | 89.179,00                               | 36.767.588,81   | 2.832.879,02  | 422.428,51   | 06.09.2022 |
| Apple   | USD     | 31.508,00                               | 4.948.256,78  | (43.674,18)   | 877.991,37   | 06.09.2022 |
| Archer-Daniels-Midland                            | USD     | 46.964,00                               | 2.782.222,58  | 151.342,96  | (102.408,62)   | 06.09.2022 |
| Automatic Data Processing                         | USD     | 80.561,00                               | 17.459.328,73   | 621.642,29  | 504.796,73   | 06.09.2022 |
| AutoZone  | USD     | 16.731,00                               | 30.779.338,22   | 1.191.621,22  | 1.723.060,51   | 06.09.2022 |
| Bank of Nova Scotia/The                           | CAD     | 231.338,00                              | 14.423.807,98   | 589.546,44  | 547.927,55   | 19.09.2022 |
| Bristol-Myers Squibb                              | USD     | 1.079.580,00                            | 59.752.677,59   | 6.033.409,60  | (2.925.828,72)   | 06.09.2022 |
| Cadence Design Systems                            | USD     | 183.609,00                              | 30.096.540,83   | 246.400,64  | 1.080.721,11   | 06.09.2022 |
| Cerner  | USD     | 78.847,00                               | 6.473.995,50  | 1.296.887,49  | 696,84   | 06.09.2022 |
| Check Point Software Technologies                 | USD     | 144.938,00                              | 14.938.473,61   | 784.417,01  | (854.131,39)   | 06.09.2022 |
| Chubb   | USD     | 62.395,00                               | 10.666.617,10   | 118.989,27  | (88.841,96)  | 06.09.2022 |
| Cigna   | USD     | 279.901,00                              | 57.156.493,50   | 4.040.419,70  | (667.184,17)   | 06.09.2022 |
| Cisco Systems                                     | USD     | 1.444.174,00                            | 80.926.785,75   | 5.380.668,61  | 1.915.389,97   | 06.09.2022 |
| Citrix Systems                                    | USD     | 45.892,00                               | 3.879.538,26  | 576.967,36  | (305.405,89)   | 06.09.2022 |
| Coca-Cola   | USD     | 1.873.831,00                            | 97.103.704,29   | 3.995.322,70  | 766.156,89   | 06.09.2022 |
| Cognizant Technology Solutions                    | USD     | 167.203,00                              | 13.111.703,06   | 992.013,57  | 161.294,33   | 06.09.2022 |
| Colgate-Palmolive                                 | USD     | 731.624,00                              | 54.711.122,47   | 3.378.266,65  | 641.308,19   | 06.09.2022 |
| Comcast   | USD     | 1.257.192,00                            | 56.185.987,82   | 2.408.605,20  | (6.295.020,89)   | 06.09.2022 |
| CVS Health  | USD     | 612.436,00                              | 55.866.231,92   | 2.411.569,83  | 3.173.113,93   | 06.09.2022 |
| eBay  | USD     | 827.190,00                              | 48.361.384,24   | (489.310,29)  | (4.634.895,80)   | 06.09.2022 |
| Estee Lauder Cos                                  | USD     | 53.605,00                               | 17.430.084,73   | 326.556,75  | 771.267,70   | 06.09.2022 |
| Expeditors International of Washington            | USD     | 235.479,00                              | 27.615.481,93   | 378.379,71  | 1.142.536,20   | 06.09.2022 |
| F5  | USD     | 64.293,00                               | 13.937.103,52   | 912.186,92  | 227.284,14   | 06.09.2022 |
| Fiserv  | USD     | 351.084,00                              | 32.326.447,18   | 340.963,59  | 846.137,38   | 06.09.2022 |
| Hershey   | USD     | 69.266,00                               | 11.692.631,63   | 286.811,94  | 395.134,56   | 06.09.2022 |
| Hoya  | JPY     | 107.100,00                              | 14.051.940,75   | (632.378,40)  | 292.164,84   | 16.06.2022 |
| Infosys ADR                                       | USD     | 164.795,00                              | 3.707.214,59  | 333.183,73  | 33.497,88  | 06.09.2022 |
| Intuit  | USD     | 20.270,00                               | 11.466.379,21   | (666.271,22)  | 1.325.118,78   | 06.09.2022 |
| Johnson & Johnson                                 | USD     | 526.613,00                              | 80.006.679,15   | 3.063.947,10  | 571.669,98   | 06.09.2022 |
| KDDI  | JPY     | 779.206,00                              | 20.088.468,43   | 167.304,32  | (491.935,02)   | 16.06.2022 |
| Kellogg   | USD     | 127.355,00                              | 7.189.404,24  | 148.420,61  | (103.639,14)   | 06.09.2022 |
| Kimberly-Clark                                    | USD     | 67.710,00                               | 8.485.196,14  | 350.909,56  | 50.129,09  | 06.09.2022 |
| Kyndryl Holdings                                  | USD     | 41.878,00                               | 687.336,79  | 15.528,86   | (113.623,92)   | 06.09.2022 |
| Marsh & McLennan Cos                              | USD     | 74.022,00                               | 11.329.584,54   | 101.950,58  | 332.496,25   | 06.09.2022 |
| Mastercard  | USD     | 68.005,00                               | 21.713.087,21   | 703.675,98  | (482.015,11)   | 06.09.2022 |
| McDonald's  | USD     | 243.356,00                              | 57.441.598,61   | 511.355,86  | 2.092.241,70   | 06.09.2022 |
| Medtronic   | USD     | 576.185,00                              | 53.119.002,13   | (4.074.729,05)  | (4.058.668,97)   | 06.09.2022 |
| Merck   | USD     | 286.369,00                              | 19.536.249,20   | 1.175.664,02  | (2.879.482,13)   | 06.09.2022 |
| Microsoft   | USD     | 208.342,00                              | 62.058.379,94   | (949.141,15)  | 2.161.674,84   | 06.09.2022 |
| Mondelez International                            | USD     | 400.711,00                              | 23.277.076,13   | 1.250.618,81  | (168.066,50)   | 06.09.2022 |
| Monster Beverage                                  | USD     | 636.174,00                              | 53.622.506,37   | 3.325.078,43  | (1.366.242,00)   | 06.09.2022 |
| Muenchener Ruckversicherungs-Gesellschaft AG in M | EUR     | 31.256,00                               | 8.142.188,00  | 387.574,40  | (257.862,00)   | 16.01.2023 |
| National Grid                                     | GBP     | 1.832.479,00                            | 23.118.184,60   | 196.323,48  | 1.837.835,39   | 16.01.2023 |
| NIKE  | USD     | 90.063,00                               | 13.261.561,08   | (181.294,88)  | 63.676,89  | 06.09.2022 |
| Nippon Telegraph & Telephone                      | JPY     | 876.584,00                              | 21.173.903,18   | 430.199,94  | (949.683,23)   | 16.06.2022 |
| Novo Nordisk B                                    | DKK     | 4.957,00                                | 489.947,26  | (10.665,52)   | 13.399,32  | 07.02.2022 |
| Oracle  | USD     | 119.635,00                              | 9.265.335,46  | (1.574.853,52)  | 929.987,78   | 06.09.2022 |
| Organon   | USD     | 56.234,00                               | 1.523.702,35  | 96.813,93   | (316.862,67)   | 06.09.2022 |
| PepsiCo   | USD     | 177.098,00                              | 26.923.148,95   | 503.470,22  | 525.235,74   | 06.09.2022 |
| Pfizer  | USD     | 864.008,00                              | 45.250.478,63   | 4.988.842,38  | 2.838.088,96   | 06.09.2022 |
| Procter & Gamble                                  | USD     | 400.745,00                              | 57.522.731,80   | 2.519.140,48  | 1.447.015,83   | 06.09.2022 |
| Public Service Enterprise Group                   | USD     | 488.316,00                              | 28.566.475,25   | 1.060.572,41  | 450.824,48   | 06.09.2022 |
| Reckitt Benckiser Group                           | GBP     | 240.564,00                              | 18.161.331,26   | 492.549,51  | (109.009,10)   | 16.01.2023 |
| Rightmove   | GBP     | 1.024.932,00                            | 9.699.581,29  | 287.937,27  | 891.831,06   | 16.01.2023 |
| Ross Stores                                       | USD     | 136.188,00                              | 13.704.770,46   | 134.666,98  | (699.294,99)   | 06.09.2022 |
| Royal Bank of Canada                              | CAD     | 251.717,00                              | 23.455.121,34   | 700.909,43  | (386.390,64)   | 19.09.2022 |
| Sanofi  | EUR     | 152.962,00                              | 13.549.373,96   | 313.572,10  | (503.244,98)   | 16.01.2023 |
| Seven & i Holdings                                | JPY     | 41.388,00                               | 1.604.642,67  | 26.976,79   | (19.309,47)  | 16.06.2022 |
| Siemens   | EUR     | 119.111,00                              | 18.185.867,48   | 195.342,04  | 457.243,75   | 16.01.2023 |
| Starbucks   | USD     | 394.853,00                              | 40.658.372,35   | (34.860,99)   | 1.214.395,44   | 06.09.2022 |
| State Street                                      | USD     | 36.767,00                               | 3.019.526,19  | (15.905,91)   | (142.024,32)   | 06.09.2022 |
| Stryker   | USD     | 34.691,00                               | 8.272.056,94  | 302.606,36  | (220.542,90)   | 06.09.2022 |
| Target  | USD     | 12.888,00                               | 2.616.628,69  | (93.532,30)   | (201.235,58)   | 06.09.2022 |
| Techntron Industries                              | HKD     | 1.009.477,00                            | 17.735.456,04   | (1.325.588,21)  | (137.270,95)   | 16.06.2022 |
| Texas Roadhouse                                   | USD     | 209.225,00                              | 16.807.824,81   | 544.928,93  | (850.583,30)   | 06.09.2022 |
| TJX Cos   | USD     | 255.884,00                              | 17.079.265,81   | 196.547,11  | 1.304.861,41   | 06.09.2022 |
| Toro  | USD     | 212.209,00                              | 18.606.344,25   | (108.666,60)  | (105.026,11)   | 06.09.2022 |
| Unilever  | GBP     | 378.536,00                              | 17.780.278,79   | (313.847,81)  | 428.534,14   | 16.01.2023 |
| UnitedHealth Group                                | USD     | 27.397,00                               | 12.198.455,91   | 630.833,67  | 453.222,72   | 06.09.2022 |
| Verizon Communications                            | USD     | 351.080,00                              | 16.189.386,32   | 632.325,26  | (747.770,92)   | 06.09.2022 |
| Vinci   | EUR     | 359.117,00                              | 33.365.560,47   | 2.682.603,99  | (3.504.981,92)   | 16.01.2023 |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Equity Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert                                     | Währung | Stückzahl der zugrunde liegenden Aktien | Verpflichtung in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|---------|---|---|---|--|------------|
| Visa  | USD     | 134.067,00                              | 25.692.476,10   | 433.218,75  | (255.929,93)   | 06.09.2022 |
| VMware  | USD     | 236.858,00                              | 24.498.225,16   | 846.929,68  | (2.474.234,83)   | 06.09.2022 |
| Waste Management                              | USD     | 69.647,00                               | 10.195.093,46   | 66.409,54   | 118.482,08   | 06.09.2022 |
| WW Grainger                                   | USD     | 24.357,00                               | 11.096.504,29   | 50.320,38   | 568.008,73   | 06.09.2022 |
| Xilinx  | USD     | 253.738,00                              | 47.523.930,06   | (1.129.068,57)  | 4.325.767,59   | 06.09.2022 |
| Zimmer Biomet Holdings                        | USD     | 117.877,00                              | 13.321.198,97   | 365.292,25  | (950.186,51)   | 06.09.2022 |
|   |         | <b>25.761.086,00</b>                    | <b>2.072.205.286,04</b>                               | <b>61.590.971,16</b>  | <b>3.753.533,85</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |         |   |   |   |  |            |
| Accenture                                     | USD     | 198.568,00                              | 72.390.145,81   | 6.595.266,12  | 1.204.241,52   | 15.12.2022 |
| Akamai Technologies                           | USD     | 73.368,00                               | 7.583.918,64  | 54.411,44   | 422.363,52   | 15.12.2022 |
| Alphabet                                      | USD     | 21.113,00                               | 54.293.207,77   | (301.041,76)  | (718.833,55)   | 15.12.2022 |
| Amgen   | USD     | 231.583,00                              | 46.324.778,50   | 1.496.656,13  | 2.406.311,29   | 15.12.2022 |
| Anthem  | USD     | 140.999,00                              | 58.132.444,35   | 2.915.460,72  | 1.149.577,63   | 15.12.2022 |
| Apple   | USD     | 363.845,00                              | 57.140.995,60   | (456.151,42)  | 9.438.387,35   | 15.12.2022 |
| Archer-Daniels-Midland                        | USD     | 124.231,00                              | 7.359.643,41  | 221.557,07  | (187.501,98)   | 15.12.2022 |
| Automatic Data Processing                     | USD     | 246.617,00                              | 53.447.291,80   | 2.514.833,67  | 187.773,90   | 15.12.2022 |
| AutoZone                                      | USD     | 43.425,00                               | 79.887.201,12   | 1.345.709,18  | 5.257.519,93   | 15.12.2022 |
| Bristol-Myers Squibb                          | USD     | 241.580,00                              | 13.370.988,58   | 443.637,84  | 272.903,64   | 15.12.2022 |
| Cadence Design Systems                        | USD     | 254.541,00                              | 41.723.464,54   | 312.375,39  | 434.939,47   | 15.12.2022 |
| Cerner  | USD     | 402.773,00                              | 33.071.018,44   | 5.006.881,07  | 1.786.536,28   | 15.12.2022 |
| Check Point Software Technologies             | USD     | 105.094,00                              | 10.831.831,17   | 308.977,20  | (275.961,60)   | 15.12.2022 |
| Chubb   | USD     | 25.650,00                               | 4.384.946,37  | (7.473,18)  | 25.560,79  | 15.12.2022 |
| Cigna   | USD     | 88.977,00                               | 18.169.328,88   | 1.086.436,16  | 155.110,45   | 15.12.2022 |
| Cisco Systems                                 | USD     | 372.181,00                              | 20.855.805,50   | 1.163.219,65  | 831.600,21   | 15.12.2022 |
| Citrix Systems                                | USD     | 58.468,00                               | 4.942.666,32  | 620.478,84  | (177.552,23)   | 15.12.2022 |
| Coca-Cola                                     | USD     | 1.539.850,00                            | 79.796.491,28   | 859.151,32  | 2.142.180,94   | 15.12.2022 |
| Cognizant Technology Solutions                | USD     | 154.208,00                              | 12.092.662,85   | 805.995,99  | 128.819,98   | 15.12.2022 |
| Colgate-Palmolive                             | USD     | 587.252,00                              | 43.914.929,11   | 1.005.843,71  | 2.318.852,52   | 15.12.2022 |
| Comcast                                       | USD     | 310.496,00                              | 13.876.579,29   | 668.882,92  | (1.429.463,66)   | 15.12.2022 |
| Dollar General                                | USD     | 9.545,00                                | 1.986.951,05  | 81.406,17   | (7.436,56)   | 15.12.2022 |
| eBay  | USD     | 752.353,00                              | 43.986.064,29   | 405.187,24  | (5.728.407,09)   | 15.12.2022 |
| Estee Lauder Cos                              | USD     | 22.137,00                               | 7.198.018,57  | 61.955,85   | 334.161,89   | 15.12.2022 |
| Expeditors International of Washington        | USD     | 239.015,00                              | 28.030.161,55   | (481.132,04)  | 1.316.222,49   | 15.12.2022 |
| F5  | USD     | 59.040,00                               | 12.798.385,39   | 502.490,27  | 257.172,91   | 15.12.2022 |
| Fiserv  | USD     | 75.696,00                               | 6.969.792,83  | 42.103,46   | 121.971,42   | 15.12.2022 |
| Hershey                                       | USD     | 258.803,00                              | 43.687.929,77   | 326.745,50  | 2.818.306,25   | 15.12.2022 |
| Infosys ADR                                   | USD     | 904.408,00                              | 20.345.487,01   | 1.772.644,47  | (296.264,68)   | 15.12.2022 |
| Intuit  | USD     | 743,00                                  | 420.301,91  | (4.441,01)  | 14.044,31  | 15.12.2022 |
| Johnson & Johnson                             | USD     | 657.438,00                              | 99.882.515,48   | 545.615,78  | 4.435.305,51   | 15.12.2022 |
| Kellogg                                       | USD     | 33.192,00                               | 1.873.744,30  | 12.894,08   | (12.048,45)  | 15.12.2022 |
| Kimberly-Clark                                | USD     | 368.080,00                              | 46.126.583,90   | 1.182.899,57  | 1.147.093,05   | 15.12.2022 |
| Kyndryl Holdings                              | USD     | 12.568,00                               | 206.276,54  | 8.987,84  | 196.363,61   | 15.12.2022 |
| Lowe's Cos                                    | USD     | 2.131,00                                | 482.793,37  | (1.749,73)  | 42.676,60  | 15.12.2022 |
| Marsh & McLennan Cos                          | USD     | 315.699,00                              | 48.319.938,81   | 819.454,43  | 858.075,19   | 15.12.2022 |
| McDonald's                                    | USD     | 406.366,00                              | 95.918.377,45   | 1.015.331,99  | 4.166.195,91   | 15.12.2022 |
| Medtronic                                     | USD     | 164.884,00                              | 15.200.801,04   | (75.698,30)   | (1.753.809,02)   | 15.12.2022 |
| Merck   | USD     | 112.743,00                              | 7.691.388,88  | 197.087,49  | (838.460,56)   | 15.12.2022 |
| Microsoft                                     | USD     | 184.414,00                              | 54.930.998,44   | 444.488,78  | (231.844,07)   | 15.12.2022 |
| Monster Beverage                              | USD     | 71.516,00                               | 6.028.016,18  | 268.978,20  | (113.336,56)   | 15.12.2022 |
| National Grid                                 | GBP     | 156.006,00                              | 1.968.140,16  | 1.485,67  | 141.755,38   | 15.12.2022 |
| NIKE  | USD     | 490.541,00                              | 72.230.987,57   | 1.247.303,30  | (2.149.781,28)   | 15.12.2022 |
| Oracle  | USD     | 184.245,00                              | 14.269.166,48   | (2.591.288,44)  | 1.570.853,79   | 15.12.2022 |
| Organon                                       | USD     | 11.274,00                               | 305.477,47  | 13.536,96   | (40.424,70)  | 15.12.2022 |
| Paychex                                       | USD     | 172.616,00                              | 20.752.324,85   | 1.659.637,35  | 122.260,12   | 15.12.2022 |
| PepsiCo                                       | USD     | 646.548,00                              | 98.290.822,62   | 353.913,18  | 4.447.700,72   | 15.12.2022 |
| Pfizer  | USD     | 109.969,00                              | 5.759.379,41  | 50.486,81   | 890.851,13   | 15.12.2022 |
| Procter & Gamble                              | USD     | 629.706,00                              | 90.387.676,32   | 2.068.164,32  | 6.389.048,93   | 15.12.2022 |
| Public Service Enterprise Group               | USD     | 94.573,00                               | 5.532.518,42  | 59.282,95   | 185.043,23   | 15.12.2022 |
| Rightmove                                     | GBP     | 922.666,00                              | 8.731.773,30  | 540.381,44  | 114.817,39   | 15.12.2022 |
| Ross Stores                                   | USD     | 233.234,00                              | 23.470.632,01   | 1.062.541,33  | (1.369.049,51)   | 15.12.2022 |
| Starbucks                                     | USD     | 267.045,00                              | 27.497.866,40   | 459.751,69  | 664.361,62   | 15.12.2022 |
| Stryker                                       | USD     | 184.410,00                              | 43.972.500,64   | 2.907.837,91  | (1.578.791,24)   | 15.12.2022 |
| Target  | USD     | 26.864,00                               | 5.454.152,16  | (158.672,28)  | (658.340,43)   | 15.12.2022 |
| Techtronic Industries                         | HKD     | 399.951,00                              | 7.026.721,14  | (330.509,44)  | (299.523,36)   | 15.07.2022 |
| Texas Roadhouse                               | USD     | 449.990,00                              | 36.149.375,49   | 2.745.270,74  | (2.908.301,91)   | 15.12.2022 |
| TJX Cos                                       | USD     | 460.511,00                              | 30.737.325,42   | 1.032.709,08  | 1.524.843,86   | 15.12.2022 |
| Toro  | USD     | 237.379,00                              | 20.813.233,14   | 268.260,38  | (813.330,44)   | 15.12.2022 |
| Unilever                                      | GBP     | 989.088,00                              | 46.458.620,53   | (278.456,19)  | 719.919,45   | 15.12.2022 |
| UnitedHealth Group                            | USD     | 112.056,00                              | 49.892.695,38   | 982.400,64  | 4.323.506,41   | 15.12.2022 |
| Verizon Communications                        | USD     | 157.610,00                              | 7.267.885,32  | 233.774,60  | (258.148,30)   | 15.12.2022 |
| VMware  | USD     | 176.795,00                              | 18.285.908,50   | 602.506,24  | (1.779.689,38)   | 15.12.2022 |
| Waste Management                              | USD     | 312.271,00                              | 45.710.971,49   | 901.537,25  | (129.940,12)   | 15.12.2022 |
| WW Grainger                                   | USD     | 101.756,00                              | 46.357.757,13   | 185.068,08  | 2.660.340,58   | 15.12.2022 |
| Xilinx  | USD     | 191.887,00                              | 35.939.529,62   | (947.025,41)  | 417.921,22   | 15.12.2022 |
| Zimmer Biomet Holdings                        | USD     | 33.432,00                               | 3.778.127,40  | 216.061,66  | (309.308,90)   | 15.12.2022 |
|   |         | <b>17.988.013,00</b>                    | <b>2.042.716.434,46</b>                               | <b>47.072.317,92</b>  | <b>43.977.942,81</b>   |            |
|   |         | <b>43.749.099,00</b>                    | <b>4.114.921.720,50</b>                               | <b>108.663.289,08</b>   | <b>47.731.476,66</b>   |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Total Return Swaps

| Basiswert   | Währung | Stückzahl           | Verpflichtung in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|---------|---------------------|---|---|--|------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>                       |         |                     |   |   |  |            |
| S&P 500 Total Return 4 JAN 1988 Index against variable rate USONBFR | USD     | (33.574,00)         | (296.567.221,24)                                      | (4.100.913,00)  | (4.447.796,88)   | 08.07.2022 |
| S&P 500 Total Return 4 JAN 1988 Index against variable rate USONBFR | USD     | (74.752,00)         | (660.302.404,31)                                      | (9.130.620,39)  | (9.902.952,06)   | 14.09.2022 |
| S&P 500 Total Return 4 JAN 1988 Index against variable rate USONBFR | USD     | (38.626,00)         | (341.192.752,95)                                      | (4.717.992,07)  | (5.117.072,80)   | 09.05.2022 |
| S&P 500 Total Return 4 JAN 1988 Index against variable rate USONBFR | USD     | (37.543,00)         | (331.626.353,34)                                      | (4.585.708,49)  | (4.973.599,76)   | 18.05.2022 |
|   |         | <b>(184.495,00)</b> | <b>(1.629.688.731,84)</b>                             | <b>(22.535.233,95)</b>  | <b>(24.441.421,50)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>                       |         |                     |   |   |  |            |
| S&P 500 Total Return 4 JAN 1988 Index against variable rate USONBFR | USD     | (12.013,00)         | (106.113.719,81)                                      | (3.467.507,67)  | (6.532.167,67)   | 17.06.2022 |
|   |         | <b>(12.013,00)</b>  | <b>(106.113.719,81)</b>                               | <b>(3.467.507,67)</b>   | <b>(6.532.167,67)</b>  |            |
|   |         | <b>(196.508,00)</b> | <b>(1.735.802.451,65)</b>                             | <b>(26.002.741,62)</b>  | <b>(30.973.589,17)</b>   |            |

### FX-Optionen (OTC)

| Beschreibung                           | Kauf/Verkauf | Put/Call | Strike | Laufzeit   | Währung | Erworbener/ (veräußerter) Betrag in Währung | Verpflichtung* in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Marktwert in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) |
|--|--------------|----------|--------|------------|---------|---|--|---|
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>       |              |          |        |            |         |   |  |   |
| FXO USD/CAD with delta 25 and 20220429 | Kauf         | Call     | 1,285  | 29.04.2022 | USD     | 12.857.637,00                               | -  | 121.170,41  |
|  |              |          |        |            | CAD     | (16.522.063,55)                             | -  | -   |
| FXO USD/CAD Delta 25 End 20220527      | Kauf         | Call     | 1,276  | 27.05.2022 | USD     | 5.913.279,00                                | -  | 78.483,57   |
|  |              |          |        |            | CAD     | (7.545.344,00)                              | -  | -   |
| FXO AUD/USD Delta 25 End 20220325      | Kauf         | Put      | 0,7227 | 25.03.2022 | AUD     | 6.435.394,00                                | -  | 57.256,75   |
|  |              |          |        |            | USD     | (4.650.859,24)                              | -  | -   |
| FXO USD/CAD Delta 25 End 20220906      | Kauf         | Call     | 1,3242 | 06.09.2022 | USD     | 11.882.368,00                               | -  | 103.158,56  |
|  |              |          |        |            | CAD     | (15.734.631,71)                             | -  | -   |
|  |              |          |        |            |         |   |  | <b>360.069,29</b>                                 |

(\*) Bei gekauften Optionen muss keine Verpflichtung ausgewiesen werden. Dies gilt lediglich für verkaufte (geschriebene) Optionen.

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps, Equity Swaps, Devisenterminkontrakte und Total Return Swaps 84.180.000,00 EUR erhalten.  
 BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 6.540.000,00 EUR gezahlt.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Equity Swaps, Devisenterminkontrakte und Total Return Swaps 53.370.000,00 EUR gezahlt.  
 Citibank Europe PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 360.000,00 EUR erhalten.  
 J.P. Morgan SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps, Devisenterminkontrakte und FX-Optionen (OTC) 1.280.000,00 EUR gezahlt.  
 Société Générale hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte 310.000,00 EUR erhalten.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|---|--------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| <b>AUD</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 93.576,00   | Computershare   | 1.356.384,12               | 1,35                         |   |              |                            |                              |
| 6.986,00  | CSL   | 1.471.945,45               | 1,46                         |   |              |                            |                              |
| 56.722,00   | OZ Minerals   | 1.160.103,59               | 1,15                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>3.988.433,16</b>        | <b>3,97</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>HKD</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 65.400,00   | AIA Group   | 659.098,38                 | 0,66                         |   |              |                            |                              |
| 208.852,00  | Alibaba Group Holding   | 3.183.980,80               | 3,17                         |   |              |                            |                              |
| 156.600,00  | ASM Pacific Technology  | 1.691.654,29               | 1,68                         |   |              |                            |                              |
| 97.922,00   | Baidu   | 1.815.509,45               | 1,81                         |   |              |                            |                              |
| 213.000,00  | China Mengniu Dairy   | 1.207.123,82               | 1,20                         |   |              |                            |                              |
| 310.000,00  | China Merchants Bank  | 2.406.721,22               | 2,39                         |   |              |                            |                              |
| 1.356.000,00  | China Merchants Port Holdings   | 2.468.868,63               | 2,46                         |   |              |                            |                              |
| 289.400,00  | Haier Smart Home  | 1.222.654,90               | 1,22                         |   |              |                            |                              |
| 44.000,00   | Hong Kong Exchanges & Clearing  | 2.569.186,61               | 2,56                         |   |              |                            |                              |
| 19.200,00   | JD.com  | 674.530,73                 | 0,67                         |   |              |                            |                              |
| 490.500,00  | Johnson Electric Holdings   | 1.038.960,42               | 1,03                         |   |              |                            |                              |
| 314.000,00  | Mint Group  | 1.382.949,55               | 1,38                         |   |              |                            |                              |
| 1.586.000,00  | Plover Bay Technologies   | 813.416,77                 | 0,81                         |   |              |                            |                              |
| 439.900,00  | Samsonite International   | 893.427,03                 | 0,89                         |   |              |                            |                              |
| 49.200,00   | Shenzhen International Group Holdings   | 945.620,07                 | 0,94                         |   |              |                            |                              |
| 47.000,00   | Techtronic Industries   | 935.275,42                 | 0,93                         |   |              |                            |                              |
| 58.200,00   | Tencent Holdings  | 3.408.780,42               | 3,39                         |   |              |                            |                              |
| 458.000,00  | Vesync  | 556.116,02                 | 0,55                         |   |              |                            |                              |
| 343.000,00  | Weichai Power   | 671.117,56                 | 0,67                         |   |              |                            |                              |
| 484.000,00  | Xtep International Holdings   | 806.749,42                 | 0,80                         |   |              |                            |                              |
| 137.000,00  | Zhongsheng Group Holdings   | 1.068.006,99               | 1,06                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>30.419.748,50</b>       | <b>30,27</b>                 |   |              |                            |                              |
| <b>IDR</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 2.427.900,00  | Bank Mandiri Persero  | 1.196.702,16               | 1,19                         |   |              |                            |                              |
| 21.364.500,00   | Erajaya Swasembada  | 899.400,11                 | 0,89                         |   |              |                            |                              |
| 17.960.659,00   | Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul   | 1.090.052,27               | 1,08                         |   |              |                            |                              |
| 5.530.600,00  | Mitra Keluarga Karyasehat   | 876.979,90                 | 0,87                         |   |              |                            |                              |
| 4.355.100,00  | Telkom Indonesia Persero  | 1.234.492,48               | 1,23                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>5.297.626,92</b>        | <b>5,27</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>INR</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 263.796,00  | ICICI Bank  | 2.626.581,05               | 2,61                         |   |              |                            |                              |
| 96.588,00   | IndusInd Bank   | 1.154.017,38               | 1,15                         |   |              |                            |                              |
| 132.414,00  | Minda Industries  | 2.181.823,77               | 2,17                         |   |              |                            |                              |
| 18.942,00   | PI Industries   | 773.166,26                 | 0,77                         |   |              |                            |                              |
| 50.588,00   | Solara Active Pharma Sciences   | 693.499,03                 | 0,69                         |   |              |                            |                              |
| 31.471,00   | Tata Consultancy Services   | 1.582.680,89               | 1,57                         |   |              |                            |                              |
| 61.868,00   | Volta   | 1.014.672,94               | 1,01                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>10.026.441,32</b>       | <b>9,98</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>KRW</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 18.340,00   | KakaoBank   | 910.250,51                 | 0,91                         |   |              |                            |                              |
| 2.075,00  | LG Chem   | 1.073.501,87               | 1,07                         |   |              |                            |                              |
| 2.915,00  | NAVER   | 928.141,16                 | 0,92                         |   |              |                            |                              |
| 103.456,00  | Samsung Electronics   | 6.814.390,77               | 6,78                         |   |              |                            |                              |
| 2.821,00  | Samsung SDI   | 1.554.368,46               | 1,55                         |   |              |                            |                              |
| 14.720,00   | Shinhan Financial Group   | 455.685,51                 | 0,45                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>11.736.338,28</b>       | <b>11,68</b>                 |   |              |                            |                              |
| <b>MYR</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 368.700,00  | Hartalega Holdings  | 507.117,39                 | 0,50                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>507.117,39</b>          | <b>0,50</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>PHP</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 35.050,00   | PLDT  | 1.245.489,04               | 1,24                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>1.245.489,04</b>        | <b>1,24</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>SGD</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 597.700,00  | ComfortDelGro   | 620.020,74                 | 0,62                         |   |              |                            |                              |
| 46.600,00   | DBS Group Holdings  | 1.127.708,94               | 1,12                         |   |              |                            |                              |
| 933.100,00  | Raffles Medical Group   | 947.204,35                 | 0,94                         |   |              |                            |                              |
| 579.600,00  | SIA Engineering   | 936.224,06                 | 0,93                         |   |              |                            |                              |
| 58.800,00   | Venture   | 797.738,58                 | 0,79                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>4.428.896,67</b>        | <b>4,41</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>THB</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 290.000,00  | Com7  | 709.699,19                 | 0,71                         |   |              |                            |                              |
| 3.952.000,00  | Eastern Polymer Group   | 1.325.023,27               | 1,32                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>2.034.722,46</b>        | <b>2,02</b>                  |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>TWD</b>  |              |                            |                              |
| 228.000,00  | ASE Technology Holding  | 877.652,01                 | 0,87                         |   |              |                            |                              |
| 6.000,00  | ASMedia Technology  | 394.694,01                 | 0,39                         |   |              |                            |                              |
| 224.000,00  | Century Iron & Steel Industrial   | 894.639,75                 | 0,89                         |   |              |                            |                              |
| 213.000,00  | Chroma ATE  | 1.539.740,36               | 1,53                         |   |              |                            |                              |
| 113.000,00  | Episil-Precision  | 545.252,42                 | 0,54                         |   |              |                            |                              |
| 391.983,00  | Fubon Financial Holding   | 1.081.009,89               | 1,08                         |   |              |                            |                              |
| 74.000,00   | Makalot Industrial  | 660.642,59                 | 0,66                         |   |              |                            |                              |
| 84.000,00   | Realtek Semiconductor   | 1.760.942,50               | 1,75                         |   |              |                            |                              |
| 125.000,00  | Sinbon Electronics  | 1.283.116,97               | 1,28                         |   |              |                            |                              |
| 394.854,00  | Taiwan Semiconductor Manufacturing  | 8.777.069,83               | 8,73                         |   |              |                            |                              |
| 172.000,00  | Visual Photonics Epitaxy  | 895.218,06                 | 0,89                         |   |              |                            |                              |
| 25.000,00   | Wiwynn  | 1.007.517,90               | 1,00                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>19.717.496,29</b>       | <b>19,62</b>                 |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>VND</b>  |              |                            |                              |
| 339.550,00  | Vincom Retail JSC   | 448.462,26                 | 0,45                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>448.462,26</b>          | <b>0,45</b>                  |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>89.850.772,29</b>       | <b>89,40</b>                 |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>89.850.772,29</b>       | <b>89,40</b>                 |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>Aktien</b>   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>CNY</b>  |              |                            |                              |
| 219.556,00  | Chacha Food   | 2.113.795,13               | 2,10                         |   |              |                            |                              |
| 386.100,00  | NARI Technology   | 2.425.032,83               | 2,41                         |   |              |                            |                              |
| 211.765,00  | Ningbo Orient Wires & Cables  | 1.699.874,85               | 1,69                         |   |              |                            |                              |
| 33.100,00   | Sungrow Power Supply  | 757.212,45                 | 0,75                         |   |              |                            |                              |
| 39.600,00   | Wingtech Technology   | 803.389,11                 | 0,80                         |   |              |                            |                              |
| 262.763,00  | Zhejiang Sanhua Intelligent Controls  | 1.043.078,43               | 1,04                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>8.842.382,80</b>        | <b>8,80</b>                  |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>8.842.382,80</b>        | <b>8,80</b>                  |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>8.842.382,80</b>        | <b>8,80</b>                  |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>98.693.155,09</b>       | <b>98,20</b>                 |   |              |                            |                              |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>2.435.846,36</b>        | <b>2,42</b>                  |   |              |                            |                              |
|   | <b>Sonstige Nettverbindlichkeiten</b>   | <b>(629.961,98)</b>        | <b>(0,63)</b>                |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>100.499.039,47</b>      | <b>100,00</b>                |   |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| Taiwan, Provinz Chinas | 19,62        | Halbleiter  | 12,29        |
| Kaimaninseln           | 17,47        | Verschiedene Banken                                 | 9,83         |
| China                  | 13,08        | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie    | 7,78         |
| Republik Korea         | 11,68        | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 6,12         |
| Indien                 | 9,98         | Autoteile und -zubehör                              | 4,58         |
| Hongkong               | 6,60         | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 3,84         |
| Indonesien             | 5,27         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 3,30         |
| Singapur               | 4,41         | Elektronische Komponenten                           | 2,82         |
| Australien             | 3,97         | Halbleiter-Ausrüstung                               | 2,57         |
| Thailand               | 2,02         | Börsen und Finanzdaten                              | 2,56         |
| Philippinen            | 1,24         | Bekleidung, Accessoires und Luxusgüter              | 2,49         |
| Bermuda                | 1,03         | Schifffahrt: Häfen und Dienstleistungen             | 2,46         |
| Luxemburg              | 0,89         | Elektrische Komponenten und Ausrüstung              | 2,44         |
| Malaysia               | 0,50         | Elektrische Anlagen                                 | 2,41         |
| Vietnam                | 0,45         | Rohstoffchemikalien                                 | 2,39         |
|                        |              | Industriemaschinen                                  | 1,97         |
| <b>Summe</b>           | <b>98,20</b> | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 1,82         |
|                        |              | Haushaltsgeräte                                     | 1,77         |
|                        |              | Lebens- und Krankenversicherung                     | 1,73         |
|                        |              | Dienste für die Herstellung elektronischer Geräte   | 1,59         |
|                        |              | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen           | 1,57         |
|                        |              | Hersteller von Elektronikausrüstung                 | 1,53         |
|                        |              | Biotechnologie                                      | 1,46         |
|                        |              | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 1,35         |
|                        |              | Drahtlose Telekommunikationsdienste                 | 1,24         |
|                        |              | Integrierte Telekommunikationsdienste               | 1,23         |
|                        |              | Kupfer  | 1,15         |
|                        |              | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 1,08         |
|                        |              | Kraftfahrzeugeinzelhandel                           | 1,06         |
|                        |              | Bau- und Ingenieurwesen                             | 1,01         |
|                        |              | Flughafendienste                                    | 0,93         |
|                        |              | Stahl   | 0,89         |
|                        |              | Technologievertrieb                                 | 0,89         |
|                        |              | Kommunikationsanlagen                               | 0,81         |
|                        |              | Schuhe  | 0,80         |
|                        |              | Dünger und Chemikalien für die Landwirtschaft       | 0,77         |
|                        |              | Computer und Elektronik-Einzelhandel                | 0,71         |
|                        |              | Pharmazeutika                                       | 0,69         |
|                        |              | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 0,67         |
|                        |              | Spedition/Transport                                 | 0,62         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Produkte                          | 0,50         |
|                        |              | Immobilien: REOC                                    | 0,45         |
|                        |              | <b>Summe</b>  | <b>98,20</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 4.393.586,54                                      | PLN               | 1.046.688,41       | USD                | 34.010,66  | 28.01.2022 |
| 103.113,65  | USD               | 425.601,25         | PLN                | (1.572,38)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>32.438,28</b>   |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.



# Nordea 1 - Asian Stars Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| <b>HKD</b>  |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 1.020.800,00  | AIA Group   | 10.287.578,31              | 4,32                         |                    |              |                            |                              |
| 858.504,00  | Alibaba Group Holding   | 13.088.025,25              | 5,50                         |                    |              |                            |                              |
| 821.500,00  | China Merchants Bank  | 6.377.811,25               | 2,68                         |                    |              |                            |                              |
| 142.600,00  | Hong Kong Exchanges & Clearing  | 8.326.500,23               | 3,50                         |                    |              |                            |                              |
| 168.000,00  | JD.com  | 5.902.143,86               | 2,48                         |                    |              |                            |                              |
| 1.366.000,00  | Kingdee International Software Group  | 4.203.508,09               | 1,77                         |                    |              |                            |                              |
| 470.500,00  | Li Ning   | 5.148.883,91               | 2,16                         |                    |              |                            |                              |
| 290.200,00  | Meituan   | 8.386.896,17               | 3,52                         |                    |              |                            |                              |
| 613.000,00  | Ping An Insurance Group Co of China   | 4.413.266,79               | 1,85                         |                    |              |                            |                              |
| 325.700,00  | Tencent Holdings  | 19.076.284,93              | 8,02                         |                    |              |                            |                              |
|   |   | <b>85.210.898,79</b>       | <b>35,81</b>                 |                    |              |                            |                              |
| <b>IDR</b>  |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 19.435.756,00   | Bank Rakyat Indonesia Persero   | 5.604.697,92               | 2,36                         |                    |              |                            |                              |
|   |   | <b>5.604.697,92</b>        | <b>2,36</b>                  |                    |              |                            |                              |
| <b>INR</b>  |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 149.659,00  | Havells India   | 2.812.561,98               | 1,18                         |                    |              |                            |                              |
| 382.385,00  | HDFC Bank   | 7.610.081,69               | 3,20                         |                    |              |                            |                              |
| 540.193,00  | HDFC Life Insurance   | 4.720.243,42               | 1,98                         |                    |              |                            |                              |
| 150.143,00  | Hindustan Unilever  | 4.767.026,34               | 2,00                         |                    |              |                            |                              |
| 194.472,00  | Housing Development Finance   | 6.766.499,04               | 2,84                         |                    |              |                            |                              |
| 139.650,00  | ICICI Lombard General Insurance   | 2.632.445,70               | 1,11                         |                    |              |                            |                              |
| 64.733,00   | Info Edge India   | 4.856.304,09               | 2,04                         |                    |              |                            |                              |
| 80.021,00   | Pidilite Industries   | 2.651.160,23               | 1,11                         |                    |              |                            |                              |
| 492.007,00  | Varun Beverages   | 5.879.410,73               | 2,47                         |                    |              |                            |                              |
| 143.232,00  | Aarti Industries  | 1.935.691,25               | 0,81                         |                    |              |                            |                              |
|   |   | <b>44.631.424,47</b>       | <b>18,76</b>                 |                    |              |                            |                              |
| <b>KRW</b>  |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 198.763,00  | Koh Young Technology  | 3.962.720,84               | 1,67                         |                    |              |                            |                              |
| 34.812,00   | LEENO Industrial  | 5.807.126,39               | 2,44                         |                    |              |                            |                              |
| 4.615,00  | LG Household & Health Care  | 4.258.806,64               | 1,79                         |                    |              |                            |                              |
| 335.631,00  | Samsung Electronics   | 22.107.183,62              | 9,29                         |                    |              |                            |                              |
| 12.696,00   | Samsung SDI   | 6.995.484,57               | 2,94                         |                    |              |                            |                              |
|   |   | <b>43.131.322,06</b>       | <b>18,13</b>                 |                    |              |                            |                              |
| <b>TWD</b>  |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 689.000,00  | Chroma ATE  | 4.980.662,49               | 2,09                         |                    |              |                            |                              |
| 18.000,00   | Silergy   | 3.269.237,46               | 1,37                         |                    |              |                            |                              |
| 1.039.000,00  | Taiwan Semiconductor Manufacturing  | 23.095.563,30              | 9,71                         |                    |              |                            |                              |
|   |   | <b>31.345.463,25</b>       | <b>13,17</b>                 |                    |              |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 120.468,00  | Kingsoft Cloud Holdings ADR   | 1.956.400,32               | 0,82                         |                    |              |                            |                              |
| 22.814,00   | Sea ADR   | 5.095.050,62               | 2,14                         |                    |              |                            |                              |
|   |   | <b>7.051.450,94</b>        | <b>2,96</b>                  |                    |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>216.975.257,43</b>      | <b>91,19</b>                 |                    |              |                            |                              |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>216.975.257,43</b>      | <b>91,19</b>                 |                    |              |                            |                              |
| <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                   |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| <b>CNY</b>  |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 973.900,00  | East Money Information  | 5.670.711,48               | 2,38                         |                    |              |                            |                              |
| 371.940,00  | Foshan Haitian Flavouring & Food  | 6.134.076,02               | 2,58                         |                    |              |                            |                              |
| 219.677,00  | Glodon  | 2.205.266,38               | 0,93                         |                    |              |                            |                              |
|   |   | <b>14.010.053,88</b>       | <b>5,89</b>                  |                    |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>TWD</b>         |              |                            |                              |
|   | 35.000,00 ASPEED Technology   | 4.509.885,07               | 1,90                         |                    |              |                            |                              |
|   |   | <b>4.509.885,07</b>        | <b>1,90</b>                  |                    |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>18.519.938,95</b>       | <b>7,78</b>                  |                    |              |                            |                              |
|   | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>18.519.938,95</b>       | <b>7,78</b>                  |                    |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>235.495.196,38</b>      | <b>98,97</b>                 |                    |              |                            |                              |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>5.212.528,21</b>        | <b>2,19</b>                  |                    |              |                            |                              |
|   | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(2.772.843,88)</b>      | <b>(1,17)</b>                |                    |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>237.934.880,71</b>      | <b>100,00</b>                |                    |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Balanced Income Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>AUD</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 610.000,00  | Australia Government Bond 2.25% 21-05-2028        | 408.674,28                 | 0,07                         | 6.911.607,00       | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2030 | 7.072.647,44               | 1,17                         |
| 469.000,00  | Australia Government Bond 2.5% 21-05-2030         | 320.620,35                 | 0,05                         | 253.387,70         | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2031 | 258.612,55                 | 0,04                         |
| 559.000,00  | Australia Government Bond 2.75% 21-11-2029        | 388.774,60                 | 0,06                         | 183.863,42         | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2031 | 187.139,72                 | 0,03                         |
| 149.000,00  | Australia Government Bond 3.25% 21-04-2029        | 106.589,10                 | 0,02                         | 86.269,95          | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2050 | 82.576,22                  | 0,01                         |
| 1.900.000,00  | Australia Government Bond 4.25% 21-04-2026        | 1.366.800,50               | 0,23                         | 1.418.565,00       | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-11-2027 | 1.453.791,94               | 0,24                         |
| 218.000,00  | Australia Government Bond 4.75% 21-04-2027        | 163.520,77                 | 0,03                         | 468.015,98         | Bundesrepublik Deutschland B 0.25% 15-02-2027     | 485.090,14                 | 0,08                         |
|   |   | <b>2.754.979,60</b>        | <b>0,46</b>                  | 8.014.303,00       | Bundesrepublik Deutschland B 0.25% 15-02-2029     | 8.367.156,73               | 1,39                         |
| <b>CAD</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.577.000,00  | Canadian Government Bond 1.5% 01-06-2026          | 1.107.205,44               | 0,18                         | 250.289,14         | Bundesrepublik Deutschland B 0.25% 15-08-2028     | 260.975,99                 | 0,04                         |
| 1.005.000,00  | Canadian Government Bond 1.5% 01-06-2031          | 701.060,62                 | 0,12                         | 799.824,00         | Bundesrepublik Deutschland B 0.5% 15-02-2025      | 828.067,39                 | 0,14                         |
| 420.000,00  | Canadian Government Bond 2% 01-06-2028            | 303.911,41                 | 0,05                         | 118.065,28         | Bundesrepublik Deutschland B 0.5% 15-02-2028      | 124.744,23                 | 0,02                         |
| 614.000,00  | Canadian Government Bond 2.25% 01-06-2029         | 453.963,57                 | 0,08                         | 544.150,00         | Bundesrepublik Deutschland B 1% 15-08-2025        | 575.117,58                 | 0,10                         |
|   |   | <b>2.566.141,04</b>        | <b>0,43</b>                  | 130.591,27         | Bundesrepublik Deutschland B 1.5% 15-05-2024      | 137.350,41                 | 0,02                         |
| <b>DKK</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 20.000.000,00   | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2022 SDO A E        | 2.699.763,40               | 0,45                         | 3.950.000,00       | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 10-03-2023      | 3.980.628,30               | 0,66                         |
| 105.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 01-01-2022 SDO A H         | 14.119.924,35              | 2,34                         | 24.951.200,00      | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 10-06-2022      | 25.030.295,30              | 4,15                         |
| 36.000.000,00   | Nykredit Realkredit 1% 01-01-2022 SDO AR H        | 4.841.116,92               | 0,80                         | 29.580.000,00      | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 15-09-2023      | 29.910.423,69              | 4,96                         |
| 127.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 04-01-2022 SDO AR H        | 17.143.559,22              | 2,84                         | 17.840.000,00      | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 15-12-2022      | 17.948.824,00              | 2,98                         |
| 34.600.000,00   | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2022 SDO A H         | 4.689.105,81               | 0,78                         | 6.120.000,00       | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 16-06-2023      | 6.178.752,00               | 1,02                         |
| 28.000.000,00   | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2025 SDO A H         | 3.905.895,38               | 0,65                         | 12.052.500,00      | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 16-09-2022      | 12.111.653,67              | 2,01                         |
| 36.000.000,00   | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2026 SDO A H         | 5.039.298,01               | 0,84                         | 2.400.000,00       | Caisse Francaise de Financem 0.01% 18-03-2031     | 2.341.939,20               | 0,39                         |
| 56.000.000,00   | Realkredit Danmark 1% 04-01-2022 SDRO A T         | 7.559.340,22               | 1,25                         | 900.000,00         | Caisse Francaise de Financem 0.01% 22-02-2028     | 895.753,80                 | 0,15                         |
| 286.000.000,00  | Realkredit Danmark 1% 04-01-2022 SDRO AR T        | 38.606.775,41              | 6,40                         | 100.000,00         | Caisse Francaise de Financem 0.5% 19-01-2026      | 102.249,80                 | 0,02                         |
| 37.000.000,00   | Realkredit Danmark 1% 04-01-2026 SDRO A T         | 5.176.443,82               | 0,86                         | 2.000.000,00       | Caisse Francaise de Financem 0.625% 13-04-2026    | 2.056.520,00               | 0,34                         |
|   |   | <b>103.781.222,54</b>      | <b>17,21</b>                 | 200.000,00         | Caisse Francaise de Financem 1.5% 28-06-2038      | 230.336,40                 | 0,04                         |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 100.000,00  | Achmea Bank NV 0.01% 16-06-2025                   | 100.241,20                 | 0,02                         | 2.500.000,00       | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 07-10-2026     | 2.505.659,08               | 0,42                         |
| 600.000,00  | Aegon Bank NV 0.01% 16-11-2025                    | 600.412,80                 | 0,10                         | 300.000,00         | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 30-04-2029     | 295.889,40                 | 0,05                         |
| 400.000,00  | Aegon Bank NV 0.375% 09-06-2036                   | 391.541,60                 | 0,06                         | 200.000,00         | Canadian Imperial Bank of Co 0.04% 09-07-2027     | 199.452,40                 | 0,03                         |
| 800.000,00  | Aegon Bank NV 0.375% 21-11-2024                   | 811.302,40                 | 0,13                         | 1.500.000,00       | Canadian Imperial Bank of Co 0.25% 27-09-2023     | 1.514.661,00               | 0,25                         |
| 900.000,00  | Argenta Spaarbank NV 0.01% 11-02-2031             | 880.212,60                 | 0,15                         | 4.600.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.2% 16-09-2022      | 4.623.717,60               | 0,77                         |
| 100.000,00  | Australia & New Zealand Bank 0.25% 29-11-2022     | 100.684,80                 | 0,02                         | 2.500.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.225% 14-09-2026    | 2.527.425,00               | 0,42                         |
| 100.000,00  | Bausparkasse Schwaebisch Hal 0.01% 22-10-2030     | 98.220,00                  | 0,02                         | 1.500.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.325% 12-09-2023    | 1.517.967,00               | 0,25                         |
| 200.000,00  | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.01% 03-09-2029     | 197.655,20                 | 0,03                         | 1.000.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.75% 21-01-2025     | 1.027.606,00               | 0,17                         |
| 100.000,00  | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.1% 12-05-2031      | 98.266,43                  | 0,02                         | 2.900.000,00       | Cie de Financement Foncier S 1% 02-02-2026        | 3.024.862,40               | 0,50                         |
| 2.200.000,00  | BPCE SFH SA 0.01% 10-11-2027                      | 2.192.630,00               | 0,36                         | 2.800.000,00       | Commerzbank AG 0.875% 18-04-2028                  | 2.940.806,40               | 0,49                         |
| 300.000,00  | BPCE SFH SA 0.01% 16-10-2028                      | 297.723,60                 | 0,05                         | 400.000,00         | Commonwealth Bank of Austral 0.125% 15-10-2029    | 395.465,60                 | 0,07                         |
| 600.000,00  | BPCE SFH SA 0.01% 18-03-2031                      | 585.484,80                 | 0,10                         | 200.000,00         | Commonwealth Bank of Austral 0.375% 24-04-2023    | 202.088,00                 | 0,03                         |
| 4.700.000,00  | BPCE SFH SA 0.01% 29-01-2029                      | 4.657.455,60               | 0,77                         | 1.500.000,00       | Coventry Building Society 0.01% 07-07-2028        | 1.479.789,00               | 0,25                         |
| 100.000,00  | BPCE SFH SA 0.375% 10-02-2023                     | 100.955,60                 | 0,02                         | 500.000,00         | CPPIB Capital Inc 0.375% 20-06-2024               | 507.561,95                 | 0,08                         |
| 1.000.000,00  | BPCE SFH SA 0.375% 21-02-2024                     | 1.014.482,00               | 0,17                         | 2.000.000,00       | Credit Agricole Public Secto 0.5% 10-10-2025      | 2.043.712,00               | 0,34                         |
| 334.297,13  | Bundesobligation 0.000000% 10-10-2025             | 341.317,30                 | 0,06                         | 1.200.000,00       | Danmarks Skibskredit 0.125% 03-20-2025            | 1.199.064,00               | 0,20                         |
| 1.136.175,00  | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-02-2030 | 1.164.011,29               | 0,19                         | 4.000.000,00       | DBS Bank Ltd 0.375% 21-11-2024                    | 4.058.528,00               | 0,67                         |
| 145.154,29  | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2026 | 148.520,42                 | 0,02                         | 1.000.000,00       | de Volksbank NV 0.5% 30-01-2026                   | 1.021.922,00               | 0,17                         |
| 9.986.861,00  | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2029 | 10.236.692,31              | 1,70                         | 300.000,00         | de Volksbank NV 0.75% 18-05-2027                  | 311.515,80                 | 0,05                         |
|   |   |                            |                              | 1.900.000,00       | Deutsche Kreditbank AG 0.875% 02-10-2028          | 1.998.667,00               | 0,33                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Balanced Income Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                     | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 400.000,00         | DNB Boligkreditt AS 0.01% 08-10-2027              | 398.550,40                 | 0,07                         | 34.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 0.4% 15-05-2030     | 38.876,82                  | 0,01                         |
| 1.200.000,00       | DNB Boligkreditt AS 0.01% 21-01-2031              | 1.173.252,00               | 0,19                         | 303.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.6% 01-08-2031     | 288.433,05                 | 0,05                         |
| 1.800.000,00       | DNB Boligkreditt AS 0.375% 20-11-2024             | 1.828.789,20               | 0,30                         | 349.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.85% 15-01-2027    | 355.700,80                 | 0,06                         |
| 2.000.000,00       | DZ HYP AG 0.01% 20-04-2029                        | 1.985.096,00               | 0,33                         | 113.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.95% 15-09-2027    | 115.343,39                 | 0,02                         |
| 1.200.000,00       | DZ HYP AG 0.01% 29-03-2030                        | 1.182.960,00               | 0,20                         | 184.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 1.3% 15-05-2028     | 228.827,00                 | 0,04                         |
| 2.200.000,00       | DZ HYP AG 0.875% 30-01-2029                       | 2.318.184,00               | 0,38                         | 84.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 1.45% 15-11-2024    | 87.310,94                  | 0,01                         |
| 42.000,00          | Estonia Government Internati 0.125% 10-06-2030    | 41.725,66                  | 0,01                         | 168.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 1.5% 30-04-2045     | 157.629,80                 | 0,03                         |
| 100.000,00         | Federation des Caisses Desja 0.01% 24-09-2025     | 100.232,40                 | 0,02                         | 246.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 1.65% 01-12-2030    | 258.646,27                 | 0,04                         |
| 44.000,00          | Finland Government Bond 0.125% 15-04-2052         | 39.467,47                  | 0,01                         | 58.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 2% 01-12-2025       | 61.933,56                  | 0,01                         |
| 17.000,00          | Finland Government Bond 0.25% 15-09-2040          | 16.588,16                  | 0,00                         | 74.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 2.15% 01-03-2072    | 70.752,97                  | 0,01                         |
| 109.000,00         | Finland Government Bond 1.125% 15-04-2034         | 121.283,21                 | 0,02                         | 13.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 2.45% 01-10-2023    | 13.606,61                  | 0,00                         |
| 4.000,00           | Finland Government Bond 1.375% 15-04-2047         | 4.951,26                   | 0,00                         | 67.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 2.8% 01-03-2067     | 75.676,50                  | 0,01                         |
| 31.000,00          | Finland Government Bond 2.75% 04-07-2028          | 37.097,08                  | 0,01                         | 238.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 3.35% 01-03-2035    | 292.808,07                 | 0,05                         |
| 110.318,00         | French Republic Government B 0.000000% 25-11-2029 | 110.412,87                 | 0,02                         | 18.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 3.5% 01-03-2030     | 21.720,60                  | 0,00                         |
| 284.153,00         | French Republic Government B 0.000000% 25-11-2030 | 281.504,24                 | 0,05                         | 65.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 4% 01-02-2037       | 86.577,29                  | 0,01                         |
| 131.176,00         | French Republic Government B 0.000000% 25-11-2031 | 128.683,63                 | 0,02                         | 167.000,00         | Italy Certificati di Credito FRN 15-04-2026      | 167.939,23                 | 0,03                         |
| 117.513,00         | French Republic Government B 0.1% 25-07-2031      | 144.143,15                 | 0,02                         | 102.294,92         | Kingdom of Belgium Governmen 0.1% 22-06-2030     | 103.021,26                 | 0,02                         |
| 142.076,00         | French Republic Government B 0.5% 25-05-2026      | 147.407,26                 | 0,02                         | 332.452,16         | Kingdom of Belgium Governmen 0.4% 22-06-2040     | 316.117,72                 | 0,05                         |
| 101.626,00         | French Republic Government B 0.5% 25-05-2040      | 99.278,44                  | 0,02                         | 40.951,40          | Kingdom of Belgium Governmen 0.65% 22-06-2071    | 33.552,87                  | 0,01                         |
| 112.286,00         | French Republic Government B 0.5% 25-05-2072      | 86.875,45                  | 0,01                         | 79.258,42          | Kingdom of Belgium Governmen 0.8% 22-06-2028     | 84.514,68                  | 0,01                         |
| 59.003,00          | French Republic Government B 0.5% 25-06-2044      | 56.339,37                  | 0,01                         | 1.100.000,00       | Kommunekredit 0.000000% 03-03-2031               | 1.072.181,00               | 0,18                         |
| 90.000,00          | French Republic Government B 0.75% 25-05-2052     | 86.055,75                  | 0,01                         | 900.000,00         | Kookmin Bank 0.052% 15-07-2025                   | 900.306,00                 | 0,15                         |
| 110.819,00         | French Republic Government B 0.75% 25-11-2028     | 117.580,42                 | 0,02                         | 500.000,00         | Korea Housing Finance Corp 0.01% 05-02-2025      | 500.137,00                 | 0,08                         |
| 50.145,00          | French Republic Government B 1% 25-05-2027        | 53.633,09                  | 0,01                         | 4.300.000,00       | La Banque Postale Home Loan 0.01% 22-10-2029     | 4.243.489,40               | 0,70                         |
| 137.370,00         | French Republic Government B 1.5% 25-05-2031      | 155.019,57                 | 0,03                         | 3.000.000,00       | La Banque Postale Home Loan 0.625% 23-06-2027    | 3.097.098,00               | 0,51                         |
| 1.003,00           | French Republic Government B 1.5% 25-05-2050      | 1.163,36                   | 0,00                         | 1.900.000,00       | La Banque Postale Home Loan 1% 04-10-2028        | 2.012.704,20               | 0,33                         |
| 50.145,00          | French Republic Government B 1.75% 25-06-2039     | 60.560,02                  | 0,01                         | 60.000,00          | Land Thueringen 0.25% 05-03-2040                 | 56.595,18                  | 0,01                         |
| 160.413,00         | French Republic Government B 2% 25-05-2048        | 206.275,72                 | 0,03                         | 2.200.000,00       | Landesbank Hessen-Thueringen 0.5% 25-09-2025     | 2.250.547,20               | 0,37                         |
| 193.229,00         | French Republic Government B 5.75% 25-10-2032     | 308.633,86                 | 0,05                         | 1.000.000,00       | Leeds Building Society 0.5% 03-07-2024           | 1.016.148,00               | 0,17                         |
| 200.000,00         | HSBC Bank Canada 0.01% 14-09-2026                 | 199.624,00                 | 0,03                         | 1.100.000,00       | LHV Pank AS 0.1% 09-06-2025                      | 1.103.333,00               | 0,18                         |
| 400.000,00         | HYPO NOE Landesbank fuer Nie 0.01% 08-09-2028     | 396.360,00                 | 0,07                         | 27.000,00          | Lithuania Government Interna 0.25% 06-05-2025    | 27.225,45                  | 0,00                         |
| 700.000,00         | Hypo Vorarlberg Bank AG 0.375% 17-05-2024         | 710.600,80                 | 0,12                         | 200.000,00         | Lloyds Bank PLC 0.125% 23-09-2029                | 198.084,00                 | 0,03                         |
| 1.000.000,00       | ING Belgium SA 0.01% 20-02-2030                   | 984.894,00                 | 0,16                         | 700.000,00         | MMB SCF SACA 0.01% 14-10-2030                    | 683.013,80                 | 0,11                         |
| 900.000,00         | ING-DiBa AG 0.01% 07-10-2028                      | 896.396,40                 | 0,15                         | 2.500.000,00       | MMB SCF SACA 0.75% 31-10-2025                    | 2.573.470,00               | 0,43                         |
| 50.980,31          | Ireland Government Bond 0.000000% 18-10-2031      | 49.711,31                  | 0,01                         | 183.863,00         | Netherlands Government Bond 0.000000% 15-01-2024 | 186.152,09                 | 0,03                         |
| 106.975,08         | IRELAND GOVERNMENT BOND 0.2% 18-10-2030           | 107.644,74                 | 0,02                         | 40.641,00          | Netherlands Government Bond 0.000000% 15-07-2031 | 40.795,25                  | 0,01                         |
| 48.099,83          | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.1% 15-05-2029           | 51.957,68                  | 0,01                         | 141.000,00         | Netherlands Government Bond 0.5% 15-01-2040      | 150.122,84                 | 0,02                         |
| 56.945,39          | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.3% 15-05-2033           | 62.833,54                  | 0,01                         | 203.925,00         | Netherlands Government Bond 0.75% 15-07-2028     | 218.016,05                 | 0,04                         |
| 20.182,83          | Ireland Government Bond 1.35% 18-03-2031          | 22.474,31                  | 0,00                         | 97.506,00          | Netherlands Government Bond 2.5% 15-01-2033      | 124.303,57                 | 0,02                         |
| 14.023,76          | Ireland Government Bond 1.5% 15-05-2050           | 16.134,34                  | 0,00                         | 16.715,00          | Netherlands Government Bond 2.75% 15-01-2047     | 27.187,01                  | 0,00                         |
| 30.586,36          | Ireland Government Bond 2% 18-02-2045             | 39.011,62                  | 0,01                         | 2.100.000,00       | OP Mortgage Bank 0.05% 25-03-2031                | 2.062.531,80               | 0,34                         |
| 598.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 01-08-2026 | 586.464,58                 | 0,10                         | 1.500.000,00       | PKO Bank Hipoteczny SA 0.125% 24-06-2022         | 1.501.437,00               | 0,25                         |
| 1.012.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 15-08-2024 | 1.010.552,84               | 0,17                         | 16.714,86          | Portugal Obrigacoes do Tesou 1% 12-04-2052       | 15.154,37                  | 0,00                         |
| 330.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.25% 15-03-2028     | 321.791,78                 | 0,05                         |                    |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Balanced Income Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 200.000,00         | Prima Banka Slovensko AS 0.01%<br>01-10-2026         | 199.018,40                 | 0,03                         | 2.100.000,00       | Westpac Securities NZ Ltd/Lo<br>0.5% 17-01-2024   | 2.133.310,20               | 0,35                         |
| 200.000,00         | Prima Banka Slovensko AS 0.01%<br>14-09-2027         | 198.385,70                 | 0,03                         | 200.000,00         | Yorkshire Building Society 0.01%<br>13-10-2027    | 198.400,40                 | 0,03                         |
| 110.000,00         | Republic of Austria Governme<br>0.000000% 20-02-2031 | 109.197,52                 | 0,02                         |                    |   | <b>241.941.652,90</b>      | <b>40,12</b>                 |
| 94.000,00          | Republic of Austria Governme<br>0.25% 20-10-2036     | 91.674,63                  | 0,02                         |                    | <b>GBP</b>  |                            |                              |
| 98.000,00          | Republic of Austria Governme<br>0.75% 20-02-2028     | 103.841,78                 | 0,02                         | 347.458,00         | United Kingdom Gilt 0.125%<br>31-01-2028          | 397.428,18                 | 0,07                         |
| 22.000,00          | Republic of Austria Governme<br>0.75% 20-03-2051     | 22.619,04                  | 0,00                         | 2.003.600,00       | United Kingdom Gilt 1.25% 22-<br>07-2027          | 2.448.544,71               | 0,41                         |
| 19.000,00          | Republic of Austria Governme<br>0.85% 30-06-2120     | 16.517,73                  | 0,00                         | 428.939,00         | United Kingdom Gilt 4.75% 07-<br>12-2030          | 678.711,39                 | 0,11                         |
| 46.000,00          | Republic of Austria Governme<br>2.4% 23-05-2034      | 58.312,73                  | 0,01                         |                    |   | <b>3.524.684,28</b>        | <b>0,58</b>                  |
| 53.000,00          | Republic of Poland Governmen<br>0.000000% 10-02-2025 | 52.947,42                  | 0,01                         |                    | <b>JPY</b>  |                            |                              |
| 9.000,00           | Romanian Government Internat<br>1.375% 02-12-2029    | 8.582,94                   | 0,00                         | 9.550.000,00       | Japan Government Ten Year Bo<br>0.1% 20-06-2026   | 73.824,33                  | 0,01                         |
| 15.000,00          | Romanian Government Internat<br>2.124% 16-07-2031    | 14.296,80                  | 0,00                         | 23.000.000,00      | Japan Government Ten Year Bo<br>0.1% 20-06-2027   | 178.019,04                 | 0,03                         |
| 300.000,00         | Royal Bank of Canada 0.01%<br>05-10-2028             | 296.881,20                 | 0,05                         | 14.300.000,00      | Japan Government Ten Year Bo<br>0.1% 20-06-2028   | 110.787,77                 | 0,02                         |
| 1.200.000,00       | Royal Bank of Canada 0.625%<br>10-09-2025            | 1.230.420,00               | 0,20                         | 28.300.000,00      | Japan Government Ten Year Bo<br>0.1% 20-06-2029   | 219.435,78                 | 0,04                         |
| 500.000,00         | Santander UK PLC 0.05% 12-<br>01-2027                | 499.464,00                 | 0,08                         | 124.650.000,00     | Japan Government Ten Year Bo<br>0.1% 20-12-2026   | 964.499,04                 | 0,16                         |
| 1.100.000,00       | Societe Generale SFH SA 0.01%<br>05-02-2031          | 1.076.433,60               | 0,18                         | 122.700.000,00     | Japan Government Ten Year Bo<br>0.4% 20-09-2025   | 958.123,30                 | 0,16                         |
| 900.000,00         | Societe Generale SFH SA 0.25%<br>23-01-2024          | 910.386,00                 | 0,15                         | 16.700.000,00      | Japan Government Ten Year Bo<br>0.5% 20-12-2024   | 130.206,23                 | 0,02                         |
| 3.000,00           | Spain Government Bond<br>0.000000% 31-01-2025        | 3.036,01                   | 0,00                         |                    |   | <b>2.634.895,49</b>        | <b>0,44</b>                  |
| 856.000,00         | Spain Government Bond<br>0.000000% 31-01-2028        | 849.408,80                 | 0,14                         |                    | <b>SEK</b>  |                            |                              |
| 291.000,00         | Spain Government Bond 0.5%<br>31-10-2031             | 289.190,85                 | 0,05                         | 6.060.000,00       | Sweden Government Bond 0.125%<br>12-05-2031       | 585.376,84                 | 0,10                         |
| 9.000,00           | Spain Government Bond 1%<br>30-07-2042               | 8.762,81                   | 0,00                         | 10.045.000,00      | Sweden Government Bond 0.75%<br>12-05-2028        | 1.019.336,10               | 0,17                         |
| 144.000,00         | Spain Government Bond 1%<br>31-10-2050               | 130.705,92                 | 0,02                         | 2.400.000,00       | Sweden Government Bond 1%<br>12-11-2026           | 244.961,05                 | 0,04                         |
| 38.000,00          | Spain Government Bond 1.2%<br>31-10-2040             | 38.380,00                  | 0,01                         | 20.000,00          | Sweden Government Bond 1.5%<br>13-11-2023         | 2.012,88                   | 0,00                         |
| 82.000,00          | Spain Government Bond 1.45%<br>31-10-2071            | 71.227,00                  | 0,01                         | 14.300.000,00      | Sweden Government Bond 2.5%<br>12-05-2025         | 1.515.508,20               | 0,25                         |
| 158.000,00         | Spain Government Bond 1.5%<br>30-04-2027             | 171.146,23                 | 0,03                         |                    |   | <b>3.367.195,07</b>        | <b>0,56</b>                  |
| 74.000,00          | Spain Government Bond 1.6%<br>30-04-2025             | 78.817,70                  | 0,01                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 210.000,00         | Spain Government Bond 2.35%<br>30-07-2033            | 249.231,36                 | 0,04                         | 54.731.000,00      | United States Treasury Infla<br>15-07-2029        | 58.476.430,88              | 9,70                         |
| 10.000,00          | Spain Government Bond 5.15%<br>31-10-2044            | 18.002,40                  | 0,00                         | 16.020.000,00      | United States Treasury Infla<br>0.875% 15-01-2029 | 17.915.695,47              | 2,97                         |
| 600.000,00         | SpareBank 1 Boligkredit AS<br>0.01% 22-09-2027       | 598.298,40                 | 0,10                         | 150.200,00         | United States Treasury Note/<br>0.375% 30-09-2027 | 125.554,13                 | 0,02                         |
| 500.000,00         | Sparebanken Vest Boligkredit<br>0.01% 11-11-2026     | 499.936,00                 | 0,08                         | 5.740.000,00       | United States Treasury Note/ 0.5%<br>28-02-2026   | 4.924.834,76               | 0,82                         |
| 1.000.000,00       | Sparebanken Vest Boligkredit<br>0.01% 28-06-2027     | 997.194,00                 | 0,17                         | 13.104.000,00      | United States Treasury Note/<br>0.625% 15-05-2030 | 10.812.803,01              | 1,79                         |
| 400.000,00         | SR-Boligkredit AS 0.01% 08-<br>09-2028               | 396.600,00                 | 0,07                         | 916.200,00         | United States Treasury Note/<br>0.625% 15-08-2030 | 754.014,39                 | 0,13                         |
| 1.700.000,00       | SR-Boligkredit AS 0.01% 10-<br>03-2031               | 1.656.439,20               | 0,27                         | 180.100,00         | United States Treasury Note/<br>0.625% 30-11-2027 | 152.305,72                 | 0,03                         |
| 49.000,00          | State of North Rhine-Westpha<br>0.2% 27-01-2051      | 43.669,78                  | 0,01                         | 14.730.000,00      | United States Treasury Note/<br>0.75% 31-01-2028  | 12.527.376,35              | 2,08                         |
| 41.000,00          | State of North Rhine-Westpha<br>0.95% 10-01-2121     | 32.572,45                  | 0,01                         | 13.370.000,00      | United States Treasury Note/<br>0.75% 31-05-2026  | 11.568.092,54              | 1,92                         |
| 1.000.000,00       | Sumitomo Mitsui Trust Bank L<br>0.01% 15-10-2027     | 983.568,00                 | 0,16                         | 825.800,00         | United States Treasury Note/<br>0.875% 15-11-2030 | 692.974,08                 | 0,11                         |
| 200.000,00         | UniCredit Bank AG 0.01% 21-<br>05-2029               | 198.166,00                 | 0,03                         | 1.520.600,00       | United States Treasury Note/<br>1.125% 15-02-2031 | 1.302.239,88               | 0,22                         |
| 500.000,00         | UniCredit Bank AG 0.01% 28-<br>09-2026               | 501.252,00                 | 0,08                         | 1.640.800,00       | United States Treasury Note/<br>1.25% 15-08-2031  | 1.416.043,79               | 0,23                         |
| 1.800.000,00       | Volksbank Wien AG 0.125%<br>19-11-2029               | 1.787.169,60               | 0,30                         | 1.110.700,00       | United States Treasury Note/<br>1.375% 15-11-2031 | 967.750,02                 | 0,16                         |
| 1.000.000,00       | Vseobecna Uverova Banka AS<br>0.01% 23-06-2025       | 1.000.346,00               | 0,17                         | 1.153.800,00       | United States Treasury Note/<br>1.625% 15-08-2029 | 1.033.435,83               | 0,17                         |
| 200.000,00         | Vseobecna Uverova Banka AS<br>0.01% 24-03-2026       | 199.585,60                 | 0,03                         | 4.923.400,00       | United States Treasury Note/ 2%<br>15-08-2025     | 4.483.823,34               | 0,74                         |
| 700.000,00         | Westpac Banking Corp 0.01%<br>22-09-2028             | 691.012,00                 | 0,11                         | 25.752.000,00      | United States Treasury Note/ 2%<br>31-05-2024     | 23.365.743,74              | 3,87                         |
| 1.500.000,00       | Westpac Banking Corp 0.5%<br>17-05-2024              | 1.525.212,00               | 0,25                         | 13.950.000,00      | United States Treasury Note/<br>2.125% 15-05-2025 | 12.750.686,01              | 2,11                         |
|                    |  |                            |                              | 1.060.800,00       | United States Treasury Note/<br>2.25% 15-02-2027  | 981.344,19                 | 0,16                         |
|                    |  |                            |                              | 1.050.000,00       | United States Treasury Note/ 2.5%<br>15-05-2024   | 963.241,63                 | 0,16                         |
|                    |  |                            |                              | 841.300,00         | United States Treasury Note/<br>2.625% 15-02-2029 | 803.179,59                 | 0,13                         |
|                    |  |                            |                              | 8.415.500,00       | United States Treasury Note/<br>2.625% 31-01-2026 | 7.858.882,87               | 1,30                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Balanced Income Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 5.055.000,00       | United States Treasury Note/<br>2.625% 31-12-2025   | 4.719.258,03               | 0,78                         |
| 3.510.000,00       | United States Treasury Note/<br>2.875% 15-05-2028   | 3.376.983,39               | 0,56                         |
| 243.400,00         | United States Treasury Note/<br>2.875% 30-09-2023   | 223.154,28                 | 0,04                         |
| 390.000,00         | United States Treasury Note/<br>2.875% 30-11-2025   | 367.109,90                 | 0,06                         |
| 1.030.000,00       | United States Treasury Note/<br>2.875% 31-05-2025   | 964.360,40                 | 0,16                         |
| 4.973.200,00       | United States Treasury Note/ 3%<br>31-10-2025   | 4.697.432,52               | 0,78                         |
| 130.000,00         | United States Treasury Note/<br>3.125% 15-11-2028   | 127.584,16                 | 0,02                         |
|                    |   | <b>188.352.334,90</b>      | <b>31,23</b>                 |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>548.923.105,82</b>      | <b>91,01</b>                 |
|                    | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>548.923.105,82</b>      | <b>91,01</b>                 |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 47.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 0.95%<br>01-08-2030  | 46.837,94                  | 0,01                         |
| 27.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 1.45%<br>01-03-2036  | 27.021,60                  | 0,00                         |
| 49.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 1.85%<br>01-07-2025  | 51.811,91                  | 0,01                         |
|                    |   | <b>125.671,45</b>          | <b>0,02</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>125.671,45</b>          | <b>0,02</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>125.671,45</b>          | <b>0,02</b>                  |
|                    | <b>Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren<br/>(OGAW)</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 43.298,92          | Nordea 2 - Emerging Mkt Local<br>Debt Enh Fd Y-EUR  | 3.698.160,67               | 0,61                         |
|                    |   | <b>3.698.160,67</b>        | <b>0,61</b>                  |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 99.040,00          | ISHARES JPM USD EM BND<br>UCITS ETF   | 9.510.952,91               | 1,58                         |
|                    |   | <b>9.510.952,91</b>        | <b>1,58</b>                  |
|                    | <b>Summe Organismen für<br/>gemeinsame Anlagen in<br/>Wertpapieren (OGAW)</b>   | <b>13.209.113,58</b>       | <b>2,19</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>562.257.890,85</b>      | <b>93,23</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>26.182.026,06</b>       | <b>4,34</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>14.678.551,66</b>       | <b>2,43</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>603.118.468,57</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Balanced Income Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   | Sektor               |
|------------------------|----------------------|
| USA                    | Staatsanleihen       |
| Deutschland            | Hypothekenanleihen   |
| Dänemark               | Unternehmensanleihen |
| Frankreich             | Offene Anleihefonds  |
| Irland                 |                      |
| Kanada                 |                      |
| Norwegen               |                      |
| Vereinigtes Königreich |                      |
| Australien             |                      |
| Italien                |                      |
| Singapur               |                      |
| Niederlande            |                      |
| Luxemburg              |                      |
| Österreich             |                      |
| Japan                  |                      |
| Schweden               |                      |
| Belgien                |                      |
| Finnland               |                      |
| Neuseeland             |                      |
| Spanien                |                      |
| Polen                  |                      |
| Slowakei               |                      |
| Republik Korea         |                      |
| Estland                |                      |
| <b>Summe</b>           | <b>Summe</b>         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - Balanced Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|--|-------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                    |                   |                      |  |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |  |             |
| 98.431,59   | EUR                | 992.151,98        | NOK                  | (838,45)   | 28.01.2022  |
| 3.100.541,47                                      | EUR                | 31.748.549,96     | SEK                  | 4.720,90   | 28.01.2022  |
| 156.381.446,48                                    | NOK                | 15.494.598,10     | EUR                  | 152.200,04   | 28.01.2022  |
| 3.016.257.451,61                                  | SEK                | 297.755.760,00    | EUR                  | (3.640.286,14)   | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(3.484.203,65)</b>  |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |  |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |  |             |
| 147.114,59  | EUR                | 19.103.000,00     | JPY                  | 654,38   | 14.01.2022  |
| 17.313.950,76                                     | EUR                | 20.129.000,00     | USD                  | (452.856,74)   | 14.01.2022  |
| 35.962.000,00                                     | JPY                | 273.674,88        | EUR                  | 2.041,91   | 14.01.2022  |
| 77.893.000,00                                     | JPY                | 6.216.001,61      | NOK                  | (25.072,77)  | 14.01.2022  |
| 653.129.848,00                                    | JPY                | 5.890.000,00      | USD                  | (191.340,76)   | 14.01.2022  |
| 1.247.474,89                                      | SEK                | 15.910.000,00     | JPY                  | (316,44)   | 14.01.2022  |
| 13.256.973,94                                     | USD                | 11.434.776,76     | EUR                  | 266.447,30   | 14.01.2022  |
| 6.043.550,18                                      | USD                | 4.496.000,00      | GBP                  | (16.106,71)  | 14.01.2022  |
| 984.373,86  | EUR                | 1.113.000,00      | USD                  | 2.928,84   | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(413.620,99)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |  |             |
| 539.000,00  | AUD                | 43.372.112,00     | JPY                  | 12.281,32  | 14.01.2022  |
| 417.964,84  | CAD                | 291.000,00        | EUR                  | (850,90)   | 14.01.2022  |
| 69.573.675,16                                     | CZK                | 2.731.000,00      | EUR                  | 61.766,90  | 14.01.2022  |
| 1.281.706,97                                      | EUR                | 166.739.000,00    | JPY                  | 3.340,24   | 14.01.2022  |
| 36.161.212,13                                     | EUR                | 41.541.000,00     | USD                  | (504.729,17)   | 14.01.2022  |
| 11.827.000,00                                     | GBP                | 14.600.096,80     | CHF                  | (61.343,23)  | 14.01.2022  |
| 495.000,00  | GBP                | 75.802.387,00     | JPY                  | 7.900,99   | 14.01.2022  |
| 172.015.000,00                                    | JPY                | 1.316.377,06      | EUR                  | 2.441,58   | 14.01.2022  |
| 124.575.000,00                                    | JPY                | 9.968.254,81      | SEK                  | (17.086,55)  | 14.01.2022  |
| 729.013.650,00                                    | JPY                | 6.532.000,00      | USD                  | (176.200,90)   | 14.01.2022  |
| 673.960,94  | NOK                | 107.000,00        | AUD                  | (981,95)   | 14.01.2022  |
| 14.846.896,02                                     | NOK                | 184.357.000,00    | JPY                  | 72.847,55  | 14.01.2022  |
| 3.915.917,50                                      | NOK                | 637.000,00        | NZD                  | 8.196,40   | 14.01.2022  |
| 2.084.931,18                                      | NZD                | 1.992.000,00      | AUD                  | (18.075,07)  | 14.01.2022  |
| 1.512.000,00                                      | NZD                | 1.360.809,07      | CAD                  | (33.643,51)  | 14.01.2022  |
| 27.098.193,97                                     | SEK                | 3.912.000,00      | CAD                  | (72.880,08)  | 14.01.2022  |
| 1.662.908,36                                      | SEK                | 162.000,00        | EUR                  | 180,10   | 14.01.2022  |
| 7.314.415,45                                      | SEK                | 91.560.000,00     | JPY                  | 11.383,54  | 14.01.2022  |
| 66.316.262,58                                     | USD                | 57.716.407,73     | EUR                  | 817.289,34   | 14.01.2022  |
| 12.993.000,00                                     | USD                | 1.455.499.534,00  | JPY                  | 309.103,21   | 14.01.2022  |
| 4.129.000,00                                      | AUD                | 2.950.627,17      | USD                  | 37.197,41  | 01.02.2022  |
| 1.730.975,76                                      | CAD                | 1.879.000,00      | AUD                  | (479,52)   | 01.02.2022  |
| 10.786.502,51                                     | CAD                | 7.429.000,00      | EUR                  | 56.145,64  | 01.02.2022  |
| 406.000,00  | CAD                | 2.790.433,01      | SEK                  | 9.657,45   | 01.02.2022  |
| 5.829.000,00                                      | EUR                | 6.080.436,83      | CHF                  | (58.755,64)  | 01.02.2022  |
| 662.000,00  | EUR                | 750.830,27        | USD                  | (475,71)   | 01.02.2022  |
| 107.754.432,00                                    | JPY                | 1.337.000,00      | NZD                  | 20.841,92  | 01.02.2022  |
| 53.321.775,01                                     | SEK                | 5.891.000,00      | USD                  | 1.446,78   | 01.02.2022  |
| 13.027.000,00                                     | USD                | 1.483.638.368,00  | JPY                  | 121.793,08   | 01.02.2022  |
| 1.173.000,00                                      | USD                | 89.139.789,00     | INR                  | (15.479,93)  | 22.02.2022  |
| 3.487.236,11                                      | EUR                | 35.740.842,87     | SEK                  | 3.468,81   | 28.02.2022  |
| 1.938.000,00                                      | SEK                | 188.572,19        | EUR                  | 331,05   | 28.02.2022  |
| 5.225.141,14                                      | EUR                | 8.333.000,00      | AUD                  | (101.252,39)   | 02.03.2022  |
| 22.371,40   | EUR                | 32.000,00         | CAD                  | 180,49   | 02.03.2022  |
| 564.773,50  | EUR                | 480.000,00        | GBP                  | (5.785,08)   | 02.03.2022  |
| 2.163.598,52                                      | EUR                | 2.454.000,00      | USD                  | (349,94)   | 02.03.2022  |
| 177.000,00  | GBP                | 209.694,41        | EUR                  | 697,45   | 02.03.2022  |
| 3.887.000,00                                      | USD                | 3.426.049,14      | EUR                  | 1.526,37   | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>491.648,05</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |  |             |
| 21.708.016,55                                     | AUD                | 13.838.000,00     | EUR                  | 48.975,91  | 14.01.2022  |
| 140.000,00  | CAD                | 104.084,82        | CHF                  | (3.588,76)   | 14.01.2022  |
| 1.003.643,37                                      | CAD                | 586.000,00        | GBP                  | (635,13)   | 14.01.2022  |
| 1.468.000,00                                      | CAD                | 129.949.780,00    | JPY                  | 22.775,73  | 14.01.2022  |
| 2.784.000,00                                      | CAD                | 19.717.212,29     | NOK                  | (41.192,33)  | 14.01.2022  |
| 1.112.000,00                                      | CAD                | 7.844.938,71      | SEK                  | 6.846,34   | 14.01.2022  |
| 35.973.783,36                                     | EUR                | 53.971.287,30     | CAD                  | (1.493.224,50)   | 14.01.2022  |
| 4.959.699,86                                      | EUR                | 4.257.763,46      | GBP                  | (107.209,10)   | 14.01.2022  |
| 4.162.792,32                                      | EUR                | 541.478.000,00    | JPY                  | 11.349,47  | 14.01.2022  |
| 22.983.023,75                                     | EUR                | 26.395.000,00     | USD                  | (314.380,07)   | 14.01.2022  |
| 137.000,00  | GBP                | 250.395,59        | AUD                  | 2.853,28   | 14.01.2022  |
| 53.853.633,00                                     | JPY                | 591.000,00        | CAD                  | 2.620,36   | 14.01.2022  |
| 13.565.617.001,00                                 | JPY                | 104.331.492,07    | EUR                  | (325.644,03)   | 14.01.2022  |
| 53.698.532,00                                     | MXN                | 2.235.395,77      | EUR                  | 77.858,98  | 14.01.2022  |
| 351.096,00  | NZD                | 331.000,00        | AUD                  | (198,45)   | 14.01.2022  |
| 323.000,00  | NZD                | 26.156.475,00     | JPY                  | (5.921,28)   | 14.01.2022  |
| 6.570.358,81                                      | SEK                | 755.000,00        | USD                  | (25.607,26)  | 14.01.2022  |
| 66.213,05   | USD                | 90.000,00         | AUD                  | 868,18   | 14.01.2022  |
| 220.000,00  | USD                | 274.035,93        | CAD                  | 3.947,64   | 14.01.2022  |
| 13.522.700,00                                     | USD                | 11.837.455,55     | EUR                  | 98.266,31  | 14.01.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Balanced Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                                | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|--|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| 6.269.000,00                                     | USD                | 712.318.385,00    | JPY                  | 72.040,03   | 14.01.2022  |
| 262.488,53                                       | USD                | 385.000,00        | NZD                  | (292,71)  | 14.01.2022  |
| 37.318.109,00                                    | ZAR                | 2.192.603,35      | EUR                  | (131.538,42)  | 14.01.2022  |
| 1.036.217,99                                     | CAD                | 605.000,00        | GBP                  | (617,86)  | 01.02.2022  |
| 1.148.000,00                                     | CAD                | 8.099.064,23      | SEK                  | 6.928,65  | 01.02.2022  |
| 315.000,00                                       | EUR                | 492.902,87        | AUD                  | (222,10)  | 01.02.2022  |
| 30.795.435,93                                    | EUR                | 44.341.116,38     | CAD                  | 25.676,74   | 01.02.2022  |
| 21.460.663,29                                    | EUR                | 18.173.104,28     | GBP                  | (157.421,11)  | 01.02.2022  |
| 28.465.313,68                                    | EUR                | 278.597.141,28    | NOK                  | 594.723,32  | 01.02.2022  |
| 801.000,00                                       | GBP                | 1.573.647,00      | NZD                  | 5.210,29  | 01.02.2022  |
| 1.736.000,00                                     | GBP                | 2.307.535,29      | USD                  | 29.099,34   | 01.02.2022  |
| 5.401.348.460,00                                 | JPY                | 40.709.283,62     | EUR                  | 693.272,40  | 01.02.2022  |
| 15.278.047,79                                    | NOK                | 189.471.000,00    | JPY                  | 76.141,58   | 01.02.2022  |
| 56.993.142,48                                    | NOK                | 6.330.000,00      | USD                  | 116.569,73  | 01.02.2022  |
| 9.710.000,00                                     | NZD                | 59.794.364,49     | SEK                  | 16.912,96   | 01.02.2022  |
| 2.456.000,00                                     | USD                | 20.854.247,21     | NOK                  | 80.769,80   | 01.02.2022  |
| 269.227,66                                       | USD                | 395.000,00        | NZD                  | (318,15)  | 01.02.2022  |
| 11.825.923,89                                    | BRL                | 2.043.000,00      | USD                  | 46.977,05   | 22.02.2022  |
| 205.992.399,50                                   | INR                | 2.739.588,51      | USD                  | 10.250,92   | 22.02.2022  |
| 386.366.943,90                                   | RUB                | 5.103.346,21      | USD                  | (9.037,10)  | 22.02.2022  |
| 2.989.000,00                                     | DKK                | 401.864,63        | EUR                  | 98,49   | 28.02.2022  |
| 8.012.512,36                                     | MXN                | 324.663,84        | EUR                  | 17.393,77   | 01.03.2022  |
| 4.663.000,00                                     | AUD                | 2.938.032,32      | EUR                  | 42.507,71   | 02.03.2022  |
| 575.000,00                                       | CAD                | 396.138,58        | EUR                  | 2.610,97  | 02.03.2022  |
| 2.903.994,03                                     | EUR                | 4.600.000,00      | AUD                  | (36.270,69)   | 02.03.2022  |
| 2.779.838,12                                     | EUR                | 4.047.000,00      | CAD                  | (26.674,69)   | 02.03.2022  |
| 147.283,78                                       | EUR                | 125.000,00        | GBP                  | (1.298,94)  | 02.03.2022  |
| 6.320.285,18                                     | EUR                | 7.167.000,00      | USD                  | 393,31  | 02.03.2022  |
| 71.000,00  | GBP                | 83.113,66         | EUR                  | 1.281,93  | 02.03.2022  |
| 5.282.000,00                                     | USD                | 4.652.499,49      | EUR                  | 5.197,34  | 02.03.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(560.874,15)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                    |                   |                      |   |             |
| 198.000,00                                       | AUD                | 144.231,71        | USD                  | (641,32)  | 14.01.2022  |
| 1.110.281,64                                     | CAD                | 864.000,00        | USD                  | 8.152,33  | 14.01.2022  |
| 58.897.619,31                                    | CZK                | 2.332.000,00      | EUR                  | 32.212,66   | 14.01.2022  |
| 48.330.731,83                                    | EUR                | 77.439.268,33     | AUD                  | (1.208.709,31)  | 14.01.2022  |
| 27.006,14  | EUR                | 3.484.000,00      | JPY                  | 294,81  | 14.01.2022  |
| 12.345.035,81                                    | EUR                | 14.516.848,65     | USD                  | (468.257,74)  | 14.01.2022  |
| 2.877.000,00                                     | GBP                | 34.576.525,39     | SEK                  | 51.562,03   | 14.01.2022  |
| 28.310.000,00                                    | JPY                | 217.703,30        | EUR                  | (654,14)  | 14.01.2022  |
| 232.412.101,00                                   | JPY                | 1.538.000,00      | GBP                  | (48.408,81)   | 14.01.2022  |
| 19.881.000,00                                    | JPY                | 1.558.578,85      | SEK                  | 420,31  | 14.01.2022  |
| 51.119.032,00                                    | JPY                | 445.000,00        | USD                  | (852,31)  | 14.01.2022  |
| 64.556.083,19                                    | NOK                | 6.337.000,00      | EUR                  | 125.518,84  | 14.01.2022  |
| 14.777.603,96                                    | USD                | 13.039.115,09     | EUR                  | 4.212,96  | 14.01.2022  |
| 2.867.000,00                                     | CAD                | 20.297.970,09     | NOK                  | (41.132,59)   | 01.02.2022  |
| 2.732.000,00                                     | GBP                | 419.010.938,00    | JPY                  | 38.117,62   | 01.02.2022  |
| 135.032.384,00                                   | JPY                | 1.765.000,00      | NZD                  | (27.833,26)   | 01.02.2022  |
| 14.895.162,48                                    | NOK                | 2.090.000,00      | CAD                  | 39.819,46   | 01.02.2022  |
| 3.973.252,61                                     | NOK                | 389.000,00        | EUR                  | 8.490,37  | 01.02.2022  |
| 15.997.928,23                                    | SEK                | 1.765.000,00      | USD                  | 2.600,75  | 01.02.2022  |
| 27.895.676,36                                    | TRY                | 1.598.000,00      | USD                  | 339.154,42  | 22.02.2022  |
| 1.173.000,00                                     | USD                | 89.168.527,50     | INR                  | (15.818,74)   | 22.02.2022  |
| 15.624,57  | EUR                | 161.000,00        | SEK                  | (68,68)   | 28.02.2022  |
| 1.929.520,20                                     | EUR                | 35.271.976,50     | ZAR                  | (4.194,77)  | 01.03.2022  |
| 17.000,00  | AUD                | 10.721,08         | EUR                  | 145,13  | 02.03.2022  |
| 732.839,49                                       | EUR                | 1.155.000,00      | AUD                  | (5.418,46)  | 02.03.2022  |
| 619.000,00                                       | USD                | 548.265,04        | EUR                  | (2.430,85)  | 02.03.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(1.173.719,29)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 2.798.068,19                                     | AUD                | 1.485.000,00      | GBP                  | 22.774,70   | 14.01.2022  |
| 5.073.000,00                                     | AUD                | 404.636.684,00    | JPY                  | 143.015,30  | 14.01.2022  |
| 5.125.000,00                                     | CHF                | 635.397.295,00    | JPY                  | 90.548,98   | 14.01.2022  |
| 504.000,00                                       | CHF                | 4.718.160,62      | NOK                  | 15.659,45   | 14.01.2022  |
| 5.852.253,64                                     | CHF                | 6.331.000,00      | USD                  | 78.184,87   | 14.01.2022  |
| 2.793,04   | EUR                | 3.032,00          | CHF                  | (142,59)  | 14.01.2022  |
| 2.917.192,32                                     | EUR                | 381.036.040,00    | JPY                  | (4.165,59)  | 14.01.2022  |
| 31.202.653,42                                    | EUR                | 321.072.824,82    | NOK                  | (939.079,56)  | 14.01.2022  |
| 35.878.128,83                                    | EUR                | 59.850.373,95     | NZD                  | (183.852,83)  | 14.01.2022  |
| 16.089.552,28                                    | EUR                | 164.134.922,45    | SEK                  | 81.830,02   | 14.01.2022  |
| 199.680.113,96                                   | EUR                | 236.849.824,20    | USD                  | (9.375.781,14)  | 14.01.2022  |
| 778.000,00                                       | GBP                | 1.528.109,48      | NZD                  | 5.108,26  | 14.01.2022  |
| 45.506.319,00                                    | JPY                | 573.000,00        | AUD                  | (17.670,34)   | 14.01.2022  |
| 142.920.000,00                                   | JPY                | 1.105.340,86      | EUR                  | (9.593,11)  | 14.01.2022  |
| 138.608.736,00                                   | JPY                | 904.000,00        | GBP                  | (13.097,44)   | 14.01.2022  |
| 97.995.582,00                                    | JPY                | 1.215.000,00      | NZD                  | 19.245,30   | 14.01.2022  |
| 45.776.216,19                                    | MXN                | 2.198.000,00      | USD                  | 31.917,98   | 14.01.2022  |
| 4.134.406,87                                     | NOK                | 661.000,00        | AUD                  | (8.973,31)  | 14.01.2022  |
| 1.217.919,46                                     | NZD                | 749.000,00        | EUR                  | (15.165,00)   | 14.01.2022  |
| 197.000,00                                       | NZD                | 140.930,73        | USD                  | (5.693,42)  | 14.01.2022  |
| 5.491.692,84                                     | SEK                | 866.000,00        | AUD                  | (18.405,12)   | 14.01.2022  |
| 309.009.244,48                                   | SEK                | 30.291.057,62     | EUR                  | (154.057,60)  | 14.01.2022  |
| 12.402.235,12                                    | SEK                | 1.027.000,00      | GBP                  | (12.603,11)   | 14.01.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Balanced Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                              | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|--|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| 7.483.763,95                                   | SEK                | 95.602.000,00     | JPY                  | (3.093,49)  | 14.01.2022  |
| 8.521.630,24                                   | SEK                | 1.389.000,00      | NZD                  | (5.825,19)  | 14.01.2022  |
| 4.297.027,48                                   | SEK                | 492.000,00        | USD                  | (15.183,23)   | 14.01.2022  |
| 270.513,55                                     | USD                | 365.000,00        | AUD                  | 5.271,53  | 14.01.2022  |
| 87.268.687,81                                  | USD                | 74.033.187,07     | EUR                  | 2.994.548,85  | 14.01.2022  |
| 6.009.673,75                                   | USD                | 4.383.000,00      | GBP                  | 88.493,17   | 14.01.2022  |
| 22.039.000,00                                  | USD                | 2.409.431.522,00  | JPY                  | 979.970,23  | 14.01.2022  |
| 251.000,00                                     | USD                | 5.369.413,84      | MXN                  | (9.764,03)  | 14.01.2022  |
| 5.229.000,00                                   | AUD                | 416.353.373,00    | JPY                  | 152.736,54  | 01.02.2022  |
| 671.256,71                                     | CHF                | 916.000,00        | CAD                  | 14.347,24   | 01.02.2022  |
| 11.856.934,41                                  | CHF                | 11.172.401,38     | EUR                  | 308.916,56  | 01.02.2022  |
| 5.455.085,76                                   | CHF                | 6.002.000,00      | USD                  | (13.525,44)   | 01.02.2022  |
| 36.509.326,02                                  | EUR                | 56.566.819,55     | AUD                  | 333.826,94  | 01.02.2022  |
| 556.000,00                                     | EUR                | 72.569.665,00     | JPY                  | (257,54)  | 01.02.2022  |
| 31.941.276,89                                  | EUR                | 52.098.673,30     | NZD                  | 568.458,06  | 01.02.2022  |
| 10.611.166,29                                  | EUR                | 12.386.394,30     | USD                  | (317.831,64)  | 01.02.2022  |
| 47.170.175,00                                  | JPY                | 594.000,00        | AUD                  | (18.320,06)   | 01.02.2022  |
| 5.401.348.461,00                               | JPY                | 40.743.676,59     | EUR                  | 658.859,17  | 01.02.2022  |
| 7.366.453,87                                   | NOK                | 92.457.000,00     | JPY                  | 28.262,08   | 01.02.2022  |
| 4.062.499,61                                   | NOK                | 659.000,00        | NZD                  | 9.577,95  | 01.02.2022  |
| 4.983.170,99                                   | SEK                | 786.000,00        | AUD                  | (16.782,58)   | 01.02.2022  |
| 4.065.146,06                                   | SEK                | 336.000,00        | GBP                  | (3.316,15)  | 01.02.2022  |
| 45.870.585,67                                  | SEK                | 574.188.000,00    | JPY                  | 71.481,53   | 01.02.2022  |
| 19.170.252,53                                  | USD                | 16.415.375,04     | EUR                  | 499.289,49  | 01.02.2022  |
| 354.000,00                                     | USD                | 26.464.365,95     | RUB                  | 4.541,92  | 22.02.2022  |
| 164.783,57                                     | EUR                | 1.698.000,00      | SEK                  | (726,57)  | 28.02.2022  |
| 180.000,00                                     | SEK                | 17.424,60         | EUR                  | 120,69  | 28.02.2022  |
| 10.407.582,84                                  | TRY                | 657.224,03        | EUR                  | (9.021,69)  | 01.03.2022  |
| 771.000,00                                     | USD                | 679.279,53        | EUR                  | 606,15  | 01.03.2022  |
| 3.048.000,00                                   | AUD                | 1.930.861,39      | EUR                  | 17.376,08   | 02.03.2022  |
| 55.000,00                                      | CAD                | 38.337,51         | EUR                  | (196,75)  | 02.03.2022  |
| 704.903,91                                     | EUR                | 1.125.000,00      | AUD                  | (14.188,56)   | 02.03.2022  |
| 57.063,58                                      | EUR                | 83.000,00         | CAD                  | (495,19)  | 02.03.2022  |
| 5.015.944,58                                   | EUR                | 4.273.873,00      | GBP                  | (64.267,36)   | 02.03.2022  |
| 1.153.000,00                                   | GBP                | 1.353.940,06      | EUR                  | 16.592,17   | 02.03.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(4.009.514,42)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: HSBC Continental Europe SA</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 480.604,54                                     | CHF                | 647.000,00        | CAD                  | 16.182,32   | 14.01.2022  |
| 182.849,66                                     | EUR                | 212.000,00        | USD                  | (4.271,45)  | 14.01.2022  |
| 23.538.608,00                                  | JPY                | 151.000,00        | GBP                  | 772,77  | 14.01.2022  |
| 318.500,00                                     | USD                | 275.683,34        | EUR                  | 5.439,37  | 14.01.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>18.123,01</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>               |                    |                   |                      |   |             |
| 844.000,00                                     | AUD                | 5.346.945,85      | NOK                  | 4.657,12  | 14.01.2022  |
| 4.010.000,00                                   | AUD                | 2.866.014,37      | USD                  | 35.606,57   | 14.01.2022  |
| 1.680.050,55                                   | CAD                | 1.823.000,00      | AUD                  | 81,48   | 14.01.2022  |
| 901.911,91                                     | CAD                | 627.000,00        | EUR                  | (897,03)  | 14.01.2022  |
| 196.698,15                                     | CAD                | 158.000,00        | USD                  | (2.911,13)  | 14.01.2022  |
| 5.147.536,53                                   | CHF                | 5.662.000,00      | USD                  | (13.660,56)   | 14.01.2022  |
| 608.000,00                                     | EUR                | 916.383,32        | CAD                  | (28.156,40)   | 14.01.2022  |
| 3.179.410,35                                   | EUR                | 409.575.000,00    | JPY                  | 39.258,85   | 14.01.2022  |
| 14.868.187,49                                  | EUR                | 17.004.362,54     | USD                  | (140.605,16)  | 14.01.2022  |
| 2.021.000,00                                   | GBP                | 23.360.699,79     | NOK                  | 66.515,89   | 14.01.2022  |
| 78.938.424,00                                  | JPY                | 933.000,00        | AUD                  | 8.358,48  | 14.01.2022  |
| 333.744.172,00                                 | JPY                | 3.679.000,00      | CAD                  | 4.831,85  | 14.01.2022  |
| 521.663.544,00                                 | JPY                | 4.024.591,62      | EUR                  | (25.067,24)   | 14.01.2022  |
| 133.070.000,00                                 | JPY                | 10.094.992,14     | NOK                  | 9.659,12  | 14.01.2022  |
| 51.075.000,00                                  | JPY                | 3.863.407,34      | SEK                  | 14.799,38   | 14.01.2022  |
| 22.048.786,00                                  | JPY                | 192.000,00        | USD                  | (421,93)  | 14.01.2022  |
| 14.453.959,50                                  | NOK                | 2.026.000,00      | CAD                  | 40.506,29   | 14.01.2022  |
| 3.391.696,66                                   | NOK                | 332.000,00        | EUR                  | 7.532,98  | 14.01.2022  |
| 15.496.958,23                                  | NOK                | 1.714.000,00      | USD                  | 38.509,28   | 14.01.2022  |
| 9.435.000,00                                   | NZD                | 57.898.236,03     | SEK                  | 38.229,33   | 14.01.2022  |
| 3.503.000,00                                   | NZD                | 2.458.791,43      | USD                  | (59.567,22)   | 14.01.2022  |
| 15.099.214,00                                  | TRY                | 1.409.510,68      | EUR                  | (428.834,10)  | 14.01.2022  |
| 8.378.000,00                                   | USD                | 7.359.714,59      | EUR                  | 35.065,12   | 14.01.2022  |
| 1.830.000,00                                   | USD                | 15.647.477,40     | SEK                  | 89.190,40   | 14.01.2022  |
| 1.190.000,00                                   | CAD                | 104.243.322,00    | JPY                  | 26.755,57   | 01.02.2022  |
| 682.263,74                                     | CAD                | 527.000,00        | USD                  | 8.465,81  | 01.02.2022  |
| 149.000,00                                     | CHF                | 1.431.083,11      | NOK                  | 1.112,21  | 01.02.2022  |
| 1.073.000,00                                   | EUR                | 11.013.496,58     | SEK                  | (887,18)  | 01.02.2022  |
| 2.964.000,00                                   | GBP                | 35.590.642,29     | SEK                  | 55.571,32   | 01.02.2022  |
| 101.100.769,00                                 | JPY                | 777.000,00        | EUR                  | (2.048,62)  | 01.02.2022  |
| 65.126.000,00                                  | JPY                | 4.924.829,36      | NOK                  | 6.523,03  | 01.02.2022  |
| 6.779.547,46                                   | NOK                | 562.000,00        | GBP                  | 9.701,13  | 01.02.2022  |
| 336.000,00                                     | NZD                | 2.041.404,32      | NOK                  | (1.888,91)  | 01.02.2022  |
| 5.176.270,04                                   | SEK                | 814.000,00        | AUD                  | (15.860,24)   | 01.02.2022  |
| 207.000,00                                     | USD                | 265.805,55        | CAD                  | (1.811,34)  | 01.02.2022  |
| 6.553.000,00                                   | USD                | 6.034.122,32      | CHF                  | (61.042,39)   | 01.02.2022  |
| 14.549.483,00                                  | BRL                | 2.554.862,66      | USD                  | 21.294,63   | 22.02.2022  |
| 413.213.790,90                                 | INR                | 5.445.677,93      | USD                  | 64.561,06   | 22.02.2022  |
| 145.168,53                                     | EUR                | 1.494.000,00      | SEK                  | (456,81)  | 28.02.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Balanced Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                       | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| 968.982,00                              | SEK                | 94.561,50         | EUR                  | (111,92)  | 28.02.2022  |
| 2.731.000,00                            | EUR                | 3.092.729,42      | USD                  | 3.766,38  | 01.03.2022  |
| 2.757.000,00                            | CAD                | 1.897.679,91      | EUR                  | 14.239,52   | 02.03.2022  |
| 2.076.874,24                            | EUR                | 3.016.000,00      | CAD                  | (14.655,01)   | 02.03.2022  |
| 2.812.765,39                            | EUR                | 2.399.000,00      | GBP                  | (38.849,94)   | 02.03.2022  |
| 2.452.000,00                            | GBP                | 2.875.026,18      | EUR                  | 39.588,43   | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(153.351,90)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 17.176.343,03                           | EUR                | 171.031.051,64    | SEK                  | 500.011,40  | 01.02.2022  |
| 353.914.608,16                          | SEK                | 35.543.011,95     | EUR                  | (1.034.673,73)  | 01.02.2022  |
| 2.794.292,58                            | SEK                | 308.000,00        | USD                  | 706,15  | 01.02.2022  |
| 101.850.105,00                          | EUR                | 757.500.989,42    | DKK                  | (19.229,51)   | 28.02.2022  |
| 2.741.605,74                            | EUR                | 28.181.000,00     | SEK                  | (5.289,72)  | 28.02.2022  |
| 29.538.000,00                           | SEK                | 2.873.414,24      | EUR                  | 5.752,74  | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(552.722,67)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 474.894,20                              | CAD                | 376.000,00        | USD                  | (2.204,36)  | 14.01.2022  |
| 108.000,00                              | CHF                | 1.058.453,20      | NOK                  | (1.392,56)  | 14.01.2022  |
| 5.392.000,00                            | EUR                | 5.626.973,12      | CHF                  | (56.065,51)   | 14.01.2022  |
| 10.619.041,61                           | EUR                | 12.015.000,00     | USD                  | 14.107,22   | 14.01.2022  |
| 50.013.089,90                           | SEK                | 5.535.000,00      | USD                  | (7.748,51)  | 14.01.2022  |
| 6.085.000,00                            | USD                | 5.600.488,57      | CHF                  | (51.548,22)   | 14.01.2022  |
| 1.129.000,00                            | USD                | 998.837,67        | EUR                  | (2.335,99)  | 14.01.2022  |
| 629.000,00                              | EUR                | 6.429.822,11      | NOK                  | (14.249,70)   | 01.02.2022  |
| 1.347.000,00                            | EUR                | 13.361.903,25     | SEK                  | 44.154,61   | 01.02.2022  |
| 167.000,00                              | EUR                | 188.847,11        | USD                  | 375,92  | 01.02.2022  |
| 1.326.000,00                            | GBP                | 1.620.726,84      | CHF                  | 8.001,93  | 01.02.2022  |
| 29.772,10                               | EUR                | 305.000,00        | SEK                  | 42,84   | 28.02.2022  |
| 894.000,00                              | SEK                | 86.997,59         | EUR                  | 143,52  | 28.02.2022  |
| 74.467,73                               | EUR                | 63.000,00         | GBP                  | (417,70)  | 02.03.2022  |
| 1.793.000,00                            | USD                | 1.585.707,72      | EUR                  | (4.637,61)  | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(73.774,12)</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(6.427.806,48)</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(9.912.010,13)</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

## Credit Default Swaps

| Basiswert                                     | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal         | Wahrung | Kosten (EUR)        | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)     | Falligkeit |
|---|--------------|-----------------|-----------------|----------|---------------------|--|---------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b> |              |                 |                 |          |                     |  |                     |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (6.456.000,00)  | USD      | 535.199,59          | (8.470,56)   | 526.729,03          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (8.444.000,00)  | USD      | 700.297,54          | (11.372,52)  | 688.925,02          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (9.933.000,00)  | USD      | 822.937,50          | (12.528,67)  | 810.408,83          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (7.946.000,00)  | USD      | 641.956,91          | 6.337,52   | 648.294,43          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (7.950.000,00)  | USD      | 645.154,75          | 3.466,02   | 648.620,77          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (11.090.000,00) | USD      | 896.471,20          | 8.334,39   | 904.805,59          | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (1.158.000,00)  | USD      | 98.346,29           | (3.867,94)   | 94.478,35           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (974.000,00)    | USD      | 77.631,12           | 1.835,12   | 79.466,24           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (1.090.000,00)  | USD      | 76.089,07           | 12.841,32  | 88.930,39           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (598.000,00)    | USD      | 45.859,22           | 2.930,11   | 48.789,33           | 20.12.2026  |
| Chile Government Internation 3.24% 06-02-2028 | Verkauf      | 1,00%           | (1.780.000,00)  | USD      | 17.280,62           | 4.589,74   | 21.870,36           | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (6.460.000,00)  | EUR      | 787.511,75          | (17.458,36)  | 770.053,39          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (7.112.000,00)  | EUR      | 865.070,98          | (17.297,03)  | 847.773,95          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (1.715.000,00)  | EUR      | 209.076,15          | (4.642,47)   | 204.433,68          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (1.386.000,00)  | EUR      | 163.101,76          | 2.114,03   | 165.215,79          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (1.782.000,00)  | EUR      | 211.735,61          | 684,69   | 212.420,30          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (1.433.000,00)  | EUR      | 138.999,83          | 31.818,52  | 170.818,35          | 20.12.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (1.411.000,00)  | EUR      | 141.687,39          | 26.508,48  | 168.195,87          | 20.12.2026  |
| Russian Foreign Bond - Eurob MULTI 31-03-2030 | Verkauf      | 1,00%           | (2.620.000,00)  | USD      | 18.127,86           | (45.098,57)  | (26.970,71)         | 20.12.2026  |
|   |              |                 |                 |          | <b>7.092.535,14</b> | <b>(19.276,18)</b>                                   | <b>7.073.258,96</b> |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Balanced Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert  | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal         | Währung | Kosten (EUR)         | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)      | Fälligkeit |
|--|--------------|-----------------|-----------------|---------|----------------------|---|----------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |              |                 |                 |         |                      |   |                      |            |
| Brazilian Government Interna 4.25% 07-01-2025    | Verkauf      | 1,00%           | (960.000,00)    | USD     | (38.342,25)          | (2.542,98)  | (40.885,23)          | 2012.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (8.936.000,00)  | USD     | 715.721,57           | 13.344,51   | 729.066,08           | 2012.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (1.019.000,00)  | USD     | 82.640,61            | 497,08  | 83.137,69            | 2012.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (891.000,00)    | USD     | 72.023,21            | 671,27  | 72.694,48            | 2012.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (1.089.000,00)  | USD     | 76.394,11            | 12.454,70   | 88.848,81            | 2012.2026  |
| Colombia Government Internat 10.375% 28-01-2033  | Verkauf      | 1,00%           | (1.970.000,00)  | USD     | (41.633,21)          | (41.950,54)   | (83.583,75)          | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.412.000,00)  | EUR     | 141.135,16           | 27.179,92   | 168.315,08           | 2012.2026  |
| Peruvian Government Internat 8.75% 21-11-2033    | Verkauf      | 1,00%           | (1.670.000,00)  | USD     | 4.318,02             | 12.523,88   | 16.841,90            | 2012.2026  |
|  |              |                 |                 |         | <b>1.012.257,22</b>  | <b>22.177,84</b>                                    | <b>1.034.435,06</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>    |              |                 |                 |         |                      |   |                      |            |
| ITRAXX-EUROPES36V1-5Y                            | Verkauf      | 1,00%           | (56.536.000,00) | EUR     | 1.459.545,50         | 11.650,10   | 1.471.195,60         | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (5.904.000,00)  | EUR     | 719.050,43           | (15.274,08)   | 703.776,35           | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.411.000,00)  | EUR     | 142.374,65           | 25.821,22   | 168.195,87           | 2012.2026  |
| Republic of South Africa Gov 5.875% 16-09-2025   | Verkauf      | 1,00%           | (930.000,00)    | USD     | (39.198,13)          | 38,79   | (39.159,34)          | 2012.2026  |
|  |              |                 |                 |         | <b>2.281.772,45</b>  | <b>22.236,03</b>                                    | <b>2.304.008,48</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |              |                 |                 |         |                      |   |                      |            |
| CDX-EMS36V1-5Y                                   | Verkauf      | 1,00%           | (4.500.000,00)  | USD     | (184.735,59)         | 23.518,49   | (161.217,10)         | 2012.2026  |
| CDX-NAIGS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 1,00%           | (97.320.000,00) | USD     | 1.997.514,25         | 97.629,86   | 2.095.144,11         | 2012.2026  |
| Philippine Government Intern 10.625% 16-03-2025  | Verkauf      | 1,00%           | (1.620.000,00)  | USD     | 35.290,61            | (5.436,64)  | 29.853,97            | 2012.2026  |
|  |              |                 |                 |         | <b>1.848.069,27</b>  | <b>115.711,71</b>                                   | <b>1.963.780,98</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |              |                 |                 |         |                      |   |                      |            |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (4.722.000,00)  | EUR     | 560.637,83           | 2.240,21  | 562.878,04           | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (9.445.000,00)  | EUR     | 1.125.290,39         | 584,88  | 1.125.875,27         | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (6.493.000,00)  | EUR     | 772.945,52           | 1.041,58  | 773.987,10           | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (5.903.000,00)  | EUR     | 705.923,10           | (2.265,95)  | 703.657,15           | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (2.918.000,00)  | EUR     | 332.291,07           | 15.544,19   | 347.835,26           | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.565.000,00)  | EUR     | 186.893,87           | (340,69)  | 186.553,18           | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (2.620.000,00)  | EUR     | 306.523,38           | 5.789,30  | 312.312,68           | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.412.000,00)  | EUR     | 141.477,45           | 26.837,63   | 168.315,08           | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.329.000,00)  | EUR     | 145.604,37           | 12.816,83   | 158.421,20           | 2012.2026  |
|  |              |                 |                 |         | <b>4.277.586,98</b>  | <b>62.247,98</b>                                    | <b>4.339.834,96</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |              |                 |                 |         |                      |   |                      |            |
| CDX-EMS36V1-5Y                                   | Verkauf      | 1,00%           | (23.720.000,00) | USD     | (685.379,43)         | (164.413,81)  | (849.793,24)         | 2012.2026  |
| China Government Internation 7.5% 28-10-2027     | Verkauf      | 1,00%           | (3.450.000,00)  | USD     | 85.939,48            | 1.561,23  | 87.500,71            | 2012.2026  |
| Indonesia Government Interna 4.125% 15-01-2025   | Verkauf      | 1,00%           | (3.610.000,00)  | USD     | 29.483,92            | 8.362,81  | 37.846,73            | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (6.493.000,00)  | EUR     | 782.323,11           | (8.336,01)  | 773.987,10           | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (6.495.000,00)  | EUR     | 791.653,46           | (17.427,95)   | 774.225,51           | 2012.2026  |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (14.790.000,00) | EUR     | 1.723.859,63         | 39.157,34   | 1.763.016,97         | 2012.2026  |
| Malaysia (No ref obligation)                     | Verkauf      | 1,00%           | (2.310.000,00)  | USD     | 51.350,59            | 2.108,35  | 53.458,94            | 2012.2026  |
| Mexico Government Internatio 4.15% 28-03-2027    | Verkauf      | 1,00%           | (3.660.000,00)  | USD     | 7.883,47             | 5.939,15  | 13.822,62            | 2012.2026  |
| Turkey Government Internatio 11.875% 15-01-2030  | Verkauf      | 1,00%           | (220.000,00)    | USD     | (25.240,85)          | (11.790,07)   | (37.030,92)          | 2012.2026  |
|  |              |                 |                 |         | <b>2.761.873,38</b>  | <b>(144.838,96)</b>                                 | <b>2.617.034,42</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |              |                 |                 |         |                      |   |                      |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (1.391.000,00)  | USD     | 107.373,13           | 6.115,11  | 113.488,24           | 2012.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (1.122.000,00)  | USD     | 79.264,73            | 12.276,47   | 91.541,20            | 2012.2026  |
|  |              |                 |                 |         | <b>186.637,86</b>    | <b>18.391,58</b>                                    | <b>205.029,44</b>    |            |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>     |              |                 |                 |         |                      |   |                      |            |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (2.330.000,00)  | EUR     | 283.846,29           | (6.102,57)  | 277.743,72           | 2012.2026  |
| Saudi Government Internation 4% 17-04-2025       | Verkauf      | 1,00%           | (2.050.000,00)  | USD     | 40.297,29            | 2.609,08  | 42.906,37            | 2012.2026  |
|  |              |                 |                 |         | <b>324.143,58</b>    | <b>(3.493,49)</b>                                   | <b>320.650,09</b>    |            |
|  |              |                 |                 |         | <b>19.784.875,88</b> | <b>73.156,51</b>                                    | <b>19.858.032,39</b> |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Balanced Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in<br>der Basiswährung des Teilfonds<br>(EUR) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                      |                             |   |  |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022 | AUD     | 743,00                               | 73.018.325,00               | (238.610,67)  | 238.249,36   |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | (189,00)                             | (26.885.250,00)             | 15.748,82   | (524.553,34)   |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | 254,00                               | 36.131.500,00               | (21.165,08)   | 686.045,86   |
| EURO STOXX 50 3/2022                   | 18.03.2022 | EUR     | 300,00                               | 12.840.000,00               | (22.500,00)   | 207.766,46   |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (632,00)                             | (84.226.640,00)             | (18.960,00)   | 635.471,58   |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | 2,00                                 | 266.540,00                  | 60,00   | (2.024,80)   |
| Euro-BTP Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (9,00)                               | (1.322.640,00)              | 450,00  | 22.004,87  |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (1.045,00)                           | (179.081.650,00)            | 0,00  | 3.200.109,22   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | 884,00                               | 151.491.080,00              | 0,00  | (2.703.113,96)   |
| EURO-BUXL 30Y BND 3/2022               | 10.03.2022 | EUR     | (9,00)                               | (1.860.660,00)              | 0,00  | 94.040,67  |
| Euro-OAT Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (1,00)                               | (163.210,00)                | (60,00)   | 2.880,00   |
| EURO-SCHATZ FUT 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | 15,00                                | 1.680.450,00                | 0,00  | (1.434,14)   |
| EURO-SCHATZ FUT 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (1.007,00)                           | (112.814.210,00)            | 0,00  | 162.267,49   |
| FTSE 100 IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022 | GBP     | 54,00                                | 3.961.710,00                | (7.713,75)  | 82.737,72  |
| JPN 10Y BOND(OSE) 3/2022               | 22.03.2022 | JPY     | (21,00)                              | (3.185.280.000,00)          | (14.493,01)   | 67.787,38  |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022 | GBP     | (120,00)                             | (14.991.600,00)             | (21.427,10)   | (1.261,15)   |
| NIKKEI 225 MINI 3/2022                 | 11.03.2022 | JPY     | 339,00                               | 977.676.000,00              | 15.597,24   | 50.906,13  |
| S&P500 EMINI FUT 3/2022                | 18.03.2022 | USD     | 381,00                               | 90.811.350,00               | (88.299,57)   | 1.041.009,68   |
| Short Euro-BTP Fu 3/2022               | 10.03.2022 | EUR     | 5,00                                 | 564.600,00                  | 50,00   | (1.933,16)   |
| SPI 200 FUTURES 3/2022                 | 17.03.2022 | AUD     | 30,00                                | 5.511.750,00                | (41.271,69)   | 80.922,34  |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 2.448,00                             | 319.234.500,00              | 0,00  | 2.486.748,25   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (1.878,00)                           | (244.902.937,50)            | 0,00  | (2.085.491,63)   |
| US 2YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (252,00)                             | (54.983.250,00)             | (13.905,44)   | 80.896,76  |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (457,00)                             | (55.279.149,58)             | (22.066,24)   | (76.764,56)  |
|  |            |         |                                      |                             | <b>(478.566,48)</b>   | <b>3.743.267,03</b>  |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 6.860.000,00 EUR gezahlt.

BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 1.020.000,00 EUR gezahlt.

BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 2.270.000,00 EUR gezahlt.

Citibank Europe PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 1.910.000,00 EUR gezahlt.

Deutsche Bank AG hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 4.390.000,00 EUR gezahlt.

Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 2.600.000,00 EUR gezahlt.

Morgan Stanley Europe SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 350.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Chinese Bond Fund (vormals Nordea 1 - Renminbi Bond Fund)

Aufgliederung der Wertpapieranlagen  
nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021  
(in % des Nettovermögens)

| Land                     |              | Sektor               |              |
|--------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| China                    | 95,26        | Unternehmensanleihen | 55,48        |
| Hongkong                 | 1,72         | Staatsanleihen       | 42,66        |
| Britische Jungferninseln | 1,15         |                      |              |
| <b>Summe</b>             | <b>98,14</b> | <b>Summe</b>         | <b>98,14</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Chinese Bond Fund (vormals Nordea 1 - Renminbi Bond Fund)

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (CNH) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|---|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |   |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |   |            |
| 10.151.189,61                                     | EUR               | 73.424.957,11      | CNH                | (140.080,65)  | 28.01.2022 |
| 51.128,59   | NOK               | 36.662,20          | CNH                | 269,03  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(139.811,62)</b>   |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.



# Nordea 1 - Chinese Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| <b>HKD</b>  |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 955.056,00  | Alibaba Group Holding   | 14.559.975,31              | 5,29                         |                    |              |                            |                              |
| 1.589.000,00  | Alphamab Oncology   | 2.770.848,32               | 1,01                         |                    |              |                            |                              |
| 52.191,00   | Bilibili  | 2.399.693,91               | 0,87                         |                    |              |                            |                              |
| 5.078.000,00  | Bosideng International Holdings   | 3.196.863,81               | 1,16                         |                    |              |                            |                              |
| 185.000,00  | BYD   | 6.323.853,79               | 2,30                         |                    |              |                            |                              |
| 6.643.000,00  | Cathay Media And Education Group  | 1.703.508,07               | 0,62                         |                    |              |                            |                              |
| 1.777.500,00  | Chaoyu Eye Care Holdings  | 1.456.332,07               | 0,53                         |                    |              |                            |                              |
| 1.193.600,00  | China International Capital   | 3.290.388,79               | 1,20                         |                    |              |                            |                              |
| 1.438.000,00  | China Merchants Bank  | 11.164.081,04              | 4,06                         |                    |              |                            |                              |
| 2.998.000,00  | China Merchants Port Holdings   | 5.458.457,33               | 1,98                         |                    |              |                            |                              |
| 209.200,00  | ENN Energy Holdings   | 3.937.655,18               | 1,43                         |                    |              |                            |                              |
| 5.508.000,00  | Frontage Holdings   | 2.789.593,83               | 1,01                         |                    |              |                            |                              |
| 216.400,00  | Ganfeng Lithium   | 3.404.487,67               | 1,24                         |                    |              |                            |                              |
| 2.964.000,00  | Geely Automobile Holdings   | 8.094.830,31               | 2,94                         |                    |              |                            |                              |
| 1.477.800,00  | Haier Smart Home  | 6.243.398,10               | 2,27                         |                    |              |                            |                              |
| 103.594,00  | Hong Kong Exchanges & Clearing  | 6.048.916,30               | 2,20                         |                    |              |                            |                              |
| 948.000,00  | Hua Hong Semiconductor  | 5.226.689,97               | 1,90                         |                    |              |                            |                              |
| 459.400,00  | Hygeia Healthcare Holdings  | 2.874.489,72               | 1,04                         |                    |              |                            |                              |
| 1.742.000,00  | Jinxin Fertility Group  | 1.945.432,88               | 0,71                         |                    |              |                            |                              |
| 5.050.733,00  | KWG Living Group Holdings   | 2.072.308,15               | 0,75                         |                    |              |                            |                              |
| 550.800,00  | Meituan   | 15.918.340,49              | 5,79                         |                    |              |                            |                              |
| 1.662.000,00  | Mintn Group   | 7.319.943,14               | 2,66                         |                    |              |                            |                              |
| 172.000,00  | NetEase   | 3.473.433,21               | 1,26                         |                    |              |                            |                              |
| 3.250.000,00  | Nine Dragons Paper Holdings   | 3.487.857,76               | 1,27                         |                    |              |                            |                              |
| 1.046.500,00  | Ping An Insurance Group Co of China   | 7.534.231,15               | 2,74                         |                    |              |                            |                              |
| 5.178.000,00  | Postal Savings Bank of China  | 3.631.610,97               | 1,32                         |                    |              |                            |                              |
| 1.747.252,00  | Sunac Services Holdings   | 1.781.035,69               | 0,65                         |                    |              |                            |                              |
| 399.800,00  | Tencent Holdings  | 23.416.330,10              | 8,51                         |                    |              |                            |                              |
| 152.450,00  | Trip.com Group  | 3.729.544,09               | 1,36                         |                    |              |                            |                              |
| 410.000,00  | Tsingtao Brewery  | 3.837.573,12               | 1,39                         |                    |              |                            |                              |
| 438.500,00  | Wuxi Biologics Cayman   | 5.203.504,90               | 1,89                         |                    |              |                            |                              |
| 1.295.600,00  | Xinte Energy  | 2.398.767,08               | 0,87                         |                    |              |                            |                              |
| 6.684.000,00  | Xinyi Energy Holdings   | 3.659.436,90               | 1,33                         |                    |              |                            |                              |
| 722.000,00  | Zhongsheng Group Holdings   | 5.628.474,77               | 2,05                         |                    |              |                            |                              |
|   |   | <b>185.981.887,92</b>      | <b>67,59</b>                 |                    |              |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 546.814,00  | iClick Interactive Asia Group ADR   | 2.608.302,78               | 0,95                         |                    |              |                            |                              |
| 72.510,00   | I-Mab ADR   | 3.534.862,50               | 1,28                         |                    |              |                            |                              |
| 77.720,00   | Pinduoduo ADR   | 4.587.811,60               | 1,67                         |                    |              |                            |                              |
|   |   | <b>10.730.976,88</b>       | <b>3,90</b>                  |                    |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>196.712.864,80</b>      | <b>71,49</b>                 |                    |              |                            |                              |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>196.712.864,80</b>      | <b>71,49</b>                 |                    |              |                            |                              |
| <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                   |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| <b>CNY</b>  |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 139.273,00  | Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China  | 2.766.513,97               | 1,01                         |                    |              |                            |                              |
| 117.311,00  | China Tourism Group Duty Free   | 4.038.567,87               | 1,47                         |                    |              |                            |                              |
| 382.855,00  | Electric Connector Technology   | 3.153.739,79               | 1,15                         |                    |              |                            |                              |
| 742.638,00  | Hongfa Technology   | 8.697.231,49               | 3,16                         |                    |              |                            |                              |
| 563.100,00  | Jonjee Hi-Tech Industrial And Commercial Holding  | 3.354.736,05               | 1,22                         |                    |              |                            |                              |
| 672.409,00  | Luxshare Precision Industry   | 5.190.758,83               | 1,89                         |                    |              |                            |                              |
| 722.000,00  | NARI Technology   | 4.534.767,43               | 1,65                         |                    |              |                            |                              |
| 1.693.542,00  | Ningbo Joyson Electronic  | 5.837.921,62               | 2,12                         |                    |              |                            |                              |
| 115.533,00  | Proya Cosmetics   | 3.776.142,72               | 1,37                         |                    |              |                            |                              |
| 531.707,00  | Riyue Heavy Industry  | 2.748.906,88               | 1,00                         |                    |              |                            |                              |
| 841.100,00  | Sinoma Science & Technology   | 4.489.667,44               | 1,63                         |                    |              |                            |                              |
| 703.452,00  | Sunwoda Electronic  | 4.653.366,96               | 1,69                         |                    |              |                            |                              |
| 753.200,00  | Suzhou Dongshan Precision Manufacturing   | 3.202.667,36               | 1,16                         |                    |              |                            |                              |
| 160.168,00  | Thunder Software Technology   | 3.478.618,71               | 1,26                         |                    |              |                            |                              |
| 223.100,00  | Wingtech Technology   | 4.526.164,42               | 1,64                         |                    |              |                            |                              |
| 4.210.700,00  | XCMG Construction Machinery   | 3.957.431,02               | 1,44                         |                    |              |                            |                              |
|   |   | <b>68.407.202,56</b>       | <b>24,86</b>                 |                    |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Chinese Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                     |              | Sektor  |              |
|--------------------------|--------------|---|--------------|
| Kaimaninseln             | 45,43        | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 12,74        |
| China                    | 42,24        | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 8,51         |
| Hongkong                 | 6,08         | Verschiedene Banken                                 | 5,38         |
| Taiwan, Provinz Chinas   | 1,52         | Automobilhersteller                                 | 5,24         |
| Britische Jungferninseln | 1,33         | Elektrische Komponenten und Ausrüstung              | 4,85         |
| Bermuda                  | 1,27         | Autoteile und -zubehör                              | 4,78         |
|                          |              | Elektronische Komponenten                           | 4,20         |
| <b>Summe</b>             | <b>97,88</b> | Halbleiter  | 3,42         |
|                          |              | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen      | 2,90         |
|                          |              | Lebens- und Krankenversicherung                     | 2,74         |
|                          |              | Biotechnologie                                      | 2,29         |
|                          |              | Haushaltsgeräte                                     | 2,27         |
|                          |              | Börsen und Finanzdaten                              | 2,20         |
|                          |              | Interaktives Home Entertainment                     | 2,13         |
|                          |              | Kraftfahrzeugeinzelhandel                           | 2,05         |
|                          |              | Schifffahrt: Häfen und Dienstleistungen             | 1,98         |
|                          |              | Elektrische Anlagen                                 | 1,65         |
|                          |              | Dienste für die Herstellung elektronischer Geräte   | 1,64         |
|                          |              | Rohstoffchemikalien                                 | 1,63         |
|                          |              | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 1,57         |
|                          |              | Spezialgeschäfte                                    | 1,47         |
|                          |              | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 1,44         |
|                          |              | Gasversorger  | 1,43         |
|                          |              | Immobilien: REOC                                    | 1,40         |
|                          |              | Brauereien  | 1,39         |
|                          |              | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 1,37         |
|                          |              | Hotels, Ferienanlagen und Kreuzfahrtrlinien         | 1,36         |
|                          |              | Erneuerbare Elektrizität                            | 1,33         |
|                          |              | Papierprodukte                                      | 1,27         |
|                          |              | Anwendungssoftware                                  | 1,26         |
|                          |              | Verschiedene Metall- und Bergbaubetriebe            | 1,24         |
|                          |              | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 1,22         |
|                          |              | Investmentbanken und Broker                         | 1,20         |
|                          |              | Bekleidung, Accessoires und Luxusgüter              | 1,16         |
|                          |              | Halbleiter-Ausrüstung                               | 1,01         |
|                          |              | Industriemaschinen                                  | 1,00         |
|                          |              | Werbung   | 0,95         |
|                          |              | Bau- und Ingenieurwesen                             | 0,87         |
|                          |              | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  | 0,71         |
|                          |              | Filme und Entertainment                             | 0,62         |
|                          |              | <b>Summe</b>  | <b>97,88</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>AUD</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 108.000,00  | Australia Government Bond 2.5% 21-05-2030         | 73.831,55                  | 0,06                         | 141.026,00         | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-11-2027 | 144.528,07                 | 0,11                         |
| 237.000,00  | Australia Government Bond 4.75% 21-04-2027        | 177.772,59                 | 0,14                         | 79.236,34          | Bundesrepublik Deutschland B 0.25% 15-02-2027     | 82.127,04                  | 0,07                         |
|   |   | <b>251.604,14</b>          | <b>0,20</b>                  | 13.550,65          | Bundesrepublik Deutschland B 0.25% 15-08-2028     | 14.129,24                  | 0,01                         |
| <b>CAD</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 214.000,00  | Canadian Government Bond 1.5% 01-06-2026          | 150.248,55                 | 0,12                         | 15.952,48          | Bundesrepublik Deutschland B 0.5% 15-02-2028      | 16.854,91                  | 0,01                         |
| 71.000,00   | Canadian Government Bond 2.25% 01-06-2029         | 52.494,16                  | 0,04                         | 990.000,00         | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 10-03-2023      | 997.676,46                 | 0,79                         |
|   |   | <b>202.742,71</b>          | <b>0,16</b>                  | 7.650.000,00       | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 10-06-2022      | 7.674.250,50               | 6,09                         |
| <b>DKK</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 10.000.000,00   | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2022 SDO AR E       | 1.349.886,55               | 1,07                         | 5.880.000,00       | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 11-03-2022      | 5.887.644,00               | 4,68                         |
| 40.000.000,00   | Nykredit Realkredit 1% 01-01-2022 SDO A H         | 5.379.018,80               | 4,27                         | 17.550.000,00      | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 15-09-2023      | 17.746.042,45              | 14,09                        |
| 36.000.000,00   | Nykredit Realkredit 1% 04-01-2022 SDO AR H        | 4.859.591,59               | 3,86                         | 4.395.860,00       | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 15-12-2022      | 4.422.674,75               | 3,51                         |
| 5.900.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2022 SDO A H         | 799.587,41                 | 0,63                         | 990.000,00         | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 16-09-2022      | 994.858,92                 | 0,79                         |
| 9.500.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2026 SDO A H         | 1.329.814,75               | 1,06                         | 1.300.000,00       | Caisse Francaise de Financem 0.01% 18-03-2031     | 1.268.550,40               | 1,01                         |
| 42.600.000,00   | Realkredit Danmark 1% 04-01-2022 SDRO AR T        | 5.750.519,69               | 4,57                         | 300.000,00         | Caisse Francaise de Financem 0.01% 22-02-2028     | 298.584,60                 | 0,24                         |
| 9.400.000,00  | Realkredit Danmark 1% 04-01-2026 SDRO A T         | 1.315.096,54               | 1,04                         | 800.000,00         | Caisse Francaise de Financem 0.625% 13-04-2026    | 822.608,00                 | 0,65                         |
|   |   | <b>20.783.515,33</b>       | <b>16,50</b>                 | 500.000,00         | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 07-10-2026     | 501.131,82                 | 0,40                         |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 200.000,00  | Achmea Bank NV 0.01% 16-06-2025                   | 200.482,40                 | 0,16                         | 100.000,00         | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 30-04-2029     | 98.629,80                  | 0,08                         |
| 200.000,00  | Aegon Bank NV 0.01% 16-11-2025                    | 200.137,60                 | 0,16                         | 500.000,00         | Cie de Financement Foncier S 0.01% 25-09-2030     | 490.032,00                 | 0,39                         |
| 100.000,00  | Aegon Bank NV 0.375% 09-06-2036                   | 97.885,40                  | 0,08                         | 900.000,00         | Cie de Financement Foncier S 0.05% 16-04-2024     | 906.584,40                 | 0,72                         |
| 100.000,00  | Argenta Spaarbank NV 0.01% 11-02-2031             | 97.801,40                  | 0,08                         | 500.000,00         | Commerzbank AG 0.05% 09-05-2029                   | 496.980,00                 | 0,39                         |
| 300.000,00  | Arkea Public Sector SCF SA 0.125% 15-01-2030      | 298.038,60                 | 0,24                         | 100.000,00         | Commonwealth Bank of Austral 0.125% 15-10-2029    | 98.866,40                  | 0,08                         |
| 100.000,00  | ASB Finance Ltd/London 0.25% 21-05-2031           | 98.651,20                  | 0,08                         | 200.000,00         | Commonwealth Bank of Austral 0.375% 11-04-2024    | 202.763,60                 | 0,16                         |
| 300.000,00  | ASB Finance Ltd/London 0.625% 18-10-2024          | 306.116,40                 | 0,24                         | 100.000,00         | Coventry Building Society 0.01% 07-07-2028        | 98.652,60                  | 0,08                         |
| 500.000,00  | AXA Bank Europe SCF 0.375% 23-03-2023             | 505.035,00                 | 0,40                         | 200.000,00         | Coventry Building Society 0.5% 12-01-2024         | 202.990,00                 | 0,16                         |
| 400.000,00  | Bank of Montreal 0.1% 20-10-2023                  | 403.083,20                 | 0,32                         | 800.000,00         | Credit Agricole Home Loan SF 0.5% 19-02-2026      | 818.136,00                 | 0,65                         |
| 100.000,00  | Bausparkasse Schwabebisch Hal 0.01% 22-10-2030    | 98.220,00                  | 0,08                         | 800.000,00         | Credit Agricole Home Loan SF 0.75% 05-05-2027     | 830.622,40                 | 0,66                         |
| 100.000,00  | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.01% 03-09-2029     | 98.827,60                  | 0,08                         | 900.000,00         | Deutsche Apotheker-und Aerzt 0.01% 06-02-2029     | 892.314,00                 | 0,71                         |
| 315.000,00  | Bayerische Landesbank 0.75% 19-01-2028            | 328.315,05                 | 0,26                         | 300.000,00         | DNB Boligkredit AS 0.01% 21-01-2031               | 293.313,00                 | 0,23                         |
| 100.000,00  | BNP Paribas Fortis SA 0.875% 22-03-2028           | 104.847,20                 | 0,08                         | 500.000,00         | DZ HYP AG 0.01% 20-04-2029                        | 496.274,00                 | 0,39                         |
| 200.000,00  | BPCE SFH SA 0.01% 10-11-2027                      | 199.330,00                 | 0,16                         | 400.000,00         | Eika Boligkredit AS 0.375% 26-02-2025             | 406.326,40                 | 0,32                         |
| 1.100.000,00  | BPCE SFH SA 0.01% 29-01-2029                      | 1.090.042,80               | 0,87                         | 200.000,00         | Erste Group Bank AG 0.625% 19-01-2023             | 202.278,40                 | 0,16                         |
| 800.000,00  | BPCE SFH SA 0.75% 02-09-2025                      | 824.622,40                 | 0,65                         | 300.000,00         | Erste Group Bank AG 0.75% 05-02-2025              | 308.391,60                 | 0,24                         |
| 3.822.000,00  | Bundesobligation 0.000000% 07-10-2022             | 3.841.476,91               | 3,05                         | 5.000,00           | Estonia Government Internati 0.125% 10-06-2030    | 4.967,34                   | 0,00                         |
| 4.200.000,00  | Bundesobligation 0.000000% 08-04-2022             | 4.207.140,00               | 3,34                         | 100.000,00         | Federation des Caisses Desja 0.01% 24-09-2025     | 100.232,40                 | 0,08                         |
| 2.620.000,00  | Bundesobligation 0.000000% 10-04-2026             | 2.677.168,40               | 2,13                         | 6.000,00           | Finland Government Bond 0.125% 15-04-2052         | 5.381,93                   | 0,00                         |
| 4.908.934,00  | Bundesobligation 0.000000% 11-04-2025             | 5.004.275,32               | 3,97                         | 2.000,00           | Finland Government Bond 0.25% 15-09-2040          | 1.951,55                   | 0,00                         |
| 377.645,00  | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-02-2030 | 386.897,30                 | 0,31                         | 15.000,00          | Finland Government Bond 1.125% 15-04-2034         | 16.690,35                  | 0,01                         |
| 19.207,29   | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2026 | 19.652,71                  | 0,02                         | 1.000,00           | Finland Government Bond 1.375% 15-04-2047         | 1.237,81                   | 0,00                         |
| 2.644.080,00  | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2029 | 2.710.224,31               | 2,15                         | 4.000,00           | Finland Government Bond 2.75% 04-07-2028          | 4.786,72                   | 0,00                         |
| 2.256.906,00  | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2030 | 2.309.491,91               | 1,83                         | 14.906,00          | French Republic Government B 0.000000% 25-11-2029 | 14.918,82                  | 0,01                         |
| 15.842,85   | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2031 | 16.125,16                  | 0,01                         | 32.393,00          | French Republic Government B 0.000000% 25-11-2030 | 32.091,05                  | 0,03                         |
| 33.000,00   | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2050 | 31.587,07                  | 0,03                         | 52.488,00          | French Republic Government B 0.000000% 25-11-2031 | 51.490,72                  | 0,04                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 22.597,00          | French Republic Government B 0.1% 25-07-2031      | 27.717,81                  | 0,02                         | 2.000,00           | Italy Buoni Poliennali Del T 3.5% 01-03-2030      | 2.413,40                   | 0,00                         |
| 19.197,00          | French Republic Government B 0.5% 25-05-2026      | 19.917,35                  | 0,02                         | 9.000,00           | Italy Buoni Poliennali Del T 4% 01-02-2037        | 11.987,62                  | 0,01                         |
| 13.731,00          | French Republic Government B 0.5% 25-05-2040      | 13.413,81                  | 0,01                         | 23.000,00          | Italy Certificati di Credito FRN 15-04-2026       | 23.129,36                  | 0,02                         |
| 15.190,00          | French Republic Government B 0.5% 25-05-2072      | 11.752,47                  | 0,01                         | 300.000,00         | Jyske Realkredit A/S 0.01% 10-01-2027 A           | 298.680,00                 | 0,24                         |
| 7.972,00           | French Republic Government B 0.5% 25-06-2044      | 7.612,11                   | 0,01                         | 13.821,66          | Kingdom of Belgium Governmen 0.1% 22-06-2030      | 13.919,80                  | 0,01                         |
| 29.417,00          | French Republic Government B 0.75% 25-05-2052     | 28.127,80                  | 0,02                         | 46.812,59          | Kingdom of Belgium Governmen 0.4% 22-06-2040      | 44.512,54                  | 0,04                         |
| 14.973,00          | French Republic Government B 0.75% 25-11-2028     | 15.886,55                  | 0,01                         | 5.533,19           | Kingdom of Belgium Governmen 0.65% 22-06-2071     | 4.533,53                   | 0,00                         |
| 6.775,00           | French Republic Government B 1% 25-05-2027        | 7.246,27                   | 0,01                         | 10.709,07          | Kingdom of Belgium Governmen 0.8% 22-06-2028      | 11.419,27                  | 0,01                         |
| 6.775,00           | French Republic Government B 1.75% 25-06-2039     | 8.182,15                   | 0,01                         | 3.000,00           | Land Thuringen 0.25% 05-03-2040                   | 2.829,76                   | 0,00                         |
| 21.674,00          | French Republic Government B 2% 25-05-2048        | 27.870,68                  | 0,02                         | 200.000,00         | LHV Pank AS 0.1% 09-06-2025                       | 200.606,00                 | 0,16                         |
| 26.108,00          | French Republic Government B 5.75% 25-10-2032     | 41.700,85                  | 0,03                         | 4.000,00           | Lithuania Government Interna 0.25% 06-05-2025     | 4.033,40                   | 0,00                         |
| 200.000,00         | Hamburg Commercial Bank AG 0.375% 12-07-2023      | 202.244,22                 | 0,16                         | 300.000,00         | MMB SCF SACA 0.01% 14-10-2030                     | 292.720,20                 | 0,23                         |
| 100.000,00         | HSBC Bank Canada 0.01% 14-09-2026                 | 99.812,00                  | 0,08                         | 300.000,00         | Muenchener Hypothekbank eG 1.5% 25-06-2024        | 313.125,00                 | 0,25                         |
| 300.000,00         | Hypo Vorarlberg Bank AG 0.75% 11-02-2025          | 308.193,00                 | 0,24                         | 200.000,00         | National Bank of Canada 0.375% 15-01-2024         | 202.652,80                 | 0,16                         |
| 100.000,00         | ING Bank NV 0.75% 18-02-2029                      | 104.434,80                 | 0,08                         | 200.000,00         | Nationale-Niederlanden Bank N 0.125% 24-09-2029   | 198.653,20                 | 0,16                         |
| 300.000,00         | ING-DiBa AG 0.01% 07-10-2028                      | 298.798,80                 | 0,24                         | 24.843,00          | Netherlands Government Bond 0.000000% 15-01-2024  | 25.152,30                  | 0,02                         |
| 6.000,00           | Ireland Government Bond 0.000000% 18-10-2031      | 5.850,65                   | 0,00                         | 5.327,00           | Netherlands Government Bond 0.000000% 15-07-2031  | 5.347,22                   | 0,00                         |
| 14.454,02          | IRELAND GOVERNMENT BOND 0.2% 18-10-2030           | 14.544,50                  | 0,01                         | 19.051,00          | Netherlands Government Bond 0.5% 15-01-2040       | 20.283,62                  | 0,02                         |
| 6.499,04           | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.1% 15-05-2029           | 7.020,30                   | 0,01                         | 27.553,00          | Netherlands Government Bond 0.75% 15-07-2028      | 29.456,89                  | 0,02                         |
| 7.694,22           | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.3% 15-05-2033           | 8.489,80                   | 0,01                         | 13.175,00          | Netherlands Government Bond 2.5% 15-01-2033       | 16.795,89                  | 0,01                         |
| 2.727,02           | Ireland Government Bond 1.35% 18-03-2031          | 3.036,63                   | 0,00                         | 2.258,00           | Netherlands Government Bond 2.75% 15-01-2047      | 3.672,65                   | 0,00                         |
| 1.894,84           | Ireland Government Bond 1.5% 15-05-2050           | 2.180,01                   | 0,00                         | 100.000,00         | Oversea-Chinese Banking Corp 0.375% 01-03-2023    | 100.880,00                 | 0,08                         |
| 4.132,71           | Ireland Government Bond 2% 18-02-2045             | 5.271,10                   | 0,00                         | 200.000,00         | PKO Bank Hipoteczny SA 0.75% 24-01-2024           | 203.580,00                 | 0,16                         |
| 81.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 01-08-2026 | 79.437,51                  | 0,06                         | 3.000,00           | Portugal Obrigacoes do Tesou 1% 12-04-2052        | 2.719,92                   | 0,00                         |
| 137.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 15-08-2024 | 136.804,09                 | 0,11                         | 100.000,00         | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 14-09-2027         | 99.192,85                  | 0,08                         |
| 45.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 0.25% 15-03-2028     | 43.880,70                  | 0,03                         | 15.000,00          | Republic of Austria Governme 0.000000% 20-02-2031 | 14.890,57                  | 0,01                         |
| 5.000,00           | Italy Buoni Poliennali Del T 0.4% 15-05-2030      | 5.717,18                   | 0,00                         | 13.000,00          | Republic of Austria Governme 0.25% 20-10-2036     | 12.678,41                  | 0,01                         |
| 16.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 0.6% 01-08-2031      | 15.230,79                  | 0,01                         | 13.000,00          | Republic of Austria Governme 0.75% 20-02-2028     | 13.774,93                  | 0,01                         |
| 47.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 0.85% 15-01-2027     | 47.902,40                  | 0,04                         | 3.000,00           | Republic of Austria Governme 0.75% 20-03-2051     | 3.084,41                   | 0,00                         |
| 15.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 0.95% 15-09-2027     | 15.311,07                  | 0,01                         | 3.000,00           | Republic of Austria Governme 0.85% 30-06-2120     | 2.608,06                   | 0,00                         |
| 25.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 1.3% 15-05-2028      | 31.090,62                  | 0,02                         | 6.000,00           | Republic of Austria Governme 2.4% 23-05-2034      | 7.606,01                   | 0,01                         |
| 11.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 1.45% 15-11-2024     | 11.433,58                  | 0,01                         | 1.000,00           | Romanian Government Internat 1.375% 02-12-2029    | 953,66                     | 0,00                         |
| 23.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 1.5% 30-04-2045      | 21.580,27                  | 0,02                         | 2.000,00           | Romanian Government Internat 2.124% 16-07-2031    | 1.906,24                   | 0,00                         |
| 33.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 1.65% 01-12-2030     | 34.696,45                  | 0,03                         | 100.000,00         | Royal Bank of Canada 0.01% 05-10-2028             | 98.960,40                  | 0,08                         |
| 8.000,00           | Italy Buoni Poliennali Del T 2% 01-12-2025        | 8.542,56                   | 0,01                         | 116.000,00         | Spain Government Bond 0.000000% 31-01-2028        | 115.106,80                 | 0,09                         |
| 10.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 2.15% 01-03-2072     | 9.561,21                   | 0,01                         | 39.000,00          | Spain Government Bond 0.5% 31-10-2031             | 38.757,54                  | 0,03                         |
| 2.000,00           | Italy Buoni Poliennali Del T 2.45% 01-10-2023     | 2.093,32                   | 0,00                         | 19.000,00          | Spain Government Bond 1% 31-10-2050               | 17.245,92                  | 0,01                         |
| 9.000,00           | Italy Buoni Poliennali Del T 2.8% 01-03-2067      | 10.165,50                  | 0,01                         | 5.000,00           | Spain Government Bond 1.2% 31-10-2040             | 5.050,00                   | 0,00                         |
| 32.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 3.35% 01-03-2035     | 39.369,15                  | 0,03                         | 11.000,00          | Spain Government Bond 1.45% 31-10-2071            | 9.554,84                   | 0,01                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 21.000,00          | Spain Government Bond 1.5%<br>30-04-2027          | 22.747,28                  | 0,02                         | 161.100,00         | United States Treasury Note/<br>1.25% 15-08-2031  | 139.032,58                 | 0,11                         |
| 10.000,00          | Spain Government Bond 1.6%<br>30-04-2025          | 10.651,04                  | 0,01                         | 193.800,00         | United States Treasury Note/<br>1.625% 15-08-2029   | 173.582,83                 | 0,14                         |
| 28.000,00          | Spain Government Bond 2.35%<br>30-07-2033         | 33.230,85                  | 0,03                         | 1.411.000,00       | United States Treasury Note/<br>2.25% 15-11-2027  | 1.308.233,32               | 1,04                         |
| 1.000,00           | Spain Government Bond 5.15%<br>31-10-2044         | 1.800,24                   | 0,00                         | 105.300,00         | United States Treasury Note/<br>2.625% 15-02-2029   | 100.528,72                 | 0,08                         |
| 300.000,00         | SpareBank 1 Boligkredit AS<br>0.01% 22-09-2027    | 299.149,20                 | 0,24                         |                    |   | <b>13.265.592,04</b>       | <b>10,53</b>                 |
| 400.000,00         | Sparebanken Vest Boligkredit<br>0.01% 11-11-2026  | 399.948,80                 | 0,32                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>116.977.365,57</b>      | <b>92,90</b>                 |
| 200.000,00         | SR-Boligkredit AS 0.01% 10-<br>03-2031            | 194.875,20                 | 0,15                         |                    | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>116.977.365,57</b>      | <b>92,90</b>                 |
| 7.000,00           | State of North Rhine-Westpha<br>0.2% 27-01-2051   | 6.238,54                   | 0,00                         |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
| 5.000,00           | State of North Rhine-Westpha<br>0.95% 10-01-2121  | 3.972,25                   | 0,00                         |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
| 100.000,00         | Sumitomo Mitsui Banking Corp<br>0.409% 07-11-2029 | 100.391,80                 | 0,08                         |                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 100.000,00         | UniCredit Bank AG 0.01% 21-<br>05-2029            | 99.083,00                  | 0,08                         | 6.000,00           | Italy Buoni Poliennali Del T 0.95%<br>01-08-2030  | 5.979,31                   | 0,00                         |
| 100.000,00         | UniCredit Bank AG 0.01% 28-<br>09-2026            | 100.250,40                 | 0,08                         | 4.000,00           | Italy Buoni Poliennali Del T 1.45%<br>01-03-2036  | 4.003,20                   | 0,00                         |
| 100.000,00         | United Overseas Bank Ltd 0.01%<br>01-12-2027      | 99.193,00                  | 0,08                         | 7.000,00           | Italy Buoni Poliennali Del T 1.85%<br>01-07-2025  | 7.401,70                   | 0,01                         |
| 300.000,00         | United Overseas Bank Ltd 0.1%<br>25-05-2029       | 296.882,40                 | 0,24                         | 500.000,00         | Sumitomo Mitsui Banking Corp<br>0.01% 10-09-2025  | 498.705,43                 | 0,40                         |
| 200.000,00         | Volksbank Wien AG 0.125%<br>19-11-2029            | 198.574,40                 | 0,16                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>516.089,64</b>          | <b>0,41</b>                  |
| 100.000,00         | Vseobecna Uverova Banka AS<br>0.01% 24-03-2026    | 99.792,80                  | 0,08                         |                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>516.089,64</b>          | <b>0,41</b>                  |
| 400.000,00         | Vseobecna Uverova Banka AS<br>0.25% 26-03-2024    | 403.826,40                 | 0,32                         |                    | <b>Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren<br/>(OGAW)</b>   |                            |                              |
| 100.000,00         | Westpac Banking Corp 0.01%<br>22-09-2028          | 98.716,00                  | 0,08                         |                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 200.000,00         | Westpac Banking Corp 0.5%<br>16-01-2025           | 203.714,00                 | 0,16                         | 8.601,00           | ISHARES EM LOCAL GOV BND<br>UCITS ETF   | 392.721,66                 | 0,31                         |
| 500.000,00         | Yorkshire Building Society 0.01%<br>13-10-2027    | 496.001,00                 | 0,39                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
|                    |   | <b>81.529.673,46</b>       | <b>64,75</b>                 | 10.920,00          | ISHARES JPM USD EM BND<br>UCITS ETF   | 1.048.663,22               | 0,83                         |
|                    | <b>GBP</b>  |                            |                              |                    | <b>Summe Organismen für<br/>gemeinsame Anlagen in<br/>Wertpapieren (OGAW)</b>   | <b>1.441.384,88</b>        | <b>1,14</b>                  |
| 321.058,00         | United Kingdom Gilt 1.25% 22-<br>07-2027          | 392.356,19                 | 0,31                         |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>118.934.840,09</b>      | <b>94,45</b>                 |
| 49.165,00          | United Kingdom Gilt 4.75% 07-<br>12-2030          | 77.793,92                  | 0,06                         |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>5.263.099,52</b>        | <b>4,18</b>                  |
|                    |   | <b>470.150,11</b>          | <b>0,37</b>                  |                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>1.725.582,88</b>        | <b>1,37</b>                  |
|                    | <b>JPY</b>  |                            |                              |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>125.923.522,49</b>      | <b>100,00</b>                |
| 21.150.000,00      | Japan Government Ten Year Bo<br>0.1% 20-06-2026   | 163.495,77                 | 0,13                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>163.495,77</b>          | <b>0,13</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>SEK</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 525.000,00         | Sweden Government Bond 0.125%<br>12-05-2031       | 50.713,34                  | 0,04                         |                    |   |                            |                              |
| 665.000,00         | Sweden Government Bond 0.75%<br>12-05-2028        | 67.482,18                  | 0,05                         |                    |   |                            |                              |
| 1.885.000,00       | Sweden Government Bond 1%<br>12-11-2026           | 192.396,49                 | 0,15                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>310.592,01</b>          | <b>0,25</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 2.883.000,00       | United States Treasury Infla 0.5%<br>15-01-2028   | 3.191.931,31               | 2,53                         |                    |   |                            |                              |
| 5.545.000,00       | United States Treasury Infla 0.75%<br>15-07-2028  | 6.177.285,94               | 4,91                         |                    |   |                            |                              |
| 463.000,00         | United States Treasury Infla<br>0.875% 15-01-2029 | 517.788,21                 | 0,41                         |                    |   |                            |                              |
| 1.259.000,00       | United States Treasury Note/<br>0.625% 15-05-2030 | 1.038.867,44               | 0,82                         |                    |   |                            |                              |
| 182.800,00         | United States Treasury Note/<br>0.625% 15-08-2030 | 150.440,76                 | 0,12                         |                    |   |                            |                              |
| 205.200,00         | United States Treasury Note/<br>0.625% 30-11-2027 | 173.532,11                 | 0,14                         |                    |   |                            |                              |
| 142.600,00         | United States Treasury Note/<br>0.875% 15-11-2030 | 119.663,48                 | 0,10                         |                    |   |                            |                              |
| 204.000,00         | United States Treasury Note/<br>1.125% 15-02-2031 | 174.705,34                 | 0,14                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| Deutschland            | 49,65        | Staatsanleihen       | 60,46        |
| Dänemark               | 16,74        | Hypothekenanleihen   | 24,93        |
| USA                    | 10,53        | Unternehmensanleihen | 7,91         |
| Frankreich             | 7,11         | Offene Anleihefonds  | 1,14         |
| Kanada                 | 1,36         |                      |              |
| Norwegen               | 1,27         | <b>Summe</b>         | <b>94,45</b> |
| Irland                 | 1,18         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich | 1,01         |                      |              |
| Österreich             | 0,93         |                      |              |
| Niederlande            | 0,72         |                      |              |
| Australien             | 0,68         |                      |              |
| Japan                  | 0,61         |                      |              |
| Slowakei               | 0,48         |                      |              |
| Italien                | 0,45         |                      |              |
| Singapur               | 0,39         |                      |              |
| Neuseeland             | 0,32         |                      |              |
| Schweden               | 0,25         |                      |              |
| Belgien                | 0,22         |                      |              |
| Spanien                | 0,20         |                      |              |
| Estland                | 0,16         |                      |              |
| Polen                  | 0,16         |                      |              |
| Finnland               | 0,02         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>94,45</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 10.346.603,88                                     | DKK                | 1.391.396,13      | EUR                  | (4,56)  | 28.01.2022  |
| 50.914,56   | NOK                | 5.048,01          | EUR                  | 46,26   | 28.01.2022  |
| 100.964,85  | SEK                | 9.968,83          | EUR                  | (123,75)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(82,05)</b>  |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 3.439,11  | EUR                | 4.000,00          | USD                  | (91,48)   | 14.01.2022  |
| 509.862.656,00                                    | JPY                | 4.598.000,00      | USD                  | (149.369,24)  | 14.01.2022  |
| 15.000,00   | USD                | 12.909,54         | EUR                  | 330,16  | 14.01.2022  |
| 64.616,55   | EUR                | 73.000,00         | USD                  | 245,11  | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(148.885,45)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 94.000,00   | CAD                | 8.431.821,00      | JPY                  | 608,79  | 14.01.2022  |
| 60.271,68   | CAD                | 48.000,00         | USD                  | (526,59)  | 14.01.2022  |
| 6.954.819,96                                      | CZK                | 273.000,00        | EUR                  | 6.174,43  | 14.01.2022  |
| 141.000,00  | EUR                | 18.225.127,00     | JPY                  | 1.270,50  | 14.01.2022  |
| 422.606,78  | EUR                | 482.000,00        | USD                  | (2.827,16)  | 14.01.2022  |
| 573.553,77  | USD                | 493.307,39        | EUR                  | 12.938,27   | 14.01.2022  |
| 278.000,00  | USD                | 4.338.413,10      | ZAR                  | 5.763,01  | 14.01.2022  |
| 125.500,00  | USD                | 9.537.121,50      | INR                  | (1.656,20)  | 22.02.2022  |
| 9.000,00  | AUD                | 5.682,38          | EUR                  | 70,31   | 02.03.2022  |
| 13.000,00   | CAD                | 8.993,93          | EUR                  | 21,24   | 02.03.2022  |
| 455.098,00  | EUR                | 726.000,00        | AUD                  | (8.956,12)  | 02.03.2022  |
| 23.754,56   | EUR                | 20.000,00         | GBP                  | (18,47)   | 02.03.2022  |
| 70.378,03   | EUR                | 80.000,00         | USD                  | (166,50)  | 02.03.2022  |
| 10.000,00   | GBP                | 11.839,73         | EUR                  | 46,83   | 02.03.2022  |
| 140.000,00  | USD                | 123.421,89        | EUR                  | 30,77   | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>12.773,11</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 187.000,00  | AUD                | 15.157.771,00     | JPY                  | 3.414,97  | 14.01.2022  |
| 91.000,00   | AUD                | 68.389,62         | USD                  | (2.149,92)  | 14.01.2022  |
| 5.723,00  | CAD                | 3.814,58          | EUR                  | 158,34  | 14.01.2022  |
| 3.927.653,68                                      | EUR                | 5.892.639,18      | CAD                  | (163.031,75)  | 14.01.2022  |
| 446.028,42  | EUR                | 511.789,71        | USD                  | (5.699,87)  | 14.01.2022  |
| 1.018.474.052,00                                  | JPY                | 7.832.535,98      | EUR                  | (24.025,76)   | 14.01.2022  |
| 5.117.016,00                                      | MXN                | 213.014,31        | EUR                  | 7.419,31  | 14.01.2022  |
| 148.306,02  | USD                | 208.000,00        | AUD                  | (2.160,41)  | 14.01.2022  |
| 476.876,30  | USD                | 413.999,61        | EUR                  | 6.913,00  | 14.01.2022  |
| 3.888.342,00                                      | ZAR                | 228.457,23        | EUR                  | (13.705,58)   | 14.01.2022  |
| 1.186.644,35                                      | BRL                | 205.000,00        | USD                  | 4.713,80  | 22.02.2022  |
| 22.116.200,50                                     | INR                | 294.133,61        | USD                  | 1.100,59  | 22.02.2022  |
| 40.398.835,60                                     | RUB                | 533.552,48        | USD                  | (894,21)  | 22.02.2022  |
| 5.768.000,00                                      | DKK                | 775.604,28        | EUR                  | 80,86   | 28.02.2022  |
| 540.889,60  | EUR                | 4.023.000,00      | DKK                  | (126,66)  | 28.02.2022  |
| 1.498.290,44                                      | MXN                | 60.710,14         | EUR                  | 3.252,53  | 01.03.2022  |
| 102.000,00  | AUD                | 64.052,06         | EUR                  | 1.145,50  | 02.03.2022  |
| 16.000,00   | CAD                | 11.091,47         | EUR                  | 4,09  | 02.03.2022  |
| 65.804,52   | EUR                | 104.000,00        | AUD                  | (670,86)  | 02.03.2022  |
| 252.756,39  | EUR                | 368.000,00        | CAD                  | (2.444,21)  | 02.03.2022  |
| 164.918,87  | EUR                | 21.174.000,00     | JPY                  | 2.680,37  | 02.03.2022  |
| 3.618.715,14                                      | EUR                | 4.119.400,00      | USD                  | (13.805,57)   | 02.03.2022  |
| 11.000,00   | GBP                | 13.060,74         | EUR                  | 14,43   | 02.03.2022  |
| 87.000,00   | USD                | 76.783,28         | EUR                  | (66,36)   | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(197.883,37)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 6.566.629,94                                      | CZK                | 260.000,00        | EUR                  | 3.591,46  | 14.01.2022  |
| 3.917.494,44                                      | EUR                | 6.276.915,15      | AUD                  | (97.973,11)   | 14.01.2022  |
| 50.022,79   | EUR                | 58.000,00         | USD                  | (1.170,72)  | 14.01.2022  |
| 1.179.191,05                                      | USD                | 1.040.972,80      | EUR                  | (169,84)  | 14.01.2022  |
| 2.967.625,15                                      | TRY                | 170.000,00        | USD                  | 36.080,26   | 22.02.2022  |
| 125.500,00  | USD                | 9.540.196,25      | INR                  | (1.692,46)  | 22.02.2022  |
| 979.000,00  | DKK                | 131.628,13        | EUR                  | 28,57   | 28.02.2022  |
| 562.650,78  | ZAR                | 30.779,28         | EUR                  | 66,92   | 01.03.2022  |
| 16.396,95   | EUR                | 26.000,00         | AUD                  | (221,96)  | 02.03.2022  |
| 308.516,26  | EUR                | 3.173.000,00      | SEK                  | (758,81)  | 02.03.2022  |
| 2.657,18  | EUR                | 3.000,00          | USD                  | 11,78   | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(62.207,91)</b>  |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                                | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|--|-------------------|--------------------|--------------------|---|------------|
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                   |                    |                    |   |            |
| 11.818.438,39                                    | EUR               | 14.003.037,30      | USD                | (541.362,70)  | 14.01.2022 |
| 15.829.122,20                                    | USD               | 13.365.526,68      | EUR                | 606.069,36  | 14.01.2022 |
| 4.570.000,00                                     | USD               | 498.727.299,00     | JPY                | 210.044,26  | 14.01.2022 |
| 33.000,00  | USD               | 2.467.017,16       | RUB                | 423,40  | 22.02.2022 |
| 1.028.000,00                                     | DKK               | 138.228,17         | EUR                | 18,08   | 28.02.2022 |
| 202.638,51                                       | EUR               | 230.000,00         | USD                | (180,82)  | 01.03.2022 |
| 4.706.610,50                                     | MXN               | 224.000,00         | USD                | 3.391,47  | 01.03.2022 |
| 1.083.298,25                                     | TRY               | 68.408,74          | EUR                | (939,05)  | 01.03.2022 |
| 25.000,00  | USD               | 539.318,45         | MXN                | (977,96)  | 01.03.2022 |
| 220.000,00                                       | AUD               | 139.345,71         | EUR                | 1.275,12  | 02.03.2022 |
| 9.000,00   | CAD               | 6.246,77           | EUR                | (5,53)  | 02.03.2022 |
| 69.590,08  | EUR               | 111.000,00         | AUD                | (1.360,32)  | 02.03.2022 |
| 15.956,38  | EUR               | 23.000,00          | CAD                | 6,53  | 02.03.2022 |
| 514.050,12                                       | EUR               | 438.000,00         | GBP                | (6.586,04)  | 02.03.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>269.815,80</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |                   |                    |                    |   |            |
| 293.938,46                                       | EUR               | 332.931,70         | USD                | 79,14   | 14.01.2022 |
| 34.189.586,00                                    | JPY               | 302.000,00         | USD                | (4.431,49)  | 14.01.2022 |
| 1.575.850,00                                     | TRY               | 147.105,50         | EUR                | (44.755,85)   | 14.01.2022 |
| 113.000,00                                       | USD               | 99.480,02          | EUR                | 258,54  | 14.01.2022 |
| 1.591.171,00                                     | BRL               | 279.406,72         | USD                | 2.328,84  | 22.02.2022 |
| 43.397.156,10                                    | INR               | 572.035,85         | USD                | 6.681,81  | 22.02.2022 |
| 273.000,00                                       | EUR               | 309.159,70         | USD                | 376,49  | 01.03.2022 |
| 25.000,00  | CAD               | 17.136,25          | EUR                | 200,78  | 02.03.2022 |
| 19.302,11  | EUR               | 28.000,00          | CAD                | (115,25)  | 02.03.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>(39.376,99)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>              |                   |                    |                    |   |            |
| 21.203.347,00                                    | EUR               | 157.697.985,01     | DKK                | (4.003,23)  | 28.02.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>(4.003,23)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>          |                   |                    |                    |   |            |
| 6.169,65   | EUR               | 7.000,00           | USD                | (8,85)  | 14.01.2022 |
| 26.000,00  | USD               | 23.006,00          | EUR                | (57,34)   | 14.01.2022 |
| 113.000,00                                       | USD               | 99.935,85          | EUR                | (292,28)  | 02.03.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>(358,47)</b>   |            |
|  |                   |                    |                    | <b>(170.126,51)</b>   |            |
|  |                   |                    |                    | <b>(170.208,56)</b>   |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

## Credit Default Swaps

| Basiswert                                     | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal      | Währung | Kosten (EUR)      | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)   | Fälligkeit |
|---|--------------|-----------------|--------------|---------|-------------------|---|-------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>            |              |                 |              |         |                   |   |                   |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (473.000,00) | USD     | 39.096,47         | (505,57)  | 38.590,90         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (619.000,00) | USD     | 51.177,58         | (674,91)  | 50.502,67         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (728.000,00) | USD     | 60.214,36         | (818,64)  | 59.395,72         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (582.000,00) | USD     | 46.820,72         | 663,22  | 47.483,94         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (583.000,00) | USD     | 47.144,14         | 421,38  | 47.565,52         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (655.000,00) | USD     | 52.461,69         | 978,14  | 53.439,83         | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (250.000,00) | EUR     | 30.477,66         | (676,83)  | 29.800,83         | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (261.000,00) | EUR     | 31.717,55         | (605,49)  | 31.112,06         | 20.12.2026 |
|   |              |                 |              |         | <b>359.110,17</b> | <b>(1.218,70)</b>                                   | <b>357.891,47</b> |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |              |                 |              |         |                   |   |                   |            |
| ITRAXX-EUROPES36V1-5Y                         | Verkauf      | 1,00%           | (717.000,00) | EUR     | 185.102,26        | 1.477,48  | 186.579,74        | 20.12.2026 |
|   |              |                 |              |         | <b>185.102,26</b> | <b>1.477,48</b>                                     | <b>186.579,74</b> |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert  | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal        | Währung | Kosten (EUR)        | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)     | Fälligkeit |
|--|--------------|-----------------|----------------|---------|---------------------|---|---------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |              |                 |                |         |                     |   |                     |            |
| CDX-EMS36V1-5Y                                   | Verkauf      | 1,00%           | (350.000,00)   | USD     | (14.368,32)         | 1.829,21  | (12.539,11)         | 20.12.2026 |
| CDX-NAIGS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 1,00%           | (9.520.000,00) | USD     | 195.400,08          | 9.550,31  | 204.950,39          | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                |         | <b>181.031,76</b>   | <b>11.379,52</b>                                    | <b>192.411,28</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |              |                 |                |         |                     |   |                     |            |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (250.000,00)   | EUR     | 29.682,22           | 118,61  | 29.800,83           | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (390.000,00)   | EUR     | 46.465,14           | 24,15   | 46.489,29           | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (450.000,00)   | EUR     | 53.569,30           | 72,19   | 53.641,49           | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (400.000,00)   | EUR     | 47.834,87           | (153,55)  | 47.681,32           | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (2.330.000,00) | EUR     | 262.067,06          | 15.676,66   | 277.743,72          | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                |         | <b>439.618,59</b>   | <b>15.738,06</b>                                    | <b>455.356,65</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |              |                 |                |         |                     |   |                     |            |
| CDX-EMS36V1-5Y                                   | Verkauf      | 1,00%           | (4.420.000,00) | USD     | (127.714,04)        | (30.636,98)   | (158.351,02)        | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (149.000,00)   | EUR     | 17.952,59           | (191,30)  | 17.761,29           | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (510.000,00)   | EUR     | 62.162,17           | (1.368,48)  | 60.793,69           | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                |         | <b>(47.599,28)</b>  | <b>(32.196,76)</b>                                  | <b>(79.796,04)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |              |                 |                |         |                     |   |                     |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (2.010.000,00) | USD     | 147.558,52          | 16.432,40   | 163.990,92          | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                |         | <b>147.558,52</b>   | <b>16.432,40</b>                                    | <b>163.990,92</b>   |            |
|  |              |                 |                |         | <b>1.264.822,02</b> | <b>11.612,00</b>                                    | <b>1.276.434,02</b> |            |

## Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|-------------------------------|--------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                               |                          |   |  |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022 | AUD     | 59,00                         | 5.798.225,00             | (18.947,55)   | 17.858,18  |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | 26,00                         | 3.698.500,00             | (2.166,50)  | 71.697,03  |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (136,00)                      | (18.124.720,00)          | (4.080,00)  | 137.295,53   |
| Euro-BTP Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (1,00)                        | (146.960,00)             | 50,00   | 2.529,68   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (54,00)                       | (9.253.980,00)           | 0,00  | 165.608,44   |
| EURO-BUXL 30Y BND 3/2022               | 10.03.2022 | EUR     | (1,00)                        | (206.740,00)             | 0,00  | 10.520,08  |
| Euro-OAT Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (1,00)                        | (163.210,00)             | (60,00)   | 2.880,00   |
| EURO-SCHATZ FUT 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | 1,00                          | 112.030,00               | 0,00  | (24,10)  |
| EURO-SCHATZ FUT 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (371,00)                      | (41.563.130,00)          | 0,00  | 59.790,46  |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (105,00)                      | (13.692.656,25)          | 0,00  | (122.837,92)   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 53,00                         | 6.911.531,25             | 0,00  | 49.999,08  |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (6,00)                        | (725.765,64)             | (289,71)  | (1.021,05)   |
|  |            |         |                               |                          | <b>(25.493,76)</b>  | <b>394.295,41</b>  |

BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 350.000,00 EUR gezahlt.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 400.000,00 EUR gezahlt.  
 Citibank Europe PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 190.000,00 EUR gezahlt.  
 Deutsche Bank AG hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 300.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in DKK)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                               | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              | 2.102,71           | Nordea Kredit 5% 07-01-2029<br>RO 1                | 2.332,43                   | 0,00                         |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              | 197.590,20         | Nordea Kredit 5% 10-01-2024 RO 1                   | 210.532,36                 | 0,00                         |
| <b>DKK</b>  |  |                            |                              | 69.870,78          | Nordea Kredit 6% 04-01-2035<br>RO 1                | 80.892,90                  | 0,00                         |
| 19.500.000,00   | Danish Government 0.5% 11-15-2027          | 20.284.095,00              | 0,25                         | 5.179,52           | Nordea Kredit 6% 07-01-2022 RO 1                   | 5.394,47                   | 0,00                         |
| 100.000,00  | Danish Government 1.5% 11-15-2023          | 103.869,80                 | 0,00                         | 36.114,92          | Nordea Kredit 6% 10-01-2032 RO 1                   | 42.489,20                  | 0,00                         |
| 118.750.000,00  | Danish Government 1.75% 11-15-2025         | 128.402.000,00             | 1,56                         | 60.004,78          | Nordea Kredit 7% 07-01-2031 RO 1                   | 70.985,65                  | 0,00                         |
| 100.000,00  | Danish Government 7% 11-10-2024            | 121.439,00                 | 0,00                         | 15.007.396,65      | Nykredit Realkredit 0.5% 10-01-2050 SDO E          | 13.735.519,78              | 0,17                         |
| 350.000.000,00  | DLR Kredit 1% 10-01-2022 SDO A B           | 354.071.018,00             | 4,29                         | 242.797.117,69     | Nykredit Realkredit 0.5% 10-01-2053 SDO E          | 218.153.210,24             | 2,64                         |
| 3.186.562,41  | DLR Kredit 2% 10-01-2047 SDO B             | 3.303.668,58               | 0,04                         | 489.982.539,86     | Nykredit Realkredit 1% 10-01-2050 SDO E            | 466.953.360,49             | 5,66                         |
| 807.797,42  | DLR Kredit 3.5% 07-01-2044 SDO B           | 909.983,79                 | 0,01                         | 307.783.441,11     | Nykredit Realkredit 1% 10-01-2053 SDO E            | 290.008.947,39             | 3,51                         |
| 256.524,09  | DLR Kredit 4% 10-01-2031 SDO B             | 281.599,32                 | 0,00                         | 69.592.999,06      | Nykredit Realkredit 1.5% 10-01-2050 SDO E          | 69.071.051,57              | 0,84                         |
| 29.006,03   | DLR Kredit 4% 10-01-2035 RO                | 33.117,63                  | 0,00                         | 99.719.061,21      | Nykredit Realkredit 1.5% 10-01-2053 IO SDO E       | 96.328.613,13              | 1,17                         |
| 989.002,67  | DLR Kredit 4% 10-01-2041 SDO B             | 1.130.182,80               | 0,01                         | 69.625.120,37      | Nykredit Realkredit 1.5% 10-01-2053 SDO E          | 68.215.211,68              | 0,83                         |
| 2.377.857,38  | DLR Kredit CF 6% 01-01-2038 CIBOR 6M RO FL | 2.507.236,60               | 0,03                         | 207.111.801,24     | Nykredit Realkredit 2% 01-01-2025 SDO A H          | 220.483.987,11             | 2,67                         |
| 186.608.401,40  | Jyske Realkredit A/S 0.5% 10-01-2050 SDO E | 170.979.947,78             | 2,07                         | 10.645.115,32      | Nykredit Realkredit 2% 10-01-2047 IO SDO E         | 10.991.081,57              | 0,13                         |
| 812.032.190,73  | Jyske Realkredit A/S 1% 10-01-2050 SDO E   | 774.678.709,96             | 9,38                         | 187.966.252,51     | Nykredit Realkredit 2% 10-01-2047 SDO E            | 195.014.986,98             | 2,36                         |
| 681.696.733,45  | Jyske Realkredit A/S 1% 10-01-2053 SDO E   | 642.499.171,28             | 7,78                         | 87.069.425,04      | Nykredit Realkredit 2% 10-01-2050 SDO E            | 89.659.740,43              | 1,09                         |
| 30.465.296,89   | Jyske Realkredit A/S 1.5% 10-01-2050 SDO E | 30.236.807,16              | 0,37                         | 26.769.245,07      | Nykredit Realkredit 2.5% 07-01-2047 SDO E          | 28.629.707,60              | 0,35                         |
| 20.772.207,09   | Jyske Realkredit A/S 2% 10-01-2047 SDO E   | 21.545.971,80              | 0,26                         | 1.630.881,06       | Nykredit Realkredit 3% 04-01-2034 SDO E            | 1.773.583,15               | 0,02                         |
| 43.984.474,33   | Jyske Realkredit A/S 2% 10-01-2050 SDO E   | 45.315.004,68              | 0,55                         | 1.814.107,31       | Nykredit Realkredit 3% 10-01-2044 IO SDO E         | 1.976.923,44               | 0,02                         |
| 7.358.799,68  | Jyske Realkredit A/S 2.5% 04-01-2047 SDO E | 7.875.755,36               | 0,10                         | 244.836,38         | Nykredit Realkredit 3% 10-01-2044 SDO E            | 266.810,45                 | 0,00                         |
| 1.187.183,08  | Jyske Realkredit A/S 3% 10-01-2044 SDO E   | 1.293.732,76               | 0,02                         | 433.974,76         | Nykredit Realkredit 3.5% 04-01-2044 SDO E          | 490.282,99                 | 0,01                         |
| 259.495,10  | Jyske Realkredit A/S 4% 07-01-2031 SDO E   | 285.120,24                 | 0,00                         | 1.044.602,07       | Nykredit Realkredit 3.5% 07-01-2044 IO SDO E       | 1.179.094,59               | 0,01                         |
| 3.684.841,90  | Jyske Realkredit A/S 4% 10-01-2035 RO B    | 4.219.143,98               | 0,05                         | 50.000.000,00      | Nykredit Realkredit 4% 01-01-2022 SDO H            | 50.000.000,00              | 0,61                         |
| 1.174.611,38  | Jyske Realkredit A/S 5% 04-01-2035 RO B    | 1.400.136,76               | 0,02                         | 1.553.270,30       | Nykredit Realkredit 4% 04-01-2041 RO               | 1.757.525,34               | 0,02                         |
| 26.247,43   | Jyske Realkredit A/S 5% 10-01-2041 SDO E   | 31.024,46                  | 0,00                         | 644.864,69         | Nykredit Realkredit 4% 07-01-2038 RO D             | 734.339,67                 | 0,01                         |
| 5.890,39  | Jyske Realkredit A/S 6% 04-01-2038 IO RO B | 7.140,63                   | 0,00                         | 181.769,62         | Nykredit Realkredit 4% 10-01-2028 RO D             | 197.719,90                 | 0,00                         |
| 9.189,50  | Jyske Realkredit A/S 6% 10-01-2022 RO      | 9.563,97                   | 0,00                         | 200.823,70         | Nykredit Realkredit 4% 10-01-2041 SDO E            | 229.190,05                 | 0,00                         |
| 80.435,26   | Jyske Realkredit A/S 7% 01-01-2039 SDO E   | 97.085,36                  | 0,00                         | 48.153,88          | Nykredit Realkredit 5% 04-01-2034 RO               | 56.917,89                  | 0,00                         |
| 17.593,00   | KommuneKredit 3% 01-01-2024                | 17.658,97                  | 0,00                         | 278.419,26         | Nykredit Realkredit 5% 10-01-2037 RO               | 329.369,98                 | 0,00                         |
| 93.391.678,81   | Nordea Kredit 0.5% 10-01-2050 SDRO 2       | 85.593.473,63              | 1,04                         | 8.850,87           | Nykredit Realkredit 6% 04-01-2038 RO D             | 10.607,77                  | 0,00                         |
| 97.192.715,10   | Nordea Kredit 0.5% 10-01-2053 SDRO 2       | 87.376.250,87              | 1,06                         | 95.131,62          | Nykredit Realkredit 6% 10-01-2026 RO C             | 106.452,28                 | 0,00                         |
| 448.470.915,97  | Nordea Kredit 1% 10-01-2050 SDRO 2         | 428.289.724,75             | 5,19                         | 27.759,40          | Nykredit Realkredit 7% 01-01-2039 SDO E            | 33.505,60                  | 0,00                         |
| 145.167.155,21  | Nordea Kredit 1% 10-01-2053 SDRO 2         | 136.856.335,57             | 1,66                         | 146.234,07         | Nykredit Realkredit 7% 10-01-2029 RO C             | 174.530,36                 | 0,00                         |
| 44.725.212,42   | Nordea Kredit 1.5% 10-01-2050 SDRO 2       | 44.400.954,63              | 0,54                         | 7.995.224,50       | Nykredit Realkredit CF 5% 07-01-2038 CIBOR 6M RO D | 8.478.136,06               | 0,10                         |
| 25.908.801,74   | Nordea Kredit 2% 07-01-2050 SDRO 2         | 26.679.588,59              | 0,32                         | 8.836.601,63       | Nykredit Realkredit CF 5% 07-01-2038 IO CIBOR 6M R | 9.339.492,63               | 0,11                         |
| 194.487.243,99  | Nordea Kredit 2% 10-01-2047 SDRO 2         | 201.829.137,45             | 2,44                         | 186.628.361,02     | Realkredit Danmark 0.5% 10-01-2050 SDRO S          | 170.811.607,42             | 2,07                         |
| 12.062.272,29   | Nordea Kredit 2.5% 04-01-2047 SDRO 2       | 12.900.600,21              | 0,16                         | 900.826.667,36     | Realkredit Danmark 1% 10-01-2050 SDRO S            | 858.262.607,33             | 10,39                        |
| 9.918.648,21  | Nordea Kredit 3% 10-01-2044 SDRO 2         | 10.801.407,90              | 0,13                         | 463.697.906,99     | Realkredit Danmark 1% 10-01-2053 SDRO S            | 436.919.352,86             | 5,29                         |
| 3.862.024,01  | Nordea Kredit 3.5% 04-01-2044 SDRO 2       | 4.364.087,13               | 0,05                         | 171.184.376,29     | Realkredit Danmark 1.5% 10-01-2050 SDRO S          | 169.814.901,28             | 2,06                         |
| 1.237.723,86  | Nordea Kredit 3.5% 07-01-2044 IO SDRO 2    | 1.395.843,08               | 0,02                         | 41.028.666,58      | Realkredit Danmark 2% 07-01-2050 SDRO S            | 42.269.783,74              | 0,51                         |
| 1.130.884,44  | Nordea Kredit 4% 07-01-2036 RO 1           | 1.286.098,33               | 0,02                         | 113.598.707,58     | Realkredit Danmark 2% 10-01-2047 SDRO S            | 117.887.058,79             | 1,43                         |
| 176.562,20  | Nordea Kredit 4% 10-01-2041 SDRO 2         | 200.971,92                 | 0,00                         | 6.357.080,67       | Realkredit Danmark 3.5% 04-01-2044 SDRO S          | 7.183.501,16               | 0,09                         |
| 9.534,19  | Nordea Kredit 5% 01-01-2035 RO 1           | 11.369,52                  | 0,00                         | 4.997,90           | Realkredit Danmark 4% 10-01-2035 RO                | 5.718,85                   | 0,00                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in DKK) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 319.018,64         | Realkredit Danmark 4% 10-01-2041 SDRO S   | 362.245,67                 | 0,00                         |
| 3.844.826,87       | Realkredit Danmark 5% 07-01-2035 RO   | 4.588.800,87               | 0,06                         |
| 17.582,68          | Realkredit Danmark 6% 01-01-2038 RO   | 21.072,84                  | 0,00                         |
| 113.151,06         | Realkredit Danmark 6% 10-01-2032 RO   | 133.546,54                 | 0,00                         |
| 32.108,25          | Realkredit Danmark 6% 10-01-2036 RO   | 37.895,76                  | 0,00                         |
| 76.863,04          | Realkredit Danmark 7% 10-01-2029 RO   | 91.736,04                  | 0,00                         |
| 4.245.148,43       | Realkredit Danmark CF 5% 01-01-2038 IO CIBOR 6M RO  | 4.490.984,98               | 0,05                         |
| 700.768,64         | Totalkredit 5% 04-01-2035 RO C  | 836.717,76                 | 0,01                         |
|                    |   | <b>6.912.136.182,61</b>    | <b>83,71</b>                 |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 30.000.000,00      | DNB Boligkredit AS 0.625% 14-01-2026  | 229.084.749,51             | 2,77                         |
| 10.000.000,00      | Eika Boligkredit AS 0.875% 01-02-2029   | 78.114.467,88              | 0,95                         |
| 5.500.000,00       | Lansforsakringar Hypotek AB 0.625% 29-01-2026   | 41.918.053,03              | 0,51                         |
| 10.600.000,00      | SR-Boligkredit AS 0.01% 08-09-2028  | 78.154.772,63              | 0,95                         |
|                    |   | <b>427.272.043,05</b>      | <b>5,17</b>                  |
|                    | <b>NOK</b>  |                            |                              |
| 45.000.000,00      | Eika Boligkredit AS 18/23 FRN C COVID   | 33.663.059,71              | 0,41                         |
| 400.000.000,00     | Spb 1 Boligkredit AS 16/26 ADJ C COVID  | 298.863.218,86             | 3,62                         |
| 100.000.000,00     | Spb 1 Boligkredit AS 17/23 FRN C COVID  | 74.832.220,04              | 0,91                         |
|                    |   | <b>407.358.498,61</b>      | <b>4,93</b>                  |
|                    | <b>SEK</b>  |                            |                              |
| 300.000.000,00     | Stadshypotek AB 1% 03-09-2025   | 221.509.486,71             | 2,68                         |
|                    |   | <b>221.509.486,71</b>      | <b>2,68</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>7.968.276.210,98</b>    | <b>96,50</b>                 |
|                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>7.968.276.210,98</b>    | <b>96,50</b>                 |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>DKK</b>  |                            |                              |
| 0,04               | Nordea Kredit 6% 07-01-2029 RO 1  | 0,05                       | 0,00                         |
| 0,01               | Totalkredit 7% 07-01-2029 RO C  | 0,01                       | 0,00                         |
|                    |   | <b>0,06</b>                | <b>0,00</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>0,06</b>                | <b>0,00</b>                  |
|                    | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                   | <b>0,06</b>                | <b>0,00</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>7.968.276.211,04</b>    | <b>96,50</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>149.010.073,89</b>      | <b>1,80</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>139.912.231,59</b>      | <b>1,69</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>8.257.198.516,52</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| <b>Land</b>  |              | <b>Sektor</b>               |              |
|--------------|--------------|-----------------------------|--------------|
| Dänemark     | 83,71        | Kündbare Hypothekenanleihen | 74,32        |
| Norwegen     | 9,60         | Hypothekenanleihen          | 11,72        |
| Schweden     | 3,19         | Unternehmensanleihen        | 8,65         |
|              |              | Staatsanleihen              | 1,80         |
| <b>Summe</b> | <b>96,50</b> | <b>Summe</b>                | <b>96,50</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (DKK) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|--|-------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                    |                   |                      |  |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |  |             |
| 23.654.603,09                                     | CHF                | 167.711.910,73    | DKK                  | 2.609.759,65   | 28.01.2022  |
| 14.223.665,00                                     | DKK                | 1.991.761,31      | CHF                  | (117.680,04)   | 28.01.2022  |
| 165.902.463,84                                    | DKK                | 22.307.522,04     | EUR                  | 20.443,43  | 28.01.2022  |
| 11.653.663,32                                     | DKK                | 201.037.677,00    | JPY                  | 194.202,06   | 28.01.2022  |
| 28.895.543,72                                     | DKK                | 40.000.000,04     | SEK                  | (108.648,23)   | 28.01.2022  |
| 765.585.261,25                                    | EUR                | 5.693.019.021,28  | DKK                  | (13.862,37)  | 28.01.2022  |
| 5.505.833.829,00                                  | JPY                | 316.433.050,31    | DKK                  | (2.590.476,38)   | 28.01.2022  |
| 240.411.650,00                                    | SEK                | 176.494.974,35    | DKK                  | (2.172.840,55)   | 28.01.2022  |
| 3.221.447,64                                      | USD                | 21.248.804,60     | DKK                  | (110.912,04)   | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(2.290.014,47)</b>  |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |  |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |  |             |
| 388.044.526,72                                    | DKK                | 533.440.000,00    | NOK                  | (8.911.139,37)   | 24.01.2022  |
| 216.561.171,75                                    | DKK                | 296.450.000,00    | SEK                  | 1.593.573,43   | 24.01.2022  |
| 33.134.307,53                                     | DKK                | 4.455.000,00      | EUR                  | 6.907,42   | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(7.310.658,52)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                  |                    |                   |                      |  |             |
| 3.577.000,00                                      | EUR                | 26.606.668,90     | DKK                  | (8.083,60)   | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(8.083,60)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>               |                    |                   |                      |  |             |
| 459.832.748,07                                    | DKK                | 61.827.000,00     | EUR                  | 86.886,53  | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>86.886,53</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>           |                    |                   |                      |  |             |
| 6.150.000,00                                      | SEK                | 4.617.645,71      | DKK                  | (158.094,62)   | 24.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(158.094,62)</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(7.389.950,21)</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(9.679.964,68)</b>  |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Falligkeit | Wahrung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (DKK) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (DKK) |
|--|-------------|----------|-------------------------------|---------------------------|--|---|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |             |          |                               |                           |  |   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | 622,00                        | 106.592.140,00            | 0,00   | (14.074.618,85)   |
|  |             |          |                               |                           | <b>0,00</b>  | <b>(14.074.618,85)</b>  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Zinsswaps

| Beschreibung                                     | Nominal          | Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) in der Basiswährung<br>des Teilfonds (DKK) | Fälligkeit |
|--|------------------|---------|--|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |                  |         |  |            |
| Paying fixed rate 0.4030%                        | (30.000.000,00)  | EUR     | 5.256.226,25   | 26.02.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>5.256.226,25</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>    |                  |         |  |            |
| Paying fixed rate 0.1310%                        | (100.000.000,00) | EUR     | 11.668.387,31  | 28.09.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>11.668.387,31</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>    |                  |         |  |            |
| Paying fixed rate 0.1330%                        | (100.000.000,00) | EUR     | 11.522.777,12  | 28.09.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>11.522.777,12</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate -0.2430%                    | 50.000.000,00    | EUR     | (16.171.094,58)  | 24.11.2030 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>(16.171.094,58)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                  |         |  |            |
| Paying fixed rate -0.0680%                       | (80.000.000,00)  | EUR     | 20.510.207,57  | 02.09.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>20.510.207,57</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>     |                  |         |  |            |
| Paying fixed rate 0.0800%                        | (18.000.000,00)  | EUR     | 15.174.027,47  | 26.01.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>15.174.027,47</b>   |            |
|  |                  |         | <b>47.960.531,14</b>   |            |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Zinsswaps 420.000,00 EUR erhalten.  
 BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Zinsswaps 510.000,00 EUR gezahlt.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Zinsswaps 1.360.000,00 EUR gezahlt.  
 Deutsche Bank AG hat als Sicherheit für Zinsswaps 1.920.000,00 EUR erhalten.  
 Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Zinsswaps 2.630.000,00 EUR gezahlt.  
 Morgan Stanley Europe SE hat als Sicherheit für Zinsswaps 1.970.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 2.665.000,00  | Egypt Government Internation 4.75% 16-04-2026  | 2.913.769,87               | 0,24                         | 7.433.185,00       | Argentine Republic Governmen MULTI 09-07-2035  | 2.360.036,24               | 0,20                         |
| 1.890.000,00  | Egypt Government Internation 5.625% 16-04-2030 | 1.931.518,47               | 0,16                         | 5.412.005,00       | Argentine Republic Governmen MULTI 09-07-2041  | 1.907.731,76               | 0,16                         |
| 5.965.000,00  | Egypt Government Internation 6.375% 11-04-2031 | 6.221.769,74               | 0,52                         | 700.000,00         | Bahrain Government Internati 5.625% 30-09-2031 | 687.820,00                 | 0,06                         |
| 1.470.000,00  | Indonesia Government Interna 1.45% 18-09-2026  | 1.723.047,23               | 0,14                         | 6.325.000,00       | Bahrain Government Internati 6.75% 20-09-2029  | 6.801.905,00               | 0,57                         |
| 1.890.000,00  | Indonesia Government Interna 3.75% 14-06-2028  | 2.485.897,75               | 0,21                         | 4.975.000,00       | Bahrain Government Internati 7% 12-10-2028     | 5.392.422,40               | 0,45                         |
| 2.735.000,00  | Ivory Coast Government Inter 5.25% 22-03-2030  | 3.159.753,71               | 0,27                         | 3.510.000,00       | Bahrain Government Internati 7.375% 14-05-2030 | 3.891.747,60               | 0,33                         |
| 3.445.000,00  | Ivory Coast Government Inter 5.875% 17-10-2031 | 4.002.689,33               | 0,34                         | 2.700.000,00       | Bahrain Government Internati 7.5% 20-09-2047   | 2.728.080,00               | 0,23                         |
| 2.444.000,00  | Ivory Coast Government Inter 6.625% 22-03-2048 | 2.744.113,29               | 0,23                         | 1.320.000,00       | Banco Nacional de Panama 2.5% 11-08-2030       | 1.237.513,20               | 0,10                         |
| 3.665.000,00  | Ivory Coast Government Inter 6.875% 17-10-2040 | 4.327.586,65               | 0,36                         | 965.000,00         | Bolivian Government Internat 4.5% 20-03-2028   | 882.975,00                 | 0,07                         |
| 1.440.000,00  | Morocco Government Internati 1.375% 30-03-2026 | 1.635.491,51               | 0,14                         | 1.800.000,00       | Brazilian Government Interna 3.875% 12-06-2030 | 1.746.000,00               | 0,15                         |
| 475.000,00  | Morocco Government Internati 1.5% 27-11-2031   | 493.773,67                 | 0,04                         | 1.450.000,00       | Brazilian Government Interna 4.5% 30-05-2029   | 1.489.875,00               | 0,13                         |
| 3.287.000,00  | Morocco Government Internati 2% 30-09-2030     | 3.615.983,71               | 0,30                         | 4.750.000,00       | Brazilian Government Interna 5.625% 07-01-2041 | 4.844.002,50               | 0,41                         |
| 1.845.000,00  | Philippine Government Intern 1.75% 28-04-2041  | 2.073.188,52               | 0,17                         | 4.410.000,00       | Brazilian Government Interna 8.25% 20-01-2034  | 5.733.000,00               | 0,48                         |
| 2.114.000,00  | Romanian Government Internat 2.75% 14-04-2041  | 2.137.744,84               | 0,18                         | 3.530.000,00       | Chile Government Internation 2.45% 31-01-2031  | 3.492.334,90               | 0,29                         |
| 1.255.000,00  | Romanian Government Internat 3.875% 29-10-2035 | 1.539.193,84               | 0,13                         | 2.870.000,00       | Chile Government Internation 2.55% 27-07-2033  | 2.795.380,00               | 0,23                         |
| 4.508.000,00  | Romanian Government Internat 4.125% 11-03-2039 | 5.452.263,97               | 0,46                         | 720.000,00         | Chile Government Internation 3.1% 07-05-2041   | 703.800,00                 | 0,06                         |
| 3.832.000,00  | Romanian Government Internat 4.625% 03-04-2049 | 4.894.790,02               | 0,41                         | 1.400.000,00       | Chile Government Internation 3.5% 25-01-2050   | 1.452.556,00               | 0,12                         |
| 1.800.000,00  | Russian Foreign Bond - Eurob 1.85% 20-11-2032  | 2.023.479,23               | 0,17                         | 1.795.000,00       | CNAC HK Finbridge Co Ltd 3.875% 19-06-2029     | 1.929.001,40               | 0,16                         |
| 1.500.000,00  | Russian Foreign Bond - Eurob 2.65% 27-05-2036  | 1.709.593,59               | 0,14                         | 2.135.000,00       | CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.125% 19-07-2027     | 2.315.095,79               | 0,19                         |
| 2.340.000,00  | Senegal Government Internati 4.75% 13-03-2028  | 2.686.976,53               | 0,23                         | 1.440.000,00       | CNAC HK Finbridge Co Ltd 5.125% 14-03-2028     | 1.643.522,77               | 0,14                         |
| 800.000,00  | Senegal Government Internati 5.375% 08-06-2037 | 858.186,25                 | 0,07                         | 755.000,00         | Colombia Government Internat 3.25% 22-04-2032  | 677.612,50                 | 0,06                         |
| 3.825.000,00  | Serbia International Bond 1.5% 26-06-2029      | 4.179.886,25               | 0,35                         | 8.390.000,00       | Colombia Government Internat 4.5% 15-03-2029   | 8.523.652,70               | 0,72                         |
| 1.415.000,00  | Serbia International Bond 1.65% 03-03-2033     | 1.490.414,61               | 0,13                         | 1.100.000,00       | Colombia Government Internat 5.625% 26-02-2044 | 1.063.810,00               | 0,09                         |
| 3.480.000,00  | Ukraine Government Internati 4.375% 27-01-2030 | 3.162.363,33               | 0,27                         | 3.680.000,00       | Colombia Government Internat 6.125% 18-01-2041 | 3.781.200,00               | 0,32                         |
| 4.360.000,00  | Ukraine Government Internati 6.75% 20-06-2026  | 4.689.618,99               | 0,39                         | 2.805.000,00       | Comision Federal de Electric 5.75% 14-02-2042  | 3.057.450,00               | 0,26                         |
|   |  | <b>72.153.094,90</b>       | <b>6,05</b>                  | 4.775.000,00       | Costa Rica Government Intern 4.25% 26-01-2023  | 4.840.656,25               | 0,41                         |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              | 3.508.000,00       | Costa Rica Government Intern 4.375% 30-04-2025 | 3.569.390,00               | 0,30                         |
| 1.180.000,00  | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline 4.6% 02-11-2047   | 1.394.870,92               | 0,12                         | 1.070.000,00       | Costa Rica Government Intern 5.625% 30-04-2043 | 914.850,00                 | 0,08                         |
| 3.680.000,00  | Abu Dhabi Government Interna 3% 15-09-2051     | 3.680.736,00               | 0,31                         | 2.325.000,00       | Costa Rica Government Intern 6.125% 19-02-2031 | 2.345.343,75               | 0,20                         |
| 8.900.000,00  | Abu Dhabi Government Interna 3.125% 16-04-2030 | 9.640.302,00               | 0,81                         | 1.720.000,00       | Development Bank of Mongolia 7.25% 23-10-2023  | 1.810.345,96               | 0,15                         |
| 2.640.000,00  | Abu Dhabi Government Interna 3.125% 30-09-2049 | 2.696.628,00               | 0,23                         | 1.600.000,00       | Dominican Republic Internati 4.5% 30-01-2030   | 1.625.616,00               | 0,14                         |
| 1.160.000,00  | Abu Dhabi Government Interna 3.875% 16-04-2050 | 1.351.065,92               | 0,11                         | 695.000,00         | Dominican Republic Internati 4.875% 23-09-2032 | 706.474,45                 | 0,06                         |
| 1.300.000,00  | Abu Dhabi Ports Co PJSC 2.5% 06-05-2031        | 1.300.598,00               | 0,11                         | 900.000,00         | Dominican Republic Internati 5.5% 27-01-2025   | 972.909,00                 | 0,08                         |
| 1.055.000,00  | Aeropuerto Internacional de 5.125% 11-08-2061  | 1.105.640,00               | 0,09                         | 1.665.000,00       | Dominican Republic Internati 5.875% 30-01-2060 | 1.598.400,00               | 0,13                         |
| 3.580.000,00  | Angolan Government Internati 8% 26-11-2029     | 3.525.440,80               | 0,30                         | 2.725.000,00       | Dominican Republic Internati 5.95% 25-01-2027  | 3.031.562,50               | 0,25                         |
| 6.977.000,00  | Angolan Government Internati 8.25% 09-05-2028  | 6.998.907,78               | 0,59                         | 1.630.000,00       | Dominican Republic Internati 6% 19-07-2028     | 1.814.206,30               | 0,15                         |
| 2.100.000,00  | Angolan Government Internati 9.125% 26-11-2049 | 2.012.346,00               | 0,17                         | 3.558.000,00       | Dominican Republic Internati 6.85% 27-01-2045  | 3.918.247,50               | 0,33                         |
| 3.455.000,00  | Angolan Government Internati 9.375% 08-05-2048 | 3.376.018,70               | 0,28                         | 5.210.000,00       | Dominican Republic Internati 6.875% 29-01-2026 | 5.934.242,10               | 0,50                         |
| 11.750.000,00   | Angolan Government Internati 9.5% 12-11-2025   | 12.561.220,00              | 1,05                         | 7.150.000,00       | DP World Ltd/United Arab Emi 6.85% 02-07-2037  | 9.401.720,90               | 0,79                         |
| 36.400.070,00   | Argentine Republic Governmen MULTI 09-07-2030  | 12.703.624,43              | 1,07                         | 3.714.520,00       | Ecuador Government Internati 31-07-2030        | 2.066.201,75               | 0,17                         |
|   |  |                            |                              | 10.624.440,00      | Ecuador Government Internati MULTI 31-07-2030  | 8.751.882,45               | 0,73                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 11.200.490,00      | Ecuador Government Internati<br>MULTI 31-07-2035   | 7.252.317,28               | 0,61                         | 2.300.000,00       | Indonesia Government Interna<br>6.625% 17-02-2037   | 3.206.407,00               | 0,27                         |
| 7.227.800,00       | Ecuador Government Internati<br>MULTI 31-07-2040   | 4.174.054,50               | 0,35                         | 935.000,00         | Indonesia Government Interna<br>6.75% 15-01-2044    | 1.384.657,25               | 0,12                         |
| 1.440.000,00       | Egypt Government Internation<br>5.8% 30-09-2027    | 1.383.206,40               | 0,12                         | 4.000.000,00       | Indonesia Government Interna<br>7.75% 17-01-2038    | 6.098.435,16               | 0,51                         |
| 1.371.000,00       | Egypt Government Internation<br>7.6003% 01-03-2029 | 1.358.880,36               | 0,11                         | 5.800.000,00       | Indonesia Government Interna<br>8.5% 12-10-2035     | 9.266.048,04               | 0,78                         |
| 4.244.000,00       | Egypt Government Internation<br>8.5% 31-01-2047    | 3.755.159,10               | 0,32                         | 1.300.000,00       | Instituto Costarricense de E<br>6.375% 15-05-2043   | 1.100.125,00               | 0,09                         |
| 2.030.000,00       | Egypt Government Internation<br>8.7002% 01-03-2049 | 1.800.731,80               | 0,15                         | 6.562.000,00       | Iraq International Bond 5.8%<br>15-01-2028          | 5.092.768,20               | 0,43                         |
| 1.805.000,00       | Egypt Government Internation<br>8.875% 29-05-2050  | 1.636.413,00               | 0,14                         | 5.490.000,00       | Iraq International Bond 6.752%<br>09-03-2023        | 5.545.284,30               | 0,47                         |
| 5.457.000,00       | Emirate of Dubai Government<br>5.25% 30-01-2043    | 6.289.170,67               | 0,53                         | 2.090.000,00       | Ivory Coast Government Inter<br>MULTI 31-12-2032    | 1.376.804,56               | 0,12                         |
| 5.740.000,00       | Eskom Holdings SOC Ltd 6.35%<br>10-08-2028         | 6.184.850,00               | 0,52                         | 5.496.000,00       | Jamaica Government Internati<br>6.75% 28-04-2028    | 6.292.920,00               | 0,53                         |
| 6.775.000,00       | Eskom Holdings SOC Ltd 6.75%<br>06-08-2023         | 6.950.621,55               | 0,58                         | 830.000,00         | Jamaica Government Internati<br>7.875% 28-07-2045   | 1.149.550,00               | 0,10                         |
| 7.627.000,00       | Eskom Holdings SOC Ltd 7.125%<br>11-02-2025        | 7.878.691,00               | 0,66                         | 3.005.000,00       | Jamaica Government Internati 8%<br>15-03-2039       | 4.161.925,00               | 0,35                         |
| 4.685.000,00       | Eskom Holdings SOC Ltd 8.45%<br>10-08-2028         | 5.037.593,10               | 0,42                         | 750.000,00         | Jordan Government Internatio<br>5.75% 31-01-2027    | 787.560,00                 | 0,07                         |
| 2.400.000,00       | Finance Department Governmen<br>4% 28-07-2050      | 2.166.816,00               | 0,18                         | 1.300.000,00       | Jordan Government Internatio<br>6.125% 29-01-2026   | 1.384.500,00               | 0,12                         |
| 2.795.000,00       | Gabon Government Internation<br>6.625% 06-02-2031  | 2.709.417,10               | 0,23                         | 3.790.000,00       | Jordan Government Internatio<br>7.375% 10-10-2047   | 3.826.914,60               | 0,32                         |
| 3.724.000,00       | Gabon Government Internation<br>6.95% 16-06-2025   | 3.863.352,08               | 0,32                         | 2.775.000,00       | Kazakhstan Government Intern<br>6.5% 21-07-2045     | 3.980.038,20               | 0,33                         |
| 2.740.000,00       | Ghana Government Internation<br>10.75% 14-10-2030  | 3.063.210,40               | 0,26                         | 3.455.000,00       | Kazakhstan Temir Zholy Finan<br>6.95% 10-07-2042    | 4.595.460,95               | 0,39                         |
| 1.540.000,00       | Ghana Government Internation<br>6.375% 11-02-2027  | 1.296.587,60               | 0,11                         | 1.220.000,00       | KazMunayGas National Co JSC<br>5.375% 24-04-2030    | 1.421.910,00               | 0,12                         |
| 4.270.000,00       | Ghana Government Internation<br>7.875% 26-03-2027  | 3.748.744,02               | 0,31                         | 2.867.000,00       | KazMunayGas National Co JSC<br>5.75% 19-04-2047     | 3.503.370,79               | 0,29                         |
| 4.510.000,00       | Ghana Government Internation<br>8.125% 18-01-2026  | 4.160.475,00               | 0,35                         | 5.965.000,00       | KazMunayGas National Co JSC<br>6.375% 24-10-2048    | 7.825.936,84               | 0,66                         |
| 200.000,00         | Ghana Government Internation<br>8.125% 26-03-2032  | 163.254,00                 | 0,01                         | 3.835.000,00       | Lebanon Government<br>International Bond 04-11-2024 | 402.675,00                 | 0,03                         |
| 1.140.000,00       | Ghana Government Internation<br>8.627% 16-06-2049  | 901.455,00                 | 0,08                         | 2.455.000,00       | Lebanon Government<br>International Bond 31-12-2099 | 252.128,50                 | 0,02                         |
| 930.000,00         | Ghana Government Internation<br>8.75% 11-03-2061   | 736.188,00                 | 0,06                         | 3.370.000,00       | Lebanon Government<br>International Bond 14-04-2099 | 346.099,00                 | 0,03                         |
| 860.000,00         | Ghana Government Internation<br>8.95% 26-03-2051   | 687.140,00                 | 0,06                         | 2.070.000,00       | Lebanon Government<br>International Bond 22-04-2031 | 207.414,00                 | 0,02                         |
| 2.050.000,00       | Gitk Europe Capital DAC 4.949%<br>18-02-2026       | 2.093.591,20               | 0,18                         | 6.595.000,00       | Lebanon Government<br>International Bond 25-05-2029 | 692.475,00                 | 0,06                         |
| 2.097.000,00       | Guatemala Government Bond<br>4.375% 05-06-2027     | 2.198.725,47               | 0,18                         | 1.840.000,00       | Lebanon Government<br>International Bond 26-02-2030 | 188.784,00                 | 0,02                         |
| 260.000,00         | Guatemala Government Bond<br>4.9% 01-06-2030       | 278.850,00                 | 0,02                         | 8.085.000,00       | Lebanon Government<br>International Bond 26-05-2023 | 848.925,00                 | 0,07                         |
| 2.675.000,00       | Guatemala Government Bond<br>6.125% 01-06-2050     | 3.062.875,00               | 0,26                         | 2.785.000,00       | Lebanon Government<br>International Bond 27-01-2023 | 287.077,80                 | 0,02                         |
| 830.000,00         | Honduras Government Internat<br>5.625% 24-06-2030  | 861.125,00                 | 0,07                         | 770.000,00         | Lebanon Government<br>International Bond 29-11-2027 | 80.850,00                  | 0,01                         |
| 3.450.000,00       | Honduras Government Internat<br>6.25% 19-01-2027   | 3.726.000,00               | 0,31                         | 650.000,00         | MDGH GMTN RSC Ltd 3.7%<br>07-11-2049                | 719.030,00                 | 0,06                         |
| 2.570.000,00       | Honduras Government Internat<br>7.5% 15-03-2024    | 2.711.350,00               | 0,23                         | 1.140.000,00       | MDGH GMTN RSC Ltd 3.7%<br>07-11-2049                | 1.261.068,00               | 0,11                         |
| 10.507.000,00      | Hungary Government Internati<br>2.125% 22-09-2031  | 10.338.888,00              | 0,87                         | 7.933.000,00       | Mexico City Airport Trust 5.5%<br>31-07-2047        | 7.944.661,51               | 0,67                         |
| 2.110.000,00       | Hungary Government Internati<br>3.125% 21-09-2051  | 2.076.940,52               | 0,17                         | 1.856.000,00       | Mexico Government Internatio<br>7.5% 08-04-2033     | 2.595.152,00               | 0,22                         |
| 3.262.000,00       | Hungary Government Internati<br>7.625% 29-03-2041  | 5.327.576,69               | 0,45                         | 1.175.000,00       | Mongolia Government Internat<br>4.45% 07-07-2031    | 1.112.384,85               | 0,09                         |
| 2.535.000,00       | ICD Funding Ltd 3.223% 28-04-<br>2026              | 2.547.218,70               | 0,21                         | 323.000,00         | Mongolia Government Internat<br>5.625% 01-05-2023   | 332.291,89                 | 0,03                         |
| 795.000,00         | Indonesia Government Interna<br>3.7% 30-10-2049    | 842.507,97                 | 0,07                         | 1.450.000,00       | Morocco Government Internati 3%<br>15-12-2032       | 1.381.908,00               | 0,12                         |
| 100.000,00         | Indonesia Government Interna<br>4.35% 08-01-2027   | 111.242,23                 | 0,01                         | 665.000,00         | Morocco Government Internati 4%<br>15-12-2050       | 602.656,25                 | 0,05                         |
| 985.000,00         | Indonesia Government Interna<br>4.625% 15-04-2043  | 1.156.550,69               | 0,10                         | 1.315.000,00       | Morocco Government Internati<br>5.5% 11-12-2042     | 1.450.050,50               | 0,12                         |
| 200.000,00         | Indonesia Government Interna<br>4.75% 18-07-2047   | 242.174,38                 | 0,02                         | 5.653.000,00       | Mozambique International Bon<br>MULTI 15-09-2031    | 4.773.958,50               | 0,40                         |
| 1.054.000,00       | Indonesia Government Interna<br>5.125% 15-01-2045  | 1.311.341,52               | 0,11                         | 1.485.000,00       | Namibia International Bonds<br>5.25% 29-10-2025     | 1.557.468,00               | 0,13                         |
| 4.430.000,00       | Indonesia Government Interna<br>5.25% 17-01-2042   | 5.541.133,35               | 0,46                         | 2.240.000,00       | Nigeria Government Internati<br>6.125% 28-09-2028   | 2.160.928,00               | 0,18                         |
| 1.600.000,00       | Indonesia Government Interna<br>5.95% 08-01-2046   | 2.213.222,80               | 0,19                         | 3.930.000,00       | Nigeria Government Internati<br>6.5% 28-11-2027     | 3.915.066,00               | 0,33                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 1.779.000,00       | Nigeria Government Internati<br>7.143% 23-02-2030 | 1.745.732,70               | 0,15                         | 2.065.000,00       | Peruvian Government Internat<br>2.844% 20-06-2030 | 2.085.237,00               | 0,17                         |
| 2.695.000,00       | Nigeria Government Internati<br>7.375% 28-09-2033 | 2.566.987,50               | 0,22                         | 4.289.000,00       | Peruvian Government Internat<br>5.625% 18-11-2050 | 6.013.178,00               | 0,50                         |
| 1.640.000,00       | Nigeria Government Internati<br>7.625% 21-11-2025 | 1.746.206,40               | 0,15                         | 2.510.000,00       | Peruvian Government Internat<br>6.55% 14-03-2037  | 3.424.292,60               | 0,29                         |
| 1.925.000,00       | Nigeria Government Internati<br>7.696% 23-02-2038 | 1.776.909,75               | 0,15                         | 3.610.000,00       | Peruvian Government Internat<br>8.75% 21-11-2033  | 5.622.575,00               | 0,47                         |
| 6.250.000,00       | Nigeria Government Internati<br>7.875% 16-02-2032 | 6.146.562,50               | 0,52                         | 3.105.000,00       | Petroleos del Peru SA 4.75%<br>19-06-2032         | 3.239.881,20               | 0,27                         |
| 6.105.000,00       | Nigeria Government Internati<br>8.747% 21-01-2031 | 6.394.377,00               | 0,54                         | 1.434.000,00       | Petroleos del Peru SA 5.625%<br>19-06-2047        | 1.419.860,76               | 0,12                         |
| 1.695.000,00       | Nigeria Government Internati<br>9.248% 21-01-2049 | 1.723.713,30               | 0,14                         | 1.675.000,00       | Petroleos Mexicanos 5.95%<br>28-01-2031           | 1.620.696,50               | 0,14                         |
| 655.000,00         | Oil and Gas Holding Co BSCC/<br>7.5% 25-10-2027   | 708.510,88                 | 0,06                         | 11.629.000,00      | Petroleos Mexicanos 6.5% 02-<br>06-2041           | 10.380.045,40              | 0,87                         |
| 5.833.000,00       | Oil and Gas Holding Co BSCC/<br>7.625% 07-11-2024 | 6.285.057,50               | 0,53                         | 21.790.000,00      | Petroleos Mexicanos 6.7% 16-<br>02-2032           | 21.956.693,50              | 1,84                         |
| 2.055.000,00       | Oil and Gas Holding Co BSCC/<br>8.375% 07-11-2028 | 2.334.993,75               | 0,20                         | 1.894.000,00       | Petroleos Mexicanos 7.69% 23-<br>01-2050          | 1.823.401,15               | 0,15                         |
| 6.518.000,00       | Oman Government Internationa<br>4.75% 15-06-2026  | 6.704.923,20               | 0,56                         | 4.110.000,00       | Petronas Capital Ltd 4.5% 18-<br>03-2045          | 5.007.088,18               | 0,42                         |
| 2.085.000,00       | Oman Government Internationa<br>4.875% 01-02-2025 | 2.168.412,51               | 0,18                         | 5.000.000,00       | Petronas Capital Ltd 4.55% 21-<br>04-2050         | 6.189.624,05               | 0,52                         |
| 7.561.000,00       | Oman Government Internationa<br>5.375% 08-03-2027 | 7.916.745,05               | 0,66                         | 2.000.000,00       | Petronas Capital Ltd 4.8% 21-<br>04-2060          | 2.643.078,42               | 0,22                         |
| 2.655.000,00       | Oman Government Internationa<br>5.625% 17-01-2028 | 2.814.300,00               | 0,24                         | 2.350.000,00       | Philippine Government Intern 5%<br>13-01-2037     | 2.919.350,62               | 0,24                         |
| 1.325.000,00       | Oman Government Internationa<br>6% 01-08-2029     | 1.425.991,50               | 0,12                         | 3.700.000,00       | Qatar Energy 3.125% 12-07-2041                    | 3.736.274,80               | 0,31                         |
| 1.230.000,00       | Oman Government Internationa<br>6.25% 25-01-2031  | 1.343.565,90               | 0,11                         | 1.300.000,00       | Qatar Government Internation<br>3.75% 16-04-2030  | 1.457.690,00               | 0,12                         |
| 2.290.000,00       | Oman Government Internationa<br>6.5% 08-03-2047   | 2.269.161,00               | 0,19                         | 6.733.000,00       | Qatar Government Internation<br>4.817% 14-03-2049 | 8.824.539,12               | 0,74                         |
| 4.460.000,00       | Oman Government Internationa<br>6.75% 17-01-2048  | 4.531.806,00               | 0,38                         | 20.225.000,00      | Qatar Government Internation<br>5.103% 23-04-2048 | 27.366.043,00              | 2,30                         |
| 5.940.000,00       | Oman Government Internationa<br>6.75% 28-10-2027  | 6.652.800,00               | 0,56                         | 1.000.000,00       | Qatar Government Internation<br>5.75% 20-01-2042  | 1.401.500,00               | 0,12                         |
| 4.245.000,00       | Oman Government Internationa<br>7.375% 28-10-2032 | 4.945.594,80               | 0,42                         | 2.925.000,00       | Republic of Cameroon Interna<br>9.5% 19-11-2025   | 3.134.137,50               | 0,26                         |
| 1.400.000,00       | Pakistan Government Internat<br>7.375% 08-04-2031 | 1.387.750,00               | 0,12                         | 2.710.000,00       | Republic of Kenya Government<br>7% 22-05-2027     | 2.858.372,50               | 0,24                         |
| 4.002.000,00       | Pakistan Government Internat<br>8.25% 15-04-2024  | 4.257.127,50               | 0,36                         | 520.000,00         | Republic of Kenya Government<br>7.25% 28-02-2028  | 559.442,00                 | 0,05                         |
| 3.176.000,00       | Pakistan Government Internat<br>8.25% 30-09-2025  | 3.430.080,00               | 0,29                         | 2.595.000,00       | Republic of Kenya Government<br>8% 22-05-2032     | 2.830.210,80               | 0,24                         |
| 2.705.000,00       | Panama Government Internatio<br>3.16% 23-01-2030  | 2.799.675,00               | 0,23                         | 453.000,00         | Republic of Kenya Government<br>8.25% 28-02-2048  | 459.772,35                 | 0,04                         |
| 3.210.000,00       | Panama Government Internatio<br>3.875% 17-03-2028 | 3.462.017,10               | 0,29                         | 2.350.000,00       | Republic of South Africa Gov 4.3%<br>12-10-2028   | 2.383.135,00               | 0,20                         |
| 1.800.000,00       | Panama Government Internatio<br>4.3% 29-04-2053   | 1.930.518,00               | 0,16                         | 4.280.000,00       | Republic of South Africa Gov<br>4.85% 30-09-2029  | 4.419.100,00               | 0,37                         |
| 2.185.000,00       | Papua New Guinea Government<br>8.375% 04-10-2028  | 2.197.017,50               | 0,18                         | 1.850.000,00       | Republic of South Africa Gov<br>5.75% 30-09-2049  | 1.776.370,00               | 0,15                         |
| 2.005.000,00       | Paraguay Government Internat<br>5.4% 30-03-2050   | 2.285.700,00               | 0,19                         | 2.005.000,00       | Republic of South Africa Gov<br>6.25% 08-03-2041  | 2.120.688,50               | 0,18                         |
| 1.000.000,00       | Pelabuhan Indonesia III Pers<br>4.875% 01-10-2024 | 1.078.780,00               | 0,09                         | 4.330.000,00       | Republic of South Africa Gov 6.3%<br>22-06-2048   | 4.492.375,00               | 0,38                         |
| 1.510.000,00       | Pertamina Persero PT 3.65%<br>30-07-2029          | 1.603.043,68               | 0,13                         | 4.600.000,00       | Republic of Uzbekistan Inter 3.9%<br>19-10-2031   | 4.402.200,00               | 0,37                         |
| 1.000.000,00       | Pertamina Persero PT 4.7% 30-<br>07-2049          | 1.093.887,11               | 0,09                         | 1.850.000,00       | Romanian Government Internat<br>3% 14-02-2031     | 1.876.110,90               | 0,16                         |
| 1.440.000,00       | Pertamina Persero PT 5.625%<br>20-05-2043         | 1.704.516,81               | 0,14                         | 2.696.000,00       | Romanian Government Internat<br>6.125% 22-01-2044 | 3.534.930,50               | 0,30                         |
| 1.150.000,00       | Pertamina Persero PT 6.5%<br>07-11-2048           | 1.536.244,42               | 0,13                         | 1.200.000,00       | Russian Foreign Bond - Eurob<br>4.25% 23-06-2027  | 1.295.280,00               | 0,11                         |
| 1.825.000,00       | Pertamina Persero PT 6.5%<br>27-05-2041           | 2.365.517,73               | 0,20                         | 8.800.000,00       | Russian Foreign Bond - Eurob<br>4.375% 21-03-2029 | 9.687.040,00               | 0,81                         |
| 3.300.000,00       | Perusahaan Perseroan Persero<br>3.375% 05-02-2030 | 3.370.125,00               | 0,28                         | 10.400.000,00      | Russian Foreign Bond - Eurob<br>5.1% 28-03-2035   | 12.260.040,00              | 1,03                         |
| 1.710.000,00       | Perusahaan Perseroan Persero<br>4.125% 15-05-2027 | 1.824.638,40               | 0,15                         | 1.000.000,00       | Russian Foreign Bond - Eurob<br>5.25% 23-06-2047  | 1.264.670,00               | 0,11                         |
| 605.000,00         | Perusahaan Perseroan Persero<br>4.875% 17-07-2049 | 648.106,25                 | 0,05                         | 6.400.000,00       | Russian Foreign Bond - Eurob<br>5.625% 04-04-2042 | 8.341.632,00               | 0,70                         |
| 1.165.000,00       | Perusahaan Perseroan Persero<br>5.25% 24-10-2042  | 1.305.464,05               | 0,11                         | 5.000.000,00       | Russian Foreign Bond - Eurob<br>5.875% 16-09-2043 | 6.800.000,00               | 0,57                         |
| 2.200.000,00       | Perusahaan Perseroan Persero<br>5.375% 25-01-2029 | 2.523.554,00               | 0,21                         | 1.000.000,00       | Saudi Government Internation<br>3.25% 22-10-2030  | 1.073.900,00               | 0,09                         |
| 385.000,00         | Perusahaan Perseroan Persero<br>5.45% 21-05-2028  | 441.017,50                 | 0,04                         | 9.920.000,00       | Saudi Government Internation<br>4.5% 26-10-2046   | 11.623.859,20              | 0,98                         |
| 990.000,00         | Perusahaan Perseroan Persero<br>6.15% 21-05-2048  | 1.221.511,50               | 0,10                         | 6.370.000,00       | Saudi Government Internation<br>4.625% 04-10-2047 | 7.625.730,84               | 0,64                         |
|                    |   |                            |                              | 4.255.000,00       | Saudi Government Internation 5%<br>17-04-2049     | 5.393.008,26               | 0,45                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal                                | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des Netto-<br>vermögens | Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2)  | % des Netto-<br>vermögens |              |
|--|----------------------------|---------------------------|--|---|---------------------------|--------------|
| 6.980.000,00 Saudi Government Internation<br>5.25% 16-01-2050  | 9.188.332,40               | 0,77                      | 1.585.000,00 Ukraine Government Internati<br>7.75% 01-09-2024      | 1.535.021,78  | 0,13                      |              |
| 1.005.000,00 Serbia International Bond 2.125%<br>01-12-2030    | 940.979,49                 | 0,08                      | 748.000,00 Ukraine Government Internati<br>7.75% 01-09-2025        | 716.920,60  | 0,06                      |              |
| 885.000,00 Sinochem Overseas Capital Co<br>6.3% 12-11-2040     | 1.193.335,87               | 0,10                      | 2.480.000,00 Ukraine Government Internati<br>7.75% 01-09-2026      | 2.363.122,56  | 0,20                      |              |
| 1.000.000,00 Sinopec Group Overseas Devel<br>3.68% 08-08-2049  | 1.065.790,37               | 0,09                      | 2.580.000,00 Ukraine Government Internati<br>7.75% 01-09-2027      | 2.444.550,00  | 0,21                      |              |
| 1.300.000,00 Sinopec Group Overseas Devel<br>4% 13-09-2047     | 1.447.051,10               | 0,12                      | 1.840.000,00 Ukraine Government Internati<br>8.994% 01-02-2024     | 1.833.640,96  | 0,15                      |              |
| 1.028.000,00 Sinopec Group Overseas Devel<br>4.25% 12-04-2047  | 1.191.485,48               | 0,10                      | 8.280.000,00 Ukraine Government Internati<br>9.75% 01-11-2028      | 8.362.236,96  | 0,70                      |              |
| 1.695.000,00 Sinopec Group Overseas Devel<br>4.875% 17-05-2042 | 2.084.280,31               | 0,17                      | 1.595.000,00 Ukraine Railways Via Rail Ca<br>8.25% 09-07-2024      | 1.567.087,50  | 0,13                      |              |
| 1.310.000,00 Sinopec Group Overseas Devel<br>5.375% 17-10-2043 | 1.726.289,15               | 0,14                      | 2.795.000,00 Ukreximbank Via Biz Finance<br>9.75% 22-01-2025       | 1.238.953,63  | 0,10                      |              |
| 6.695.000,00 Southern Gas Corridor CJSC<br>6.875% 24-03-2026   | 7.689.341,40               | 0,65                      | 4.121.000,00 Uruguay Government Internati<br>7.625% 21-03-2036     | 6.227.861,25  | 0,52                      |              |
| 515.000,00 Sri Lanka Government Interna<br>5.75% 18-04-2023    | 286.865,30                 | 0,02                      | 1.316.000,00 Uruguay Government Internati<br>7.875% 15-01-2033     | 1.944.390,00  | 0,16                      |              |
| 2.750.000,00 Sri Lanka Government Interna<br>6.2% 11-05-2027   | 1.382.865,00               | 0,12                      | 1.021.000,00 Venezuela Government<br>International Bond 07-05-2023 | 61.260,00   | 0,01                      |              |
| 1.650.000,00 Sri Lanka Government Interna<br>6.75% 18-04-2028  | 828.234,00                 | 0,07                      | 2.380.000,00 Venezuela Government<br>International Bond 31-12-2099 | 142.800,00  | 0,01                      |              |
| 2.500.000,00 Sri Lanka Government Interna<br>6.825% 18-07-2026 | 1.262.250,00               | 0,11                      | 5.665.000,00 Venezuela Government<br>International Bond 15-09-2027 | 339.900,00  | 0,03                      |              |
| 2.800.000,00 Sri Lanka Government Interna<br>6.85% 03-11-2025  | 1.431.752,00               | 0,12                      | 2.513.000,00 Venezuela Government<br>International Bond 21-10-2026 | 150.780,00  | 0,01                      |              |
| 3.700.000,00 Sri Lanka Government Interna<br>6.85% 14-03-2024  | 1.929.883,00               | 0,16                      | 1.091.600,00 Venezuela Government<br>International Bond 23-08-2022 | 65.496,00   | 0,01                      |              |
| 2.070.000,00 Sri Lanka Government Interna<br>7.55% 28-03-2030  | 1.024.650,00               | 0,09                      | 6.285.000,00 Zambia Government International<br>Bond 14-04-2024    | 4.929.765,45  | 0,41                      |              |
| 2.500.000,00 Sri Lanka Government Interna<br>7.85% 14-03-2029  | 1.252.850,00               | 0,11                      | 3.230.000,00 Zambia Government International<br>Bond 20-09-2022    | 2.412.099,40  | 0,20                      |              |
| 1.507.000,00 State Oil Co of the Azerbaij 6.95%<br>18-03-2030  | 1.814.747,48               | 0,15                      | 1.040.000,00 Zambia Government International<br>Bond 30-07-2027    | 801.773,44  | 0,07                      |              |
| 2.249.000,00 State Savings Bank of Ukrain<br>MULTI 20-03-2025  | 805.648,03                 | 0,07                      |  | <b>876.263.698,56</b>   | <b>73,53</b>              |              |
| 1.778.000,00 Syngenta Finance NV 5.182%<br>24-04-2028          | 1.997.204,23               | 0,17                      |  | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>948.416.793,46</b>     | <b>79,59</b> |
| 5.100.000,00 Third Pakistan International<br>5.625% 05-12-2022 | 5.189.760,00               | 0,44                      |  | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>948.416.793,46</b>     | <b>79,59</b> |
| 1.440.000,00 Trinidad & Tobago Government<br>4.5% 04-08-2026   | 1.472.400,00               | 0,12                      |  | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                           |              |
| 117.000,00 Trinidad Petroleum Holdings<br>9.75% 15-06-2026     | 126.945,00                 | 0,01                      |  | <b>Anleihen</b>   |                           |              |
| 2.470.000,00 Turkey Government Internatio<br>4.25% 13-03-2025  | 2.278.575,00               | 0,19                      |  | <b>USD</b>  |                           |              |
| 1.820.000,00 Turkey Government Internatio<br>4.25% 14-04-2026  | 1.627.644,20               | 0,14                      | 17.300.000,00 1MDB Global Investments Ltd<br>4.4% 09-03-2023       | 17.464.358,82   | 1,47                      |              |
| 4.908.000,00 Turkey Government Internatio<br>4.875% 09-10-2026 | 4.436.635,68               | 0,37                      | 345.000,00 Brazilian Government Interna<br>4.75% 14-01-2050        | 305.670,00  | 0,03                      |              |
| 1.750.000,00 Turkey Government Internatio<br>5.6% 14-11-2024   | 1.684.375,00               | 0,14                      | 4.250.000,00 Brazilian Government Interna 5%<br>27-01-2045         | 3.982.250,00  | 0,33                      |              |
| 2.380.000,00 Turkey Government Internatio<br>5.75% 22-03-2024  | 2.320.899,84               | 0,19                      | 9.144.000,00 Brazilian Government Interna<br>7.125% 20-01-2037     | 10.972.800,00   | 0,92                      |              |
| 1.828.000,00 Turkey Government Internatio 6%<br>14-01-2041     | 1.517.240,00               | 0,13                      | 5.215.000,00 Colombia Government Internat<br>3.875% 25-04-2027     | 5.241.075,00  | 0,44                      |              |
| 5.305.000,00 Turkey Government Internatio 6%<br>25-03-2027     | 4.994.116,39               | 0,42                      | 305.000,00 Colombia Government Internat<br>4.125% 15-05-2051       | 247.050,00  | 0,02                      |              |
| 4.325.000,00 Turkey Government Internatio<br>6.125% 24-10-2028 | 4.019.274,40               | 0,34                      | 600.000,00 Colombia Government Internat<br>5% 15-06-2045           | 540.000,00  | 0,05                      |              |
| 4.000.000,00 Turkey Government Internatio<br>6.35% 10-08-2024  | 3.927.840,00               | 0,33                      | 8.245.000,00 Colombia Government Internat<br>7.375% 18-09-2037     | 9.556.037,45  | 0,80                      |              |
| 2.414.000,00 Turkey Government Internatio<br>6.375% 14-10-2025 | 2.351.718,80               | 0,20                      | 1.810.000,00 Corp Nacional del Cobre de C<br>4.5% 01-08-2047       | 2.078.540,92  | 0,17                      |              |
| 1.380.000,00 Turkey Government Internatio<br>6.5% 20-09-2033   | 1.252.350,00               | 0,11                      | 2.120.000,00 Corp Nacional del Cobre de C<br>4.875% 04-11-2044     | 2.526.436,27  | 0,21                      |              |
| 1.840.000,00 Turkey Government Internatio<br>6.875% 17-03-2036 | 1.725.000,00               | 0,14                      | 1.365.000,00 Corp Nacional del Cobre de C<br>5.625% 18-10-2043     | 1.768.594,30  | 0,15                      |              |
| 2.529.000,00 Turkey Government Internatio<br>7.375% 05-02-2025 | 2.544.720,26               | 0,21                      | 2.100.000,00 Costa Rica Government Intern 7%<br>04-04-2044         | 2.055.375,00  | 0,17                      |              |
| 4.105.000,00 Turkey Government Internatio<br>7.625% 26-04-2029 | 4.103.423,68               | 0,34                      | 550.000,00 Dominican Republic Internati 5.3%<br>21-01-2041         | 541.750,00  | 0,05                      |              |
| 965.000,00 Türkiye İhracat Kredi Bankas<br>6.125% 03-05-2024   | 943.171,70                 | 0,08                      | 970.000,00 Dominican Republic Internati<br>5.875% 18-04-2024       | 1.014.629,70  | 0,09                      |              |
| 1.455.000,00 Türkiye İhracat Kredi Bankas<br>8.25% 24-01-2024  | 1.476.603,84               | 0,12                      | 14.140.000,00 Dominican Republic Internati<br>7.45% 30-04-2044     | 16.699.481,40   | 1,40                      |              |
| 765.000,00 Ukraine Government Internati<br>7.253% 15-03-2033   | 673.200,00                 | 0,06                      |  |   |                           |              |
| 2.430.000,00 Ukraine Government Internati<br>7.375% 25-09-2032 | 2.163.331,80               | 0,18                      |  |   |                           |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 395.000,00         | Emirate of Dubai Government 3.9% 09-09-2050   | 377.718,75                 | 0,03                         |                    |   |                            |                              |
| 1.420.000,00       | Empresa Nacional del Petrole 3.45% 16-09-2031   | 1.352.564,20               | 0,11                         |                    |   |                            |                              |
| 275.000,00         | Guatemala Government Bond 4.65% 07-10-2041  | 274.656,25                 | 0,02                         |                    |   |                            |                              |
| 4.016.000,00       | Guatemala Government Bond 4.875% 13-02-2028   | 4.311.216,16               | 0,36                         |                    |   |                            |                              |
| 1.145.000,00       | Mexico Government Internatio 4.28% 14-08-2041   | 1.182.212,50               | 0,10                         |                    |   |                            |                              |
| 2.590.000,00       | Mexico Government Internatio 4.75% 08-03-2044   | 2.807.016,10               | 0,24                         |                    |   |                            |                              |
| 5.672.000,00       | Mexico Government Internatio 5.75% 12-10-2110   | 6.489.959,12               | 0,54                         |                    |   |                            |                              |
| 830.000,00         | Mexico Government Internatio 6.05% 11-01-2040   | 1.024.269,80               | 0,09                         |                    |   |                            |                              |
| 5.400.000,00       | Pakistan Government Internat 6.875% 05-12-2027  | 5.440.500,00               | 0,46                         |                    |   |                            |                              |
| 1.000.000,00       | Pakistan Government Internat 7.875% 31-03-2036  | 966.230,00                 | 0,08                         |                    |   |                            |                              |
| 1.255.000,00       | Panama Government Internatio 3.87% 23-07-2060   | 1.251.862,50               | 0,11                         |                    |   |                            |                              |
| 3.000.000,00       | Panama Government Internatio 4.5% 01-04-2056  | 3.300.000,00               | 0,28                         |                    |   |                            |                              |
| 8.804.000,00       | Panama Government Internatio 6.7% 26-01-2036  | 11.775.350,00              | 0,99                         |                    |   |                            |                              |
| 2.160.000,00       | Panama Government Internatio 9.375% 01-04-2029  | 3.094.200,00               | 0,26                         |                    |   |                            |                              |
| 1.180.000,00       | Paraguay Government Internat 2.739% 29-01-2033  | 1.136.941,80               | 0,10                         |                    |   |                            |                              |
| 2.420.000,00       | Paraguay Government Internat 6.1% 11-08-2044  | 2.970.550,00               | 0,25                         |                    |   |                            |                              |
| 2.170.000,00       | Peruvian Government Internat 2.78% 01-12-2060   | 1.892.587,20               | 0,16                         |                    |   |                            |                              |
| 4.550.000,00       | Peruvian Government Internat 2.783% 23-01-2031  | 4.515.875,00               | 0,38                         |                    |   |                            |                              |
| 1.495.000,00       | Peruvian Government Internat 3.23% 28-07-2121   | 1.282.710,00               | 0,11                         |                    |   |                            |                              |
| 1.258.000,00       | Petroleos Mexicanos 6.625% 15-06-2035   | 1.198.245,00               | 0,10                         |                    |   |                            |                              |
| 1.930.000,00       | Philippine Government Intern 2.65% 10-12-2045   | 1.826.593,21               | 0,15                         |                    |   |                            |                              |
| 1.950.000,00       | Philippine Government Intern 2.95% 05-05-2045   | 1.923.679,11               | 0,16                         |                    |   |                            |                              |
| 2.395.000,00       | Philippine Government Intern 3% 01-02-2028  | 2.568.457,97               | 0,22                         |                    |   |                            |                              |
| 3.600.000,00       | Philippine Government Intern 3.7% 01-03-2041  | 3.932.605,37               | 0,33                         |                    |   |                            |                              |
| 640.000,00         | Philippine Government Intern 3.7% 02-02-2042  | 696.901,26                 | 0,06                         |                    |   |                            |                              |
| 2.680.000,00       | Philippine Government Intern 3.75% 14-01-2029   | 3.016.125,95               | 0,25                         |                    |   |                            |                              |
| 4.865.000,00       | Philippine Government Intern 3.95% 20-01-2040   | 5.439.804,23               | 0,46                         |                    |   |                            |                              |
| 2.700.000,00       | Philippine Government Intern 6.375% 15-01-2032  | 3.605.751,91               | 0,30                         |                    |   |                            |                              |
| 5.530.000,00       | Philippine Government Intern 7.75% 14-01-2031   | 8.049.641,81               | 0,68                         |                    |   |                            |                              |
| 2.655.000,00       | Uruguay Government Internati 4.375% 23-01-2031  | 3.057.259,05               | 0,26                         |                    |   |                            |                              |
| 3.384.000,00       | Uruguay Government Internati 4.975% 20-04-2055  | 4.432.261,68               | 0,37                         |                    |   |                            |                              |
| 5.590.000,00       | Uruguay Government Internati 5.1% 18-06-2050  | 7.386.067,00               | 0,62                         |                    |   |                            |                              |
| 3.866.600,00       | Venezuela Government International Bond 05-08-2031  | 231.996,00                 | 0,02                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>177.805.857,79</b>      | <b>14,92</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>177.805.857,79</b>      | <b>14,92</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>177.805.857,79</b>      | <b>14,92</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>       |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
|                    |   |                            |                              | 2.232.000,00       | Brazil Minas SPE via State o 5.333% 15-02-2028                          | 1.624.911,62               | 0,14                         |
|                    |   |                            |                              |                    |   | <b>1.624.911,62</b>        | <b>0,14</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>1.624.911,62</b>        | <b>0,14</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>1.624.911,62</b>        | <b>0,14</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>1.127.847.562,87</b>    | <b>94,65</b>                 |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>44.862.432,81</b>       | <b>3,76</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>                                     | <b>18.933.575,19</b>       | <b>1,59</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>1.191.643.570,87</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                         |              | Sektor               |              |
|------------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| Mexiko                       | 5,21         | Staatsanleihen       | 77,28        |
| Indonesien                   | 4,72         | Unternehmensanleihen | 17,37        |
| Russische Föderation         | 3,64         |                      |              |
| Katar                        | 3,59         | <b>Summe</b>         | <b>94,65</b> |
| Südafrika                    | 3,46         |                      |              |
| Türkei                       | 3,46         |                      |              |
| Oman                         | 3,42         |                      |              |
| Vereinigte Arabische Emirate | 3,38         |                      |              |
| Dominikanische Republik      | 3,18         |                      |              |
| Philippinen                  | 3,03         |                      |              |
| Saudi-Arabien                | 2,93         |                      |              |
| Panama                       | 2,51         |                      |              |
| Kolumbien                    | 2,49         |                      |              |
| Peru                         | 2,48         |                      |              |
| Brasilien                    | 2,44         |                      |              |
| Bahrain                      | 2,42         |                      |              |
| Angola                       | 2,39         |                      |              |
| Nigeria                      | 2,36         |                      |              |
| Ukraine                      | 2,34         |                      |              |
| Britische Jungferninseln     | 2,20         |                      |              |
| Uruguay                      | 1,93         |                      |              |
| Ecuador                      | 1,87         |                      |              |
| Ägypten                      | 1,76         |                      |              |
| Pakistan                     | 1,73         |                      |              |
| Rumänien                     | 1,63         |                      |              |
| Ungarn                       | 1,49         |                      |              |
| Argentinien                  | 1,42         |                      |              |
| Kasachstan                   | 1,40         |                      |              |
| Chile                        | 1,36         |                      |              |
| Cote D'Ivoire                | 1,31         |                      |              |
| Costa Rica                   | 1,24         |                      |              |
| Ghana                        | 1,24         |                      |              |
| Malaysia                     | 1,16         |                      |              |
| Jamaika                      | 0,97         |                      |              |
| Irak                         | 0,89         |                      |              |
| Guatemala                    | 0,85         |                      |              |
| Aserbaidschan                | 0,80         |                      |              |
| Sri Lanka                    | 0,79         |                      |              |
| Marokko                      | 0,77         |                      |              |
| Sambia                       | 0,68         |                      |              |
| Honduras                     | 0,61         |                      |              |
| Kenia                        | 0,56         |                      |              |
| Gabun                        | 0,55         |                      |              |
| Niederlande                  | 0,55         |                      |              |
| Republik Serbien             | 0,55         |                      |              |
| Paraguay                     | 0,54         |                      |              |
| Jordanien                    | 0,50         |                      |              |
| Hongkong                     | 0,49         |                      |              |
| Mosambik                     | 0,40         |                      |              |
| Usbekistan                   | 0,37         |                      |              |
| Kaimaninseln                 | 0,35         |                      |              |
| Senegal                      | 0,30         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich       | 0,30         |                      |              |
| Libanon                      | 0,28         |                      |              |
| Mongolei                     | 0,27         |                      |              |
| Kamerun                      | 0,26         |                      |              |
| Irland                       | 0,18         |                      |              |
| Papua-Neuguinea              | 0,18         |                      |              |
| Namibia                      | 0,13         |                      |              |
| Trinidad und Tobago          | 0,13         |                      |              |
| Venezuela                    | 0,08         |                      |              |
| Bolivien                     | 0,07         |                      |              |
| <b>Summe</b>                 | <b>94,65</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 7.349,04  | CHF               | 7.893,03           | USD                | 171,32   | 28.01.2022 |
| 549.870.847,50                                    | DKK               | 83.297.135,06      | USD                | 503.778,39   | 28.01.2022 |
| 446.513.091,25                                    | EUR               | 502.987.468,74     | USD                | 3.035.558,02   | 28.01.2022 |
| 1.281.292.593,01                                  | NOK               | 143.062.046,58     | USD                | 2.223.733,77   | 28.01.2022 |
| 1.671.030.529,71                                  | SEK               | 185.813.633,93     | USD                | (1.153.737,27)   | 28.01.2022 |
| 190,24  | USD               | 176,34             | CHF                | (3,26)   | 28.01.2022 |
| 2.017.063,11                                      | USD               | 13.290.581,94      | DKK                | (8.436,14)   | 28.01.2022 |
| 150.246.708,58                                    | USD               | 132.797.909,17     | EUR                | (250.137,22)   | 28.01.2022 |
| 3.980.871,86                                      | USD               | 35.764.059,37      | NOK                | (74.414,67)  | 28.01.2022 |
| 6.140.464,97                                      | USD               | 55.697.862,91      | SEK                | (14.514,14)  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>4.261.998,80</b>  |            |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                   |                    |                    |  |            |
| 85.666.891,10                                     | USD               | 75.816.836,00      | EUR                | (239.241,31)   | 19.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(239.241,31)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                   |                    |                    |  |            |
| 7.300.000,00                                      | EUR               | 8.263.482,90       | USD                | 7.962,21   | 19.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>7.962,21</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(231.279,10)</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>4.030.719,70</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>BRL</b>  |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 5.139,00  | Brazil Letras do Tesouro Nac 01-01-2024        | 747.962,54                 | 1,20                         | 100.000,00         | Serbia International Bond 1.65% 03-03-2033     | 105.329,65                 | 0,17                         |
| 3.000,00  | Brazil Letras do Tesouro Nac 01-07-2023        | 457.221,01                 | 0,73                         | 100.000,00         | Ukraine Government Internati 4.375% 27-01-2030 | 90.872,51                  | 0,15                         |
| 3.481,00  | Brazil Notas do Tesouro Naci 10% 01-01-2023    | 614.556,58                 | 0,99                         | 20.000,00          | Ukraine Government Internati 6.75% 20-06-2026  | 21.512,01                  | 0,03                         |
| 3.370,00  | Brazil Notas do Tesouro Naci 10% 01-01-2025    | 595.125,75                 | 0,96                         |                    |  | <b>2.746.710,92</b>        | <b>4,41</b>                  |
| 1.865,00  | Brazil Notas do Tesouro Naci 10% 01-01-2027    | 327.614,59                 | 0,53                         | <b>HUF</b>         |  |                            |                              |
| 935,00  | Brazil Notas do Tesouro Naci 10% 01-01-2029    | 162.808,17                 | 0,26                         | 95.000.000,00      | Hungary Government Bond 1.5% 22-04-2026        | 259.411,24                 | 0,42                         |
| 250,00  | Brazil Notas do Tesouro Naci 10% 01-01-2031    | 43.050,13                  | 0,07                         | 28.630.000,00      | Hungary Government Bond 3% 27-10-2038          | 70.211,19                  | 0,11                         |
|   |  | <b>2.948.338,77</b>        | <b>4,74</b>                  | 5.040.000,00       | Hungary Government Bond 4% 28-04-2051          | 13.403,70                  | 0,02                         |
| <b>CLP</b>  |  |                            |                              | 43.810.000,00      | Hungary Government Bond 5.5% 24-06-2025        | 139.751,50                 | 0,22                         |
| 100.000.000,00  | Bonos de la Tesoreria de la 2.3% 01-10-2028    | 96.960,66                  | 0,16                         | 66.770.000,00      | Hungary Government Bond 6.75% 22-10-2028       | 231.040,78                 | 0,37                         |
| 120.000.000,00  | Bonos de la Tesoreria de la 4.7% 01-09-2030    | 132.546,08                 | 0,21                         |                    |  | <b>713.818,41</b>          | <b>1,15</b>                  |
| 120.000.000,00  | Bonos de la Tesoreria de la 5% 01-03-2035      | 132.688,54                 | 0,21                         | <b>IDR</b>         |  |                            |                              |
|   |  | <b>362.195,28</b>          | <b>0,58</b>                  | 9.590.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 6.125% 15-05-2028      | 684.296,95                 | 1,10                         |
| <b>COP</b>  |  |                            |                              | 3.300.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 6.5% 15-06-2025        | 243.809,86                 | 0,39                         |
| 380.900.000,00  | Colombian TES 5.75% 03-11-2027                 | 84.538,27                  | 0,14                         | 1.780.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 7.5% 15-04-2040        | 130.423,01                 | 0,21                         |
| 1.229.800.000,00  | Colombian TES 6% 28-04-2028                    | 273.120,70                 | 0,44                         | 730.000.000,00     | Indonesia Treasury Bond 7.5% 15-05-2038        | 53.372,91                  | 0,09                         |
| 1.415.900.000,00  | Colombian TES 7% 30-06-2032                    | 317.136,84                 | 0,51                         | 2.280.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 7.5% 15-06-2035        | 167.570,60                 | 0,27                         |
| 775.500.000,00  | Colombian TES 7.25% 18-10-2034                 | 174.419,40                 | 0,28                         | 3.670.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 8.25% 15-05-2036       | 285.959,47                 | 0,46                         |
| 293.900.000,00  | Colombian TES 7.25% 26-10-2050                 | 62.112,55                  | 0,10                         | 2.500.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-03-2024      | 190.919,05                 | 0,31                         |
| 897.500.000,00  | Colombian TES 7.5% 26-08-2026                  | 218.929,09                 | 0,35                         | 4.420.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-03-2034      | 347.948,96                 | 0,56                         |
| 920.000.000,00  | Colombian TES 7.75% 18-09-2030                 | 220.354,08                 | 0,35                         | 3.250.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-04-2039      | 256.875,99                 | 0,41                         |
|   |  | <b>1.350.610,93</b>        | <b>2,17</b>                  | 6.050.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-09-2026      | 478.798,66                 | 0,77                         |
| <b>CZK</b>  |  |                            |                              | 3.000.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 8.75% 15-05-2031       | 242.473,08                 | 0,39                         |
| 2.820.000,00  | Czech Republic Government Bo 0.95% 15-05-2030  | 109.007,30                 | 0,18                         | 9.197.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 9% 15-03-2029          | 746.568,03                 | 1,20                         |
| 2.700.000,00  | Czech Republic Government Bo 1.2% 13-03-2031   | 105.641,43                 | 0,17                         |                    |  | <b>3.829.016,57</b>        | <b>6,15</b>                  |
| 2.820.000,00  | Czech Republic Government Bo 2% 13-10-2033     | 117.463,87                 | 0,19                         | <b>MXN</b>         |  |                            |                              |
| 6.330.000,00  | Czech Republic Government Bo 2.5% 25-08-2028   | 277.568,67                 | 0,45                         | 9.100.000,00       | International Finance Corp 23-03-2038          | 122.464,04                 | 0,20                         |
| 2.500.000,00  | Czech Republic Government Bo 2.75% 23-07-2029  | 111.358,57                 | 0,18                         | 94.746,00          | Mexican Bonos 7.5% 03-06-2027                  | 464.852,37                 | 0,75                         |
| 4.400.000,00  | Czech Republic Government Bo 4.2% 04-12-2036   | 235.456,90                 | 0,38                         | 59.731,00          | Mexican Bonos 7.75% 13-11-2042                 | 283.460,73                 | 0,46                         |
|   |  | <b>956.496,74</b>          | <b>1,54</b>                  | 38.967,00          | Mexican Bonos 7.75% 23-11-2034                 | 192.061,45                 | 0,31                         |
| <b>DOP</b>  |  |                            |                              | 34.652,00          | Mexican Bonos 8% 07-11-2047                    | 167.999,99                 | 0,27                         |
| 8.000.000,00  | Dominican Republic Internati 9.75% 05-06-2026  | 154.962,83                 | 0,25                         | 25.280,00          | Mexican Bonos 8.5% 18-11-2038                  | 129.948,01                 | 0,21                         |
|   |  | <b>154.962,83</b>          | <b>0,25</b>                  | 131.646,00         | Mexican Bonos 8.5% 31-05-2029                  | 681.233,60                 | 1,09                         |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                    |  | <b>2.042.020,19</b>        | <b>3,28</b>                  |
| 145.000,00  | Egypt Government Internation 4.75% 16-04-2026  | 158.535,32                 | 0,25                         | <b>PEN</b>         |  |                            |                              |
| 140.000,00  | Egypt Government Internation 5.625% 16-04-2030 | 143.075,44                 | 0,23                         | 448.000,00         | Peruvian Government Internat 6.95% 12-08-2031  | 120.557,84                 | 0,19                         |
| 399.000,00  | Hungary Government Internati 1.75% 05-06-2035  | 470.094,83                 | 0,76                         |                    |  | <b>120.557,84</b>          | <b>0,19</b>                  |
| 180.000,00  | Ivory Coast Government Inter 5.875% 17-10-2031 | 209.139,07                 | 0,34                         | <b>PLN</b>         |  |                            |                              |
| 170.000,00  | Ivory Coast Government Inter 6.625% 22-03-2048 | 190.875,31                 | 0,31                         | 1.100.000,00       | Republic of Poland Governmen 1.25% 25-10-2030  | 223.278,49                 | 0,36                         |
| 200.000,00  | Ivory Coast Government Inter 6.875% 17-10-2040 | 236.157,53                 | 0,38                         | 1.170.000,00       | Republic of Poland Governmen 2.5% 25-07-2027   | 267.397,65                 | 0,43                         |
| 200.000,00  | Morocco Government Internati 2% 30-09-2030     | 220.017,26                 | 0,35                         | 680.000,00         | Republic of Poland Governmen 2.75% 25-10-2029  | 156.584,52                 | 0,25                         |
| 200.000,00  | Romanian Government Internat 3.875% 29-10-2035 | 245.289,86                 | 0,39                         | 969.000,00         | Republic of Poland Governmen 3.25% 25-07-2025  | 234.520,94                 | 0,38                         |
| 226.000,00  | Romanian Government Internat 4.125% 11-03-2039 | 273.338,88                 | 0,44                         |                    |  | <b>881.781,60</b>          | <b>1,42</b>                  |
| 350.000,00  | Serbia International Bond 1.5% 26-06-2029      | 382.473,25                 | 0,61                         | <b>RON</b>         |  |                            |                              |
|   |  |                            |                              | 1.000.000,00       | Romania Government Bond 3.25% 29-04-2024       | 222.367,92                 | 0,36                         |
|   |  |                            |                              | 560.000,00         | Romania Government Bond 3.65% 24-09-2031       | 112.385,75                 | 0,18                         |
|   |  |                            |                              | 610.000,00         | Romania Government Bond 4.75% 24-02-2025       | 139.860,33                 | 0,22                         |
|   |  |                            |                              | 600.000,00         | Romania Government Bond 5% 12-02-2029          | 136.653,05                 | 0,22                         |
|   |  |                            |                              |                    |  | <b>611.267,05</b>          | <b>0,98</b>                  |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
|                    | <b>TRY</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.680.000,00       | European Investment Bank<br>05-09-2022            | 103.728,66                 | 0,17                         | 200.000,00         | Gazprom PJSC Via Gaz Capital<br>4.95% 06-02-2028    | 216.431,20                 | 0,35                         |
|                    |   | <b>103.728,66</b>          | <b>0,17</b>                  | 200.000,00         | Ghana Government Internation<br>6.375% 11-02-2027   | 168.388,00                 | 0,27                         |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              | 200.000,00         | Ghana Government Internation<br>8.627% 16-06-2049   | 158.150,00                 | 0,25                         |
| 200.000,00         | Abu Dhabi Government Interna<br>3% 15-09-2051     | 200.040,00                 | 0,32                         | 230.000,00         | Gtlk Europe Capital DAC 4.949%<br>18-02-2026        | 234.890,72                 | 0,38                         |
| 490.000,00         | Abu Dhabi Government Interna<br>3.125% 16-04-2030 | 530.758,20                 | 0,85                         | 200.000,00         | Guatemala Government Bond<br>4.375% 05-06-2027      | 209.702,00                 | 0,34                         |
| 200.000,00         | Abu Dhabi Ports Co PJSC 2.5%<br>06-05-2031        | 200.092,00                 | 0,32                         | 200.000,00         | Guatemala Government Bond<br>6.125% 01-06-2050      | 229.000,00                 | 0,37                         |
| 200.000,00         | Aeropuerto Internacional de<br>5.125% 11-08-2061  | 209.600,00                 | 0,34                         | 200.000,00         | Honduras Government Internat<br>6.25% 19-01-2027    | 216.000,00                 | 0,35                         |
| 200.000,00         | Angolan Government Internati<br>8% 26-11-2029     | 196.952,00                 | 0,32                         | 102.000,00         | Hungary Government Internati<br>7.625% 29-03-2041   | 166.588,85                 | 0,27                         |
| 400.000,00         | Angolan Government Internati<br>8.25% 09-05-2028  | 401.256,00                 | 0,64                         | 200.000,00         | Indonesia Government Interna<br>6.625% 17-02-2037   | 278.818,00                 | 0,45                         |
| 200.000,00         | Angolan Government Internati<br>9.375% 08-05-2048 | 195.428,00                 | 0,31                         | 100.000,00         | Indonesia Government Interna<br>7.75% 17-01-2038    | 152.460,88                 | 0,24                         |
| 200.000,00         | Angolan Government Internati<br>9.5% 12-11-2025   | 213.808,00                 | 0,34                         | 200.000,00         | Indonesia Government Interna<br>8.5% 12-10-2035     | 319.518,90                 | 0,51                         |
| 177.045,00         | Argentine Republic Governmen<br>1% 09-07-2029     | 63.736,20                  | 0,10                         | 350.000,00         | Iraq International Bond 5.8%<br>15-01-2028          | 271.635,00                 | 0,44                         |
| 570.701,00         | Argentine Republic Governmen<br>MULTI 09-07-2030  | 199.174,65                 | 0,32                         | 390.000,00         | Iraq International Bond 6.752%<br>09-03-2023        | 393.927,30                 | 0,63                         |
| 225.898,00         | Argentine Republic Governmen<br>MULTI 09-07-2035  | 71.722,62                  | 0,12                         | 125.000,00         | Ivory Coast Government Inter<br>MULTI 31-12-2032    | 82.344,77                  | 0,13                         |
| 975.000,00         | Argentine Republic Governmen<br>MULTI 09-07-2041  | 343.687,50                 | 0,55                         | 300.000,00         | Jamaica Government Internati<br>6.75% 28-04-2028    | 343.500,00                 | 0,55                         |
| 200.000,00         | Bahrain Government Internati<br>6.75% 20-09-2029  | 215.080,00                 | 0,35                         | 200.000,00         | Jordan Government Internatio<br>7.375% 10-10-2047   | 201.948,00                 | 0,32                         |
| 200.000,00         | Bahrain Government Internati<br>7.5% 20-09-2047   | 202.080,00                 | 0,32                         | 200.000,00         | KazMunayGas National Co JSC<br>5.375% 24-04-2030    | 233.100,00                 | 0,37                         |
| 200.000,00         | Brazilian Government Interna<br>3.875% 12-06-2030 | 194.000,00                 | 0,31                         | 200.000,00         | KazMunayGas National Co JSC<br>6.375% 24-10-2048    | 262.395,20                 | 0,42                         |
| 130.000,00         | Brazilian Government Interna<br>8.25% 20-01-2034  | 169.000,00                 | 0,27                         | 260.000,00         | Lebanon Government<br>International Bond 04-11-2024 | 27.300,00                  | 0,04                         |
| 200.000,00         | Chile Government Internation<br>2.45% 31-01-2031  | 197.866,00                 | 0,32                         | 95.000,00          | Lebanon Government<br>International Bond 31-12-2099 | 9.756,50                   | 0,02                         |
| 200.000,00         | CNAC HK Finbridge Co Ltd<br>3.875% 19-06-2029     | 214.930,52                 | 0,35                         | 290.000,00         | Lebanon Government<br>International Bond 26-05-2023 | 30.450,00                  | 0,05                         |
| 200.000,00         | Colombia Government Internat<br>4.5% 15-03-2029   | 203.186,00                 | 0,33                         | 125.000,00         | Lebanon Government<br>International Bond 27-01-2023 | 12.885,00                  | 0,02                         |
| 75.000,00          | Colombia Government Internat<br>6.125% 18-01-2041 | 77.062,50                  | 0,12                         | 120.000,00         | Lebanon Government<br>International Bond 29-11-2027 | 12.600,00                  | 0,02                         |
| 215.000,00         | Costa Rica Government Intern<br>4.25% 26-01-2023  | 217.956,25                 | 0,35                         | 300.000,00         | Mexico City Airport Trust 5.5%<br>31-07-2047        | 300.441,00                 | 0,48                         |
| 450.000,00         | Costa Rica Government Intern<br>4.375% 30-04-2025 | 457.875,00                 | 0,74                         | 120.000,00         | Mexico Government Internatio<br>7.5% 08-04-2033     | 167.790,00                 | 0,27                         |
| 200.000,00         | Development Bank of Mongolia<br>7.25% 23-10-2023  | 210.505,34                 | 0,34                         | 200.000,00         | Mozambique International Bon<br>MULTI 15-09-2031    | 168.900,00                 | 0,27                         |
| 180.000,00         | Dominican Republic Internati<br>4.5% 30-01-2030   | 182.881,80                 | 0,29                         | 300.000,00         | Nigeria Government Internati<br>7.875% 16-02-2032   | 295.035,00                 | 0,47                         |
| 200.000,00         | Dominican Republic Internati<br>5.5% 27-01-2025   | 216.202,00                 | 0,35                         | 200.000,00         | Nigeria Government Internati<br>8.747% 21-01-2031   | 209.480,00                 | 0,34                         |
| 270.000,00         | Dominican Republic Internati<br>5.95% 25-01-2027  | 300.375,00                 | 0,48                         | 250.000,00         | Oil and Gas Holding Co BSCC/<br>7.5% 25-10-2027     | 270.424,00                 | 0,43                         |
| 250.000,00         | Dominican Republic Internati<br>6.85% 27-01-2045  | 275.312,50                 | 0,44                         | 200.000,00         | Oman Government Internationa<br>4.875% 01-02-2025   | 208.001,20                 | 0,33                         |
| 200.000,00         | DP World Ltd/United Arab Emi<br>6.85% 02-07-2037  | 262.985,20                 | 0,42                         | 600.000,00         | Oman Government Internationa<br>5.375% 08-03-2027   | 628.230,00                 | 1,01                         |
| 138.532,00         | Ecuador Government Internati<br>31-07-2030        | 77.058,43                  | 0,12                         | 700.000,00         | Oman Government Internationa<br>5.625% 17-01-2028   | 742.000,00                 | 1,19                         |
| 362.215,00         | Ecuador Government Internati<br>MULTI 31-07-2030  | 298.374,61                 | 0,48                         | 200.000,00         | Oman Government Internationa<br>6% 01-08-2029       | 215.244,00                 | 0,35                         |
| 92.198,00          | Ecuador Government Internati<br>MULTI 31-07-2035  | 59.698,21                  | 0,10                         | 500.000,00         | Oman Government Internationa<br>6.75% 17-01-2048    | 508.050,00                 | 0,82                         |
| 289.105,00         | Ecuador Government Internati<br>MULTI 31-07-2040  | 166.958,14                 | 0,27                         | 300.000,00         | Pakistan Government Internat<br>8.25% 15-04-2024    | 319.125,00                 | 0,51                         |
| 200.000,00         | Emirate of Dubai Government<br>5.25% 30-01-2043   | 230.499,20                 | 0,37                         | 200.000,00         | Panama Government Internatio<br>4.3% 29-04-2053     | 214.502,00                 | 0,34                         |
| 200.000,00         | Eskom Holdings SOC Ltd 6.35%<br>10-08-2028        | 215.500,00                 | 0,35                         | 200.000,00         | Pelabuhan Indonesia III Pers<br>4.875% 01-10-2024   | 215.756,00                 | 0,35                         |
| 400.000,00         | Eskom Holdings SOC Ltd 8.45%<br>10-08-2028        | 430.104,00                 | 0,69                         | 200.000,00         | Pertamina Persero PT 4.7%<br>30-07-2049             | 218.777,42                 | 0,35                         |
| 280.000,00         | Gabon Government Internation<br>6.625% 06-02-2031 | 271.426,40                 | 0,44                         | 220.000,00         | Perusahaan Perseroan Persero<br>5.375% 25-01-2029   | 252.355,40                 | 0,41                         |
| 200.000,00         | Gabon Government Internation<br>6.95% 16-06-2025  | 207.484,00                 | 0,33                         | 45.000,00          | Peruvian Government Internat<br>5.625% 18-11-2050   | 63.090,00                  | 0,10                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 90.000,00          | Peruvian Government Internat<br>6.55% 14-03-2037  | 122.783,40                 | 0,20                         | 230.000,00         | Uruguay Government Internati<br>7.625% 21-03-2036   | 347.587,50                 | 0,56                         |
| 210.000,00         | Peruvian Government Internat<br>8.75% 21-11-2033  | 327.075,00                 | 0,53                         | 390.000,00         | Venezuela Government<br>International Bond 31-12-2099   | 23.400,00                  | 0,04                         |
| 802.000,00         | Petroleos Mexicanos 6.7% 16-<br>02-2032           | 808.135,30                 | 1,30                         | 130.300,00         | Venezuela Government<br>International Bond 23-08-2022   | 7.818,00                   | 0,01                         |
| 50.000,00          | Petroleos Mexicanos 7.69%<br>23-01-2050           | 48.136,25                  | 0,08                         | 230.000,00         | Zambia Government<br>International Bond 14-04-2024  | 180.405,10                 | 0,29                         |
| 200.000,00         | Petronas Capital Ltd 4.55%<br>21-04-2050          | 247.584,96                 | 0,40                         |                    |   | <b>27.215.272,17</b>       | <b>43,71</b>                 |
| 245.000,00         | Philippine Government Intern 5%<br>13-01-2037     | 304.357,83                 | 0,49                         |                    | <b>ZAR</b>  |                            |                              |
| 200.000,00         | Qatar Energy 3.125% 12-07-2041                    | 201.960,80                 | 0,32                         | 5.980.715,00       | Republic of South Africa Gov<br>10.5% 21-12-2026  | 414.718,00                 | 0,67                         |
| 280.000,00         | Qatar Government Internation<br>4.625% 02-06-2046 | 354.328,80                 | 0,57                         | 2.280.000,00       | Republic of South Africa Gov 7%<br>28-02-2031   | 120.157,39                 | 0,19                         |
| 205.000,00         | Qatar Government Internation<br>4.817% 14-03-2049 | 268.681,20                 | 0,43                         | 8.542.400,00       | Republic of South Africa Gov 8%<br>31-01-2030   | 493.905,94                 | 0,79                         |
| 355.000,00         | Qatar Government Internation<br>5.103% 23-04-2048 | 480.343,40                 | 0,77                         | 5.835.000,00       | Republic of South Africa Gov<br>8.5% 31-01-2037   | 308.795,95                 | 0,50                         |
| 200.000,00         | Republic of Cameroon Interna<br>9.5% 19-11-2025   | 214.300,00                 | 0,34                         | 7.680.000,00       | Republic of South Africa Gov<br>8.75% 31-01-2044  | 400.084,39                 | 0,64                         |
| 200.000,00         | Republic of South Africa Gov<br>4.85% 30-09-2029  | 206.500,00                 | 0,33                         | 11.238.300,00      | Republic of South Africa Gov<br>8.875% 28-02-2035   | 631.590,71                 | 1,01                         |
| 200.000,00         | Republic of Uzbekistan Inter<br>3.9% 19-10-2031   | 191.400,00                 | 0,31                         | 1.838.300,00       | Republic of South Africa Gov 9%<br>31-01-2040   | 99.780,45                  | 0,16                         |
| 146.000,00         | Romanian Government Internat<br>6.125% 22-01-2044 | 191.431,70                 | 0,31                         |                    |   | <b>2.469.032,83</b>        | <b>3,97</b>                  |
| 400.000,00         | Russian Foreign Bond - Eurob<br>5.1% 28-03-2035   | 471.540,00                 | 0,76                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>46.505.810,79</b>       | <b>74,69</b>                 |
| 200.000,00         | Russian Foreign Bond - Eurob<br>5.625% 04-04-2042 | 260.676,00                 | 0,42                         |                    | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>46.505.810,79</b>       | <b>74,69</b>                 |
| 200.000,00         | Russian Foreign Bond - Eurob<br>5.875% 16-09-2043 | 272.000,00                 | 0,44                         |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
| 200.000,00         | Saudi Government Internation<br>4.625% 04-10-2047 | 239.426,40                 | 0,38                         |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
| 295.000,00         | Saudi Government Internation<br>5% 17-04-2049     | 373.898,34                 | 0,60                         |                    | <b>CNY</b>  |                            |                              |
| 300.000,00         | Saudi Government Internation<br>5.25% 16-01-2050  | 394.914,00                 | 0,63                         | 3.600.000,00       | China Government Bond 2.68%<br>21-05-2030   | 555.908,54                 | 0,89                         |
| 330.000,00         | Sinopec Group Overseas Devel<br>4.875% 17-05-2042 | 405.789,09                 | 0,65                         | 6.000.000,00       | China Government Bond 2.85%<br>04-06-2027   | 950.438,04                 | 1,53                         |
| 225.000,00         | Southern Gas Corridor CJSC<br>6.875% 24-03-2026   | 258.417,00                 | 0,42                         | 4.000.000,00       | China Government Bond 3.01%<br>13-05-2028   | 636.291,23                 | 1,02                         |
| 200.000,00         | Sri Lanka Government Interna<br>6.75% 18-04-2028  | 100.392,00                 | 0,16                         | 5.000.000,00       | China Government Bond 3.13%<br>21-11-2029   | 799.746,65                 | 1,28                         |
| 245.000,00         | Sri Lanka Government Interna<br>6.85% 14-03-2024  | 127.789,55                 | 0,21                         | 2.500.000,00       | China Government Bond 3.27%<br>19-11-2030   | 405.708,93                 | 0,65                         |
| 200.000,00         | Syngenta Finance NV 4.892%<br>24-04-2025          | 214.844,92                 | 0,35                         | 3.000.000,00       | China Government Bond 3.29%<br>23-05-2029   | 483.658,02                 | 0,78                         |
| 260.000,00         | Third Pakistan International<br>5.625% 05-12-2022 | 264.576,00                 | 0,42                         | 1.500.000,00       | China Government Bond 3.81%<br>14-09-2050   | 252.265,29                 | 0,41                         |
| 37.000,00          | Trinidad Petroleum Holdings<br>9.75% 15-06-2026   | 40.145,00                  | 0,06                         |                    |   | <b>4.084.016,70</b>        | <b>6,56</b>                  |
| 385.000,00         | Turkey Government Internatio<br>4.875% 09-10-2026 | 348.024,60                 | 0,56                         |                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 200.000,00         | Turkey Government Internatio<br>6% 25-03-2027     | 188.279,60                 | 0,30                         | 200.000,00         | Philippine Government Intern<br>0.7% 03-02-2029   | 224.389,29                 | 0,36                         |
| 330.000,00         | Turkey Government Internatio<br>6.125% 24-10-2028 | 306.672,96                 | 0,49                         |                    |   | <b>224.389,29</b>          | <b>0,36</b>                  |
| 145.000,00         | Turkey Government Internatio<br>7.375% 05-02-2025 | 145.901,32                 | 0,23                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 100.000,00         | Ukraine Government Internati<br>7.75% 01-09-2025  | 95.845,00                  | 0,15                         | 1.000.000,00       | 1MDB Global Investments Ltd<br>4.4% 09-03-2023  | 1.009.500,51               | 1,62                         |
| 100.000,00         | Ukraine Government Internati<br>7.75% 01-09-2026  | 95.287,20                  | 0,15                         | 400.000,00         | Brazilian Government Interna 5%<br>27-01-2045   | 374.800,00                 | 0,60                         |
| 100.000,00         | Ukraine Government Internati<br>7.75% 01-09-2027  | 94.750,00                  | 0,15                         | 200.000,00         | Colombia Government Internat<br>4.125% 15-05-2051   | 162.000,00                 | 0,26                         |
| 265.000,00         | Ukraine Government Internati<br>8.994% 01-02-2024 | 264.084,16                 | 0,42                         | 230.000,00         | Colombia Government Internat<br>7.375% 18-09-2037   | 266.572,30                 | 0,43                         |
| 115.000,00         | Ukraine Government Internati<br>9.75% 01-11-2028  | 116.142,18                 | 0,19                         | 215.000,00         | Dominican Republic Internati<br>7.45% 30-04-2044  | 253.917,15                 | 0,41                         |
|                    |   |                            |                              | 180.000,00         | Mexico Government Internatio<br>5.75% 12-10-2110  | 205.957,80                 | 0,33                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 200.000,00         | Pakistan Government Internat<br>6.875% 05-12-2027   | 201.500,00                 | 0,32                         | 250.000,00         | Malaysia Government Bond 3,9%<br>30-11-2026                                     | 61.998,32                  | 0,10                         |
| 55.000,00          | Panama Government Internatio<br>6,7% 26-01-2036   | 73.562,50                  | 0,12                         | 1.675.000,00       | Malaysia Government Bond<br>3,955% 15-09-2025                                   | 415.095,49                 | 0,67                         |
| 105.000,00         | Panama Government Internatio<br>8,875% 30-09-2027   | 141.225,00                 | 0,23                         | 975.000,00         | Malaysia Government Bond<br>4,181% 15-07-2024                                   | 241.587,04                 | 0,39                         |
| 200.000,00         | Paraguay Government Internat<br>6,1% 11-08-2044   | 245.500,00                 | 0,39                         | 900.000,00         | Malaysia Government Bond<br>4,254% 31-05-2035                                   | 223.267,41                 | 0,36                         |
| 165.000,00         | Peruvian Government Internat<br>2,78% 01-12-2060  | 143.906,40                 | 0,23                         | 1.250.000,00       | Malaysia Government Bond<br>4,392% 15-04-2026                                   | 315.315,51                 | 0,51                         |
| 200.000,00         | Philippine Government Intern<br>2,65% 10-12-2045  | 189.284,27                 | 0,30                         | 742.000,00         | Malaysia Government Bond<br>4,762% 07-04-2037                                   | 193.708,61                 | 0,31                         |
| 200.000,00         | Philippine Government Intern 3%<br>01-02-2028   | 214.485,01                 | 0,34                         |                    | <b>PEN</b>  | <b>2.365.685,03</b>        | <b>3,80</b>                  |
| 100.000,00         | Philippine Government Intern<br>7,75% 14-01-2031  | 145.563,14                 | 0,23                         | 730.000,00         | Peruvian Government Internat<br>5,94% 12-02-2029                                | 186.981,33                 | 0,30                         |
| 125.000,00         | Uruguay Government Internati<br>5,1% 18-06-2050   | 165.162,50                 | 0,27                         | 1.080.000,00       | Peruvian Government Internat<br>6,85% 12-02-2042                                | 274.285,88                 | 0,44                         |
|                    | <b>UYU</b>  | <b>3.792.936,58</b>        | <b>6,09</b>                  | 638.000,00         | Peruvian Government Internat<br>6,9% 12-08-2037                                 | 162.590,50                 | 0,26                         |
| 4.650.000,00       | Uruguay Government Internati<br>9,875% 20-06-2022   | 105.165,94                 | 0,17                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>2.989.542,74</b>        | <b>4,80</b>                  |
|                    | <b>THB</b>  | <b>105.165,94</b>          | <b>0,17</b>                  |                    | <b>Summe sonstige übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b> | <b>2.989.542,74</b>        | <b>4,80</b>                  |
| 2.393.000,00       | Thailand Government Bond<br>1,875% 17-06-2049   | 58.105,85                  | 0,09                         |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>59.598.917,39</b>       | <b>95,72</b>                 |
| 5.790.000,00       | Thailand Government Bond<br>2,125% 17-12-2026   | 180.195,16                 | 0,29                         |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>1.962.096,91</b>        | <b>3,15</b>                  |
| 1.560.000,00       | Thailand Government Bond<br>2,875% 17-06-2046   | 47.106,51                  | 0,08                         |                    | <b>Sonstige<br/>Nettovermögenswerte</b>   | <b>700.092,65</b>          | <b>1,12</b>                  |
| 4.480.000,00       | Thailand Government Bond<br>2,875% 17-12-2028   | 144.274,12                 | 0,23                         |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>62.261.106,95</b>       | <b>100,00</b>                |
| 6.895.000,00       | Thailand Government Bond 3,3%<br>17-06-2038   | 227.105,91                 | 0,36                         |                    |   |                            |                              |
| 10.085.000,00      | Thailand Government Bond 3,4%<br>17-06-2036   | 336.154,00                 | 0,54                         |                    |   |                            |                              |
| 5.246.000,00       | Thailand Government Bond<br>3,65% 20-06-2031  | 180.755,02                 | 0,29                         |                    |   |                            |                              |
| 10.590.000,00      | Thailand Government Bond<br>3,775% 25-06-2032   | 370.973,35                 | 0,60                         |                    |   |                            |                              |
| 3.900.000,00       | Thailand Government Bond<br>4,675% 29-06-2044   | 153.247,20                 | 0,25                         |                    |   |                            |                              |
| 5.500.000,00       | Thailand Government Bond<br>4,875% 22-06-2029   | 199.138,23                 | 0,32                         |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>1.897.055,35</b>        | <b>3,05</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b> | <b>10.103.563,86</b>       | <b>16,23</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>MYR</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 250.000,00         | Malaysia Government Bond<br>3,757% 22-05-2040   | 57.292,97                  | 0,09                         |                    |   |                            |                              |
| 750.000,00         | Malaysia Government Bond<br>3,828% 05-07-2034   | 179.108,16                 | 0,29                         |                    |   |                            |                              |
| 230.000,00         | Malaysia Government Bond<br>3,844% 15-04-2033   | 55.428,73                  | 0,09                         |                    |   |                            |                              |
| 2.300.000,00       | Malaysia Government Bond<br>3,885% 15-08-2029   | 563.576,94                 | 0,91                         |                    |   |                            |                              |
| 240.000,00         | Malaysia Government Bond<br>3,892% 15-03-2027   | 59.305,85                  | 0,10                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                         |              | Sektor               |       |
|------------------------------|--------------|----------------------|-------|
| Indonesien                   | 8,46         | Staatsanleihen       | 85,29 |
| China                        | 6,56         | Unternehmensanleihen | 10,44 |
| Brasilien                    | 5,92         |                      |       |
| Mexiko                       | 5,54         |                      |       |
| Südafrika                    | 5,33         |                      |       |
| Malaysia                     | 4,20         |                      |       |
| Oman                         | 3,70         |                      |       |
| Kolumbien                    | 3,31         |                      |       |
| Thailand                     | 3,05         |                      |       |
| Vereinigte Arabische Emirate | 2,29         |                      |       |
| Britische Jungferninseln     | 2,27         |                      |       |
| Peru                         | 2,25         |                      |       |
| Dominikanische Republik      | 2,22         |                      |       |
| Ungarn                       | 2,17         |                      |       |
| Rumänien                     | 2,12         |                      |       |
| Katar                        | 2,10         |                      |       |
| Philippinen                  | 1,73         |                      |       |
| Angola                       | 1,62         |                      |       |
| Saudi-Arabien                | 1,62         |                      |       |
| Russische Föderation         | 1,61         |                      |       |
| Türkei                       | 1,59         |                      |       |
| Tschechische Republik        | 1,54         |                      |       |
| Polen                        | 1,42         |                      |       |
| Pakistan                     | 1,26         |                      |       |
| Ukraine                      | 1,25         |                      |       |
| Cote D'Ivoire                | 1,15         |                      |       |
| Bahrain                      | 1,10         |                      |       |
| Argentinien                  | 1,09         |                      |       |
| Costa Rica                   | 1,09         |                      |       |
| Irak                         | 1,07         |                      |       |
| Panama                       | 1,03         |                      |       |
| Uruguay                      | 0,99         |                      |       |
| Ecuador                      | 0,97         |                      |       |
| Chile                        | 0,90         |                      |       |
| Nigeria                      | 0,81         |                      |       |
| Kasachstan                   | 0,80         |                      |       |
| Republik Serbien             | 0,78         |                      |       |
| Gabun                        | 0,77         |                      |       |
| Guatemala                    | 0,70         |                      |       |
| Jamaika                      | 0,55         |                      |       |
| Ghana                        | 0,52         |                      |       |
| Ägypten                      | 0,48         |                      |       |
| Aserbaidschan                | 0,42         |                      |       |
| Paraguay                     | 0,39         |                      |       |
| Irland                       | 0,38         |                      |       |
| Sri Lanka                    | 0,37         |                      |       |
| Länderübergreifend           | 0,36         |                      |       |
| Honduras                     | 0,35         |                      |       |
| Hongkong                     | 0,35         |                      |       |
| Luxemburg                    | 0,35         |                      |       |
| Marokko                      | 0,35         |                      |       |
| Niederlande                  | 0,35         |                      |       |
| Kamerun                      | 0,34         |                      |       |
| Mongolei                     | 0,34         |                      |       |
| Jordanien                    | 0,32         |                      |       |
| Usbekistan                   | 0,31         |                      |       |
| Sambia                       | 0,29         |                      |       |
| Mosambik                     | 0,27         |                      |       |
| Libanon                      | 0,15         |                      |       |
| Trinidad und Tobago          | 0,06         |                      |       |
| Venezuela                    | 0,05         |                      |       |
| <b>Summe</b>                 | <b>95,72</b> |                      |       |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswahrung (USD) | Felligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 10.441.870,45                                     | DKK                | 1.581.773,05      | USD                  | 9.579,33  | 28.01.2022  |
| 2.046.849,42                                      | NOK                | 228.572,90        | USD                  | 3.519,41  | 28.01.2022  |
| 169.841.469,10                                    | SEK                | 18.887.388,95     | USD                  | (118.786,17)  | 28.01.2022  |
| 1.583.413,72                                      | USD                | 10.441.870,45     | DKK                  | (7.938,74)  | 28.01.2022  |
| 7.992,86  | USD                | 72.029,19         | NOK                  | (174,52)  | 28.01.2022  |
| 6.830.922,44                                      | USD                | 62.152.390,97     | SEK                  | (37.323,50)   | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(151.124,19)</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 2.364.848,00                                      | MYR                | 556.382,46        | USD                  | 11.369,03   | 19.01.2022  |
| 150.000,00  | USD                | 2.165.055.000,00  | IDR                  | (2.319,90)  | 19.01.2022  |
| 300.364,22  | USD                | 1.270.000,00      | MYR                  | (3.897,28)  | 09.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>5151,85</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 38.953.579,00                                     | HUF                | 125.386,69        | USD                  | (6.099,38)  | 19.01.2022  |
| 458.109,49  | USD                | 2.932.612,00      | CNH                  | (2.527,28)  | 19.01.2022  |
| 197.121,51  | USD                | 62.912.522,00     | HUF                  | 4.465,02  | 19.01.2022  |
| 296.511,74  | USD                | 1.723.000,00      | BRL                  | (7.722,39)  | 09.03.2022  |
| 149.361,81  | USD                | 602.123.000,00    | COP                  | 2.603,94  | 09.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(9.280,09)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 200.000,00  | USD                | 1.280.594,60      | CNH                  | (1.147,97)  | 19.01.2022  |
| 4.429.385,89                                      | USD                | 3.809.074,00      | EUR                  | 113.417,43  | 19.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>112.269,46</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 165.137.507,00                                    | CLP                | 194.806,54        | USD                  | (1.395,78)  | 19.01.2022  |
| 19.142.931,00                                     | CZK                | 872.113,72        | USD                  | (1.966,50)  | 19.01.2022  |
| 2.620.217,00                                      | PHP                | 51.619,72         | USD                  | (568,30)  | 19.01.2022  |
| 260.798,52  | USD                | 5.800.000,00      | CZK                  | (2.841,99)  | 19.01.2022  |
| 618.400,38  | USD                | 8.974.906.490,00  | IDR                  | (13.018,46)   | 19.01.2022  |
| 93.213,54   | USD                | 400.000,00        | RON                  | 1.792,27  | 19.01.2022  |
| 36.540,88   | USD                | 587.954,00        | ZAR                  | (223,83)  | 19.01.2022  |
| 2.761.990,00                                      | TRY                | 144.870,20        | USD                  | 48.881,85   | 09.03.2022  |
| 171.721,51  | USD                | 3.826.000,00      | CZK                  | (1.384,81)  | 09.03.2022  |
| 116.036,35  | USD                | 37.957.000,00     | HUF                  | 369,57  | 09.03.2022  |
| 322.310,06  | USD                | 10.874.000,00     | THB                  | (3.702,02)  | 09.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>25.942,00</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                    |                   |                      |   |             |
| 253.628.391,00                                    | COP                | 63.903,47         | USD                  | (1.757,49)  | 19.01.2022  |
| 81.185.897,50                                     | HUF                | 250.000,00        | USD                  | (1.385,22)  | 19.01.2022  |
| 12.787.558,00                                     | MXN                | 596.800,34        | USD                  | 26.798,46   | 19.01.2022  |
| 5.892.520,00                                      | PLN                | 1.493.067,79      | USD                  | (42.681,52)   | 19.01.2022  |
| 201.409.886,00                                    | RUB                | 2.702.363,14      | USD                  | (35.041,50)   | 19.01.2022  |
| 29.185.417,00                                     | THB                | 860.952,15        | USD                  | 14.597,94   | 19.01.2022  |
| 50.000,00   | USD                | 207.547,63        | PLN                  | (1.085,75)  | 19.01.2022  |
| 100.000,00  | USD                | 7.520.643,04      | RUB                  | 402,28  | 19.01.2022  |
| 9.975.000,00                                      | MXN                | 473.396,27        | USD                  | 8.787,44  | 09.03.2022  |
| 11.508.000,00                                     | THB                | 342.959,32        | USD                  | 2.060,86  | 09.03.2022  |
| 109.173,07  | USD                | 480.000,00        | RON                  | 14,43   | 09.03.2022  |
| 296.292,26  | USD                | 22.220.000,00     | RUB                  | 5.548,15  | 09.03.2022  |
| 2.395.000,00                                      | ZAR                | 149.611,40        | USD                  | (882,75)  | 09.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(24.624,67)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: HSBC Continental Europe SA</b>    |                    |                   |                      |   |             |
| 62.324.712,70                                     | HUF                | 197.000,00        | USD                  | (6.143,51)  | 19.01.2022  |
| 1.463.768,00                                      | TRY                | 103.300,79        | USD                  | 3.990,59  | 19.01.2022  |
| 82.377,91   | USD                | 328.000,00        | PLN                  | 1.643,93  | 19.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(508,99)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| 1.204.319,39                                      | CZK                | 54.200,00         | USD                  | 542,66  | 19.01.2022  |
| 2.317.991,00                                      | RON                | 539.605,40        | USD                  | (9.821,19)  | 19.01.2022  |
| 50.000,00   | USD                | 198.978,80        | PLN                  | 1.023,33  | 19.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(8.255,20)</b>   |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                       | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 1.121.000,00                            | EUR               | 1.273.222,83       | USD                | (1.766,39)   | 09.03.2022 |
| 4.875.922.000,00                        | IDR               | 341.834,13         | USD                | (162,15)   | 09.03.2022 |
| 360.190,61                              | USD               | 2.313.000,00       | CNY                | (1.667,77)   | 09.03.2022 |
| 349.116,95                              | USD               | 4.994.118.000,00   | IDR                | (837,12)   | 09.03.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(4.433,43)</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>96.260,93</b>   |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(54.863,26)</b>   |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapiieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 800.000,00  | Ivory Coast Government Inter 6.875% 17-10-2040  | 944.630,10                 | 0,42                         |                    |   |                            |                              |
|   |   | <b>944.630,10</b>          | <b>0,42</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.200.000,00  | Access Bank PLC 6.125% 21-09-2026               | 1.194.000,00               | 0,54                         | 530.000,00         | Egypt Government Internation 7.6003% 01-03-2029 | 525.314,80                 | 0,24                         |
| 900.000,00  | Acwa Power Management And In 5.95% 15-12-2039   | 1.064.473,65               | 0,48                         | 1.000.000,00       | Egypt Government Internation 7.6003% 01-03-2029 | 991.160,00                 | 0,44                         |
| 1.100.000,00  | Adani International Containe 3% 16-02-2031      | 1.039.925,04               | 0,47                         | 650.000,00         | El Salvador Government Inter 5.875% 30-01-2025  | 409.500,00                 | 0,18                         |
| 525.000,00  | AES Argentina Generacion SA 7.75% 02-02-2024    | 436.138,50                 | 0,20                         | 1.400.000,00       | Embraer Netherlands Finance 6.95% 17-01-2028    | 1.545.600,00               | 0,69                         |
| 1.250.000,00  | Al Candelaria Spain SA 7.5% 15-12-2028          | 1.334.662,50               | 0,60                         | 1.750.000,00       | Empresa Generadora de Electr 5.625% 08-11-2028  | 1.763.125,00               | 0,79                         |
| 1.750.000,00  | Alfa Desarrollo SpA 4.55% 27-09-2051            | 1.727.250,00               | 0,77                         | 1.300.000,00       | Empresas Publicas de Medellin 4.375% 15-02-2031 | 1.222.013,00               | 0,55                         |
| 1.450.000,00  | Alsea SAB de CV 7.75% 14-12-2026                | 1.500.677,50               | 0,67                         | 1.600.000,00       | Energean Israel Finance Ltd 5.875% 30-03-2031   | 1.567.616,00               | 0,70                         |
| 1.400.000,00  | AngloGold Ashanti Holdings P 3.375% 01-11-2028  | 1.386.980,00               | 0,62                         | 1.800.000,00       | Energean PLC 6.5% 30-04-2027                    | 1.786.500,00               | 0,80                         |
| 500.000,00  | AngloGold Ashanti Holdings P 3.75% 01-10-2030   | 503.490,00                 | 0,23                         | 1.900.000,00       | Equate Petrochemical BV 2.625% 28-04-2028       | 1.902.337,00               | 0,85                         |
| 1.550.000,00  | Angolan Government Internati 9.5% 12-11-2025    | 1.657.012,00               | 0,74                         | 1.400.000,00       | Falabella SA 3.375% 15-01-2032                  | 1.386.000,00               | 0,62                         |
| 3.324.430,00  | Argentine Republic Governmen MULTI 09-07-2030   | 1.160.226,07               | 0,52                         | 400.000,00         | First Quantum Minerals Ltd 7.5% 01-04-2025      | 411.480,00                 | 0,18                         |
| 800.000,00  | Aydem Yenilenebilir Enerji A 7.75% 02-02-2027   | 643.984,00                 | 0,29                         | 2.100.000,00       | Galaxy Pipeline Assets Bidco 1.75% 30-09-2027   | 2.057.190,04               | 0,92                         |
| 1.100.000,00  | Baidu Inc 3.075% 07-04-2025                     | 1.140.554,97               | 0,51                         | 980.000,00         | Galaxy Pipeline Assets Bidco 2.16% 31-03-2034   | 960.255,54                 | 0,43                         |
| 1.200.000,00  | Banco do Brasil SA/Cay 9.000% MULTI Perp FC2024 | 1.278.996,00               | 0,57                         | 1.250.000,00       | GC Treasury Center Co Ltd 2.98% 18-03-2031      | 1.262.348,45               | 0,57                         |
| 1.400.000,00  | Banco GNB Sudameris SA 7.500% MULTI 16-04-2031  | 1.389.500,00               | 0,62                         | 715.000,00         | Gennea SA 8.75% 02-09-2027                      | 674.960,00                 | 0,30                         |
| 1.200.000,00  | Banco Mercantil del No 5.875% MULTI Perp FC2027 | 1.195.500,00               | 0,54                         | 1.600.000,00       | Ghana Government Internation 7.625% 16-05-2029  | 1.331.680,00               | 0,60                         |
| 700.000,00  | Bancolumbia SA 3% 29-01-2025                    | 702.620,33                 | 0,31                         | 1.300.000,00       | Golden Eagle Retail Group Lt 4.625% 21-05-2023  | 1.300.000,00               | 0,58                         |
| 1.500.000,00  | Bangkok Bank PCL/Hong K 3.466% MULTI 23-09-2036 | 1.501.820,27               | 0,67                         | 1.500.000,00       | Guara Norte Sarl 5.198% 15-06-2034              | 1.426.730,43               | 0,64                         |
| 1.600.000,00  | Bank Mandiri Persero Tbk PT 4.75% 13-05-2025    | 1.742.699,94               | 0,78                         | 600.000,00         | Huarong Finance 2019 Co Ltd 2.125% 30-09-2023   | 590.250,00                 | 0,26                         |
| 1.800.000,00  | Bidvest Group UK PLC/The 3.625% 23-09-2026      | 1.789.020,00               | 0,80                         | 900.000,00         | Huarong Finance II Co Ltd 5% 19-11-2025         | 933.750,00                 | 0,42                         |
| 1.100.000,00  | Braskem Idesa SAPI 6.99% 20-02-2032             | 1.089.011,00               | 0,49                         | 620.000,00         | ICL Group Ltd 6.375% 31-05-2038                 | 795.150,00                 | 0,36                         |
| 1.600.000,00  | Braskem Netherlands Finance 5.875% 31-01-2050   | 1.865.200,00               | 0,84                         | 2.350.000,00       | IHS Netherlands Holdco BV 8% 18-09-2027         | 2.486.347,00               | 1,11                         |
| 1.000.000,00  | BRF SA 5.75% 21-09-2050                         | 995.000,00                 | 0,45                         | 1.600.000,00       | Indofood CBP Sukses Makmur T 3.398% 09-06-2031  | 1.612.314,27               | 0,72                         |
| 1.400.000,00  | Canacol Energy Ltd 5.75% 24-11-2028             | 1.393.000,00               | 0,62                         | 900.000,00         | Indofood CBP Sukses Makmur T 4.745% 09-06-2051  | 924.744,44                 | 0,41                         |
| 550.000,00  | Chile Government Internation 2.55% 27-07-2033   | 535.700,00                 | 0,24                         | 1.750.000,00       | Infraestructura Energetica N 4.75% 15-01-2051   | 1.734.687,50               | 0,78                         |
| 1.350.000,00  | CIBANCO SA Institucion de Ba 4.375% 22-07-2031  | 1.293.529,50               | 0,58                         | 500.000,00         | Infraestructura Energetica N 4.875% 14-01-2048  | 505.630,00                 | 0,23                         |
| 1.400.000,00  | CIFI Holdings Group Co Ltd 4.45% 17-08-2026     | 1.295.000,00               | 0,58                         | 1.200.000,00       | Inkia Energy Ltd 5.875% 09-11-2027              | 1.248.000,00               | 0,56                         |
| 400.000,00  | Colombia Government Internat 6.125% 18-01-2041  | 411.000,00                 | 0,18                         | 800.000,00         | Interchile SA 4.5% 30-06-2056                   | 850.000,00                 | 0,38                         |
| 425.000,00  | Cometa Energia SA de CV 6.375% 24-04-2035       | 435.087,91                 | 0,19                         | 1.630.000,00       | Inversiones CMPC SA 4.75% 15-09-2024            | 1.740.840,00               | 0,78                         |
| 1.200.000,00  | Corp Inmobiliaria Vesta SAB 3.625% 13-05-2031   | 1.176.000,00               | 0,53                         | 700.000,00         | JD.com Inc 3.875% 29-04-2026                    | 749.130,78                 | 0,34                         |
| 750.000,00  | Credit Bank of Moscow 7.625% MULTI Perp FC2027  | 693.570,00                 | 0,31                         | 1.300.000,00       | Kasikornbank PCL/Hong 5.275% MULTI Perp FC2025  | 1.361.750,00               | 0,61                         |
| 1.200.000,00  | Credit Bank of Moscow Via CB 3.875% 21-09-2026  | 1.131.000,00               | 0,51                         | 600.000,00         | Kosmos Energy Ltd 7.125% 04-04-2026             | 581.280,00                 | 0,26                         |
| 1.050.000,00  | Credivalores-Crediservicios 8.875% 07-02-2025   | 777.735,00                 | 0,35                         | 1.850.000,00       | Kosmos Energy Ltd 7.75% 01-05-2027              | 1.762.125,00               | 0,79                         |
| 2.100.000,00  | CSN Resources SA 4.625% 10-06-2031              | 1.997.625,00               | 0,90                         | 1.550.000,00       | Kuwait Projects Co SPC Ltd 4.229% 29-10-2026    | 1.458.550,00               | 0,65                         |
| 1.511.000,00  | Delek Overriding Royalty Lev 7.494% 30-12-2023  | 1.555.121,20               | 0,70                         | 750.000,00         | Leviathan Bond Ltd 6.5% 30-06-2027              | 803.340,00                 | 0,36                         |
| 1.500.000,00  | Eastern & Southern African T 4.125% 30-06-2028  | 1.488.750,00               | 0,67                         | 1.000.000,00       | Leviathan Bond Ltd 6.75% 30-06-2030             | 1.072.820,00               | 0,48                         |
| 2.100.000,00  | Ecopetrol SA 4.625% 02-11-2031                  | 2.041.620,00               | 0,91                         | 1.000.000,00       | Lima Metro Line 2 Finance Lt 4.35% 05-04-2036   | 1.032.196,54               | 0,46                         |
| 915.000,00  | Ecopetrol SA 5.875% 28-05-2045                  | 876.194,85                 | 0,39                         | 900.000,00         | Limak Iskenderun Uluslararası 9.5% 10-07-2036   | 826.520,40                 | 0,37                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 400.000,00         | Medco Bell Pte Ltd 6.375% 30-01-2027            | 398.900,00                 | 0,18                         | 1.300.000,00       | SEPLAT Energy PLC 7.75% 01-04-2026  | 1.296.100,00               | 0,58                         |
| 1.800.000,00       | Medco Laurel Tree Pte Ltd 6.95% 12-11-2028      | 1.785.083,04               | 0,80                         | 1.800.000,00       | Shriram Transport Finance Co 4.4% 13-03-2024  | 1.822.500,00               | 0,82                         |
| 750.000,00         | MEGlobal Canada ULC 5% 18-05-2025               | 817.522,50                 | 0,37                         | 1.100.000,00       | Simpar Europe SA 5.2% 26-01-2031  | 1.025.761,00               | 0,46                         |
| 1.400.000,00       | Melco Resorts Finance Ltd 5.75% 21-07-2028      | 1.372.000,00               | 0,61                         | 1.600.000,00       | Sovcombank Via SovCom 7.600% MULTI Perp FC2027  | 1.534.800,00               | 0,69                         |
| 730.000,00         | MercadoLibre Inc 3.125% 14-01-2031              | 689.857,30                 | 0,31                         | 1.050.000,00       | Star Energy Geothermal Daraj 4.85% 14-10-2038   | 1.160.250,00               | 0,52                         |
| 1.600.000,00       | Metinvest BV 7.75% 17-10-2029                   | 1.576.000,00               | 0,71                         | 200.000,00         | Studio City Finance Ltd 5% 15-01-2029   | 179.000,00                 | 0,08                         |
| 1.200.000,00       | Mexico Remittances Funding F 4.875% 15-01-2028  | 1.119.012,00               | 0,50                         | 1.300.000,00       | Studio City Finance Ltd 6% 15-07-2025   | 1.264.250,00               | 0,57                         |
| 500.000,00         | Minejesa Capital BV 4.625% 10-08-2030           | 512.880,00                 | 0,23                         | 1.000.000,00       | Studio City Finance Ltd 6.5% 15-01-2028   | 960.000,00                 | 0,43                         |
| 800.000,00         | Minejesa Capital BV 5.625% 10-08-2037           | 836.000,00                 | 0,37                         | 1.200.000,00       | Suzano Austria GmbH 3.125% 15-01-2032   | 1.173.564,00               | 0,53                         |
| 1.000.000,00       | Modern Land China Co Ltd 11-04-2023             | 195.000,00                 | 0,09                         | 1.239.000,00       | Tecpetrol SA 4.875% 12-12-2022  | 1.240.765,58               | 0,56                         |
| 930.000,00         | Modern Land China Co Ltd 13-11-2022             | 181.350,00                 | 0,08                         | 1.625.000,00       | Telecom Argentina SA 8.5% 06-08-2025  | 1.570.172,50               | 0,70                         |
| 1.980.000,00       | Mong Duong Finance Holdings 5.125% 07-05-2029   | 1.918.125,00               | 0,86                         | 800.000,00         | Telefonica Celular del Parag 5.875% 15-04-2027  | 828.000,00                 | 0,37                         |
| 2.000.000,00       | Movida Europe SA 5.25% 08-02-2031               | 1.845.020,00               | 0,83                         | 1.700.000,00       | Telefonica Moviles Chile SA 3.537% 18-11-2031   | 1.692.775,00               | 0,76                         |
| 1.005.000,00       | Muang Thai Life Assuran 3.552% MULTI 27-01-2037 | 1.012.270,76               | 0,45                         | 1.450.000,00       | TMBThanachart Bank PCL 4.900% MULTI Perp FC2024   | 1.460.794,25               | 0,65                         |
| 1.200.000,00       | Muthoot Finance Ltd 4.4% 02-09-2023             | 1.224.000,00               | 0,55                         | 1.650.000,00       | Total Play Telecomunicacione 6.375% 20-09-2028  | 1.551.000,00               | 0,70                         |
| 1.990.000,00       | MV24 Capital BV 6.748% 01-06-2034               | 1.851.040,55               | 0,83                         | 1.700.000,00       | Trust Fibra Uno 5.25% 30-01-2026  | 1.861.500,00               | 0,83                         |
| 1.200.000,00       | NBK Tier 1 Financing 2 4.500% MULTI Perp FC2025 | 1.222.080,00               | 0,55                         | 2.300.000,00       | TSMC Arizona Corp 2.5% 25-10-2031   | 2.331.299,94               | 1,04                         |
| 1.000.000,00       | Network I2i Ltd 5.650% MULTI Perp FC2025        | 1.050.000,00               | 0,47                         | 2.300.000,00       | Tullow Oil PLC 10.25% 15-05-2026  | 2.322.999,98               | 1,04                         |
| 1.650.000,00       | New Metro Global Ltd 4.5% 02-05-2026            | 1.401.562,97               | 0,63                         | 950.000,00         | Turk Telekomunikasyon AS 6.875% 28-02-2025  | 961.666,00                 | 0,43                         |
| 1.900.000,00       | Nigeria Government Internati 7.375% 28-09-2033  | 1.809.750,00               | 0,81                         | 700.000,00         | Turkiye Ihracat Kredi Bankas 5.75% 06-07-2026   | 640.948,00                 | 0,29                         |
| 2.170.000,00       | Oi SA 27-07-2025                                | 1.904.196,70               | 0,85                         | 1.600.000,00       | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO 5.5% 01-10-2026  | 1.420.953,60               | 0,64                         |
| 1.250.000,00       | Ooredoo International Financ 2.625% 08-04-2031  | 1.254.687,50               | 0,56                         | 1.350.000,00       | Ukraine Government Internati 9.75% 01-11-2028   | 1.363.408,20               | 0,61                         |
| 1.700.000,00       | OQ SAOC 5.125% 06-05-2028                       | 1.727.710,00               | 0,77                         | 780.000,00         | Ukraine Government Internati MULTI 31-05-2040   | 709.020,00                 | 0,32                         |
| 1.250.000,00       | Oryx Funding Ltd 5.8% 03-02-2031                | 1.323.000,00               | 0,59                         | 2.184.000,00       | Ukreximbank Via Biz Finance 9.75% 22-01-2025  | 968.112,60                 | 0,43                         |
| 2.250.000,00       | Pampa Energia SA 7.5% 24-01-2027                | 1.938.150,00               | 0,87                         | 1.300.000,00       | Unifin Financiera SAB de CV 8.375% 27-01-2028   | 1.075.750,00               | 0,48                         |
| 1.270.000,00       | Peruvian Government Internat 3% 15-01-2034      | 1.266.825,00               | 0,57                         | 2.370.000,00       | Vale Overseas Ltd 3.75% 08-07-2030  | 2.452.973,70               | 1,10                         |
| 700.000,00         | Petroleos Mexicanos 6.7% 16-02-2032             | 705.355,00                 | 0,32                         | 600.000,00         | Vedanta Resources Finance II 13.875% 21-01-2024   | 635.999,95                 | 0,29                         |
| 1.570.000,00       | Petroleos Mexicanos 7.69% 23-01-2050            | 1.511.478,25               | 0,68                         | 1.600.000,00       | Vedanta Resources Finance II 8.95% 11-03-2025   | 1.560.000,00               | 0,70                         |
| 1.550.000,00       | Power Finance Corp Ltd 3.75% 06-12-2027         | 1.624.140,55               | 0,73                         | 650.000,00         | YPF SA MULTI 12-02-2026   | 518.505,00                 | 0,23                         |
| 2.050.000,00       | Powerlong Real Estate Holdin 5.95% 30-04-2025   | 1.707.635,47               | 0,77                         | 3.465.000,00       | YPF SA MULTI 30-06-2029   | 2.050.846,88               | 0,92                         |
| 330.000,00         | Powerlong Real Estate Holdin 6.25% 10-08-2024   | 281.889,10                 | 0,13                         |                    |   | <b>189.669.535,16</b>      | <b>85,00</b>                 |
| 650.000,00         | Promigas SA ESP / Gases del 3.75% 16-10-2029    | 637.975,00                 | 0,29                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>190.614.165,26</b>      | <b>85,42</b>                 |
| 1.500.000,00       | Prosus NV 3.832% 08-02-2051                     | 1.398.825,56               | 0,63                         |                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>190.614.165,26</b>      | <b>85,42</b>                 |
| 1.960.000,00       | Qatar Energy 1.375% 12-09-2026                  | 1.920.760,80               | 0,86                         |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
| 1.300.000,00       | Qatar Energy 2.25% 12-07-2031                   | 1.287.109,20               | 0,58                         |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
| 1.450.000,00       | QNB Finansbank AS 6.875% 07-09-2024             | 1.471.750,00               | 0,66                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 1.500.000,00       | Ras Laffan Liquefied Natural 5.838% 30-09-2027  | 1.540.896,00               | 0,69                         | 1.100.000,00       | Banco do Estado do Rio 5.375% MULTI 28-01-2031  | 1.069.332,00               | 0,48                         |
| 2.100.000,00       | ReNew Wind Energy AP2 / ReNe 4.5% 14-07-2028    | 2.107.436,96               | 0,94                         | 1.600.000,00       | Banco Mercantil del No 6.625% MULTI Perp FC2032   | 1.592.800,00               | 0,71                         |
| 1.200.000,00       | Resorts World Las Vegas LLC 4.625% 06-04-2031   | 1.190.137,45               | 0,53                         | 1.700.000,00       | Banistmo SA 4.25% 31-07-2027  | 1.727.642,00               | 0,77                         |
| 1.350.000,00       | Rumo Luxembourg Sarl 4.2% 18-01-2032            | 1.274.062,50               | 0,57                         | 1.000.000,00       | Cibanco SA Ibm / PLA Adminis 4.962% 18-07-2029  | 1.080.010,00               | 0,48                         |
| 1.500.000,00       | Sagicor Financial Co Ltd 5.3% 13-05-2028        | 1.539.750,00               | 0,69                         |                    |   |                            |                              |
| 1.300.000,00       | Sands China Ltd 4.375% 18-06-2030               | 1.324.349,00               | 0,59                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 2.604.790,00       | Digicel Group Holdings Ltd 01-04-2024   | 2.540.419,85               | 1,14                         |
| 1.575.000,00       | First Quantum Minerals Ltd 6.875% 15-10-2027  | 1.695.093,75               | 0,76                         |
| 1.700.000,00       | Interconexion Electrica SA E 3.825% 26-11-2033  | 1.743.350,03               | 0,78                         |
| 1.350.000,00       | New Fortress Energy Inc 6.5% 30-09-2026   | 1.339.875,00               | 0,60                         |
| 1.449.000,00       | Petroleos Mexicanos 6.7% 16-02-2032   | 1.460.084,85               | 0,65                         |
|                    |   | <b>14.248.607,48</b>       | <b>6,39</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>14.248.607,48</b>       | <b>6,39</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>14.248.607,48</b>       | <b>6,39</b>                  |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 850.000,00         | AES Panama Generation Holdin 4.375% 31-05-2030  | 892.806,00                 | 0,40                         |
|                    |   | <b>892.806,00</b>          | <b>0,40</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>892.806,00</b>          | <b>0,40</b>                  |
|                    | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                     | <b>892.806,00</b>          | <b>0,40</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>205.755.578,74</b>      | <b>92,21</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>13.008.145,23</b>       | <b>5,83</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>4.375.572,83</b>        | <b>1,96</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>223.139.296,80</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                         |              | Sektor               |              |
|------------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| Mexiko                       | 8,86         | Unternehmensanleihen | 85,38        |
| Niederlande                  | 7,12         | Staatsanleihen       | 6,83         |
| Kaimaninseln                 | 6,99         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich       | 4,62         | <b>Summe</b>         | <b>92,21</b> |
| Luxemburg                    | 4,38         |                      |              |
| Argentinien                  | 4,30         |                      |              |
| Kolumbien                    | 4,11         |                      |              |
| Chile                        | 3,55         |                      |              |
| USA                          | 3,54         |                      |              |
| Indien                       | 3,50         |                      |              |
| Bermuda                      | 3,47         |                      |              |
| Thailand                     | 2,96         |                      |              |
| Türkei                       | 2,67         |                      |              |
| Israel                       | 2,60         |                      |              |
| Britische Jungferninseln     | 2,39         |                      |              |
| Brasilien                    | 2,35         |                      |              |
| Irland                       | 2,25         |                      |              |
| Katar                        | 2,13         |                      |              |
| Kanada                       | 1,93         |                      |              |
| Nigeria                      | 1,93         |                      |              |
| Indonesien                   | 1,92         |                      |              |
| Vereinigte Arabische Emirate | 1,68         |                      |              |
| Jersey                       | 1,35         |                      |              |
| Panama                       | 1,17         |                      |              |
| Singapur                     | 0,98         |                      |              |
| Länderübergreifend           | 0,95         |                      |              |
| Ukraine                      | 0,93         |                      |              |
| Insel Man                    | 0,85         |                      |              |
| Dominikanische Republik      | 0,79         |                      |              |
| Oman                         | 0,77         |                      |              |
| Angola                       | 0,74         |                      |              |
| Ägypten                      | 0,68         |                      |              |
| Ghana                        | 0,60         |                      |              |
| Spanien                      | 0,60         |                      |              |
| Peru                         | 0,57         |                      |              |
| Österreich                   | 0,53         |                      |              |
| Mauritius                    | 0,47         |                      |              |
| Cote D'Ivoire                | 0,42         |                      |              |
| Paraguay                     | 0,37         |                      |              |
| El Salvador                  | 0,18         |                      |              |
| <b>Summe</b>                 | <b>92,21</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 2.684.868,15                                      | CHF               | 2.883.480,76       | USD                | 62.714,03  | 28.01.2022 |
| 120.449.763,53                                    | EUR               | 135.687.749,72     | USD                | 815.199,83   | 28.01.2022 |
| 13.812.181,21                                     | NOK               | 1.541.245,94       | USD                | 24.917,40  | 28.01.2022 |
| 213.403.534,10                                    | SEK               | 23.730.860,48      | USD                | (148.362,23)   | 28.01.2022 |
| 1.396.388,07                                      | USD               | 1.280.689,62       | CHF                | (8.955,93)   | 28.01.2022 |
| 9.213.479,95                                      | USD               | 8.130.951,47       | EUR                | (1.142,70)   | 28.01.2022 |
| 50.213,77   | USD               | 455.316,73         | NOK                | (1.414,56)   | 28.01.2022 |
| 1.080.485,66                                      | USD               | 9.822.950,67       | SEK                | (5.014,72)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>737.941,12</b>  |            |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                   |                    |                    |  |            |
| 3.288.551,29                                      | USD               | 2.866.000,00       | EUR                | 39.256,65  | 17.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>39.256,65</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                   |                    |                    |  |            |
| 84.000,00   | SEK               | 9.212,39           | USD                | 71,64  | 17.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>71,64</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                  |                   |                    |                    |  |            |
| 29.000,00   | EUR               | 32.802,90          | USD                | 75,48  | 17.02.2022 |
| 37.346,88   | USD               | 33.000,00          | EUR                | (66,44)  | 17.02.2022 |
| 9.232,45  | USD               | 84.000,00          | SEK                | (51,58)  | 17.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(42,54)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>           |                   |                    |                    |  |            |
| 107.000,00  | EUR               | 120.991,87         | USD                | 318,02   | 17.02.2022 |
| 63.498,83   | USD               | 56.000,00          | EUR                | 9,52   | 17.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>327,54</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>39.613,29</b>   |            |
|   |                   |                    |                    | <b>777.554,41</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| <b>COP</b>  |  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 6.500.000.000,00  | Colombian TES 6% 28-04-2028                        | 1.443.555,49               | 1,59                         |                    |              |                            |                              |
| 7.000.000.000,00  | Colombian TES 7% 30-06-2032                        | 1.567.877,61               | 1,72                         |                    |              |                            |                              |
|   |  | <b>3.011.433,10</b>        | <b>3,31</b>                  |                    |              |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | Arcelik AS 3% 27-05-2026                           | 441.510,59                 | 0,48                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Croatia Government Internati<br>1.5% 17-06-2031    | 234.421,40                 | 0,26                         |                    |              |                            |                              |
| 120.000,00  | Prosus NV 2.031% 03-08-2032                        | 134.509,89                 | 0,15                         |                    |              |                            |                              |
|   |  | <b>810.441,88</b>          | <b>0,89</b>                  |                    |              |                            |                              |
| <b>IDR</b>  |  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 13.100.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 6.125%<br>15-05-2028       | 934.753,92                 | 1,03                         |                    |              |                            |                              |
| 20.750.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 8.25%<br>15-05-2036        | 1.616.800,81               | 1,78                         |                    |              |                            |                              |
| 15.422.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 8.375%<br>15-03-2034       | 1.214.042,73               | 1,33                         |                    |              |                            |                              |
|   |  | <b>3.765.597,46</b>        | <b>4,13</b>                  |                    |              |                            |                              |
| <b>MXN</b>  |  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 100.000,00  | Mexican Bonos 8.5% 31-05-2029                      | 517.478,72                 | 0,57                         |                    |              |                            |                              |
|   |  | <b>517.478,72</b>          | <b>0,57</b>                  |                    |              |                            |                              |
| <b>PEN</b>  |  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 6.000.000,00  | Peru Government Bond 5.4%<br>12-08-2034            | 1.368.293,44               | 1,50                         |                    |              |                            |                              |
| 8.500.000,00  | Peru Government Bond 6.15%<br>12-08-2032           | 2.145.957,84               | 2,36                         |                    |              |                            |                              |
|   |  | <b>3.514.251,28</b>        | <b>3,86</b>                  |                    |              |                            |                              |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>1.7% 02-03-2031    | 194.400,00                 | 0,21                         |                    |              |                            |                              |
| 1.600.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>2.5% 30-09-2029    | 1.660.128,00               | 1,82                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>3% 15-09-2051      | 200.040,00                 | 0,22                         |                    |              |                            |                              |
| 500.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>3.125% 03-05-2026  | 531.891,00                 | 0,58                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | Access Bank PLC 6.125% 21-<br>09-2026              | 398.000,00                 | 0,44                         |                    |              |                            |                              |
| 300.000,00  | Angolan Government Internati<br>8% 26-11-2029      | 295.476,00                 | 0,32                         |                    |              |                            |                              |
| 300.000,00  | Angolan Government Internati<br>9.125% 26-11-2049  | 287.433,00                 | 0,32                         |                    |              |                            |                              |
| 700.000,00  | Antofagasta PLC 2.375% 14-<br>10-2030              | 665.882,00                 | 0,73                         |                    |              |                            |                              |
| 300.000,00  | Azure Power Energy Ltd 3.575%<br>19-08-2026        | 302.640,00                 | 0,33                         |                    |              |                            |                              |
| 750.000,00  | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao<br>4.125% 20-09-2031   | 722.820,00                 | 0,79                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Bahrain Government Internati<br>6.25% 25-01-2051   | 183.008,00                 | 0,20                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | Bahrain Government Internati 7%<br>12-10-2028      | 433.561,60                 | 0,48                         |                    |              |                            |                              |
| 700.000,00  | Banco General SA 4.125% 07-<br>08-2027             | 749.875,00                 | 0,82                         |                    |              |                            |                              |
| 670.000,00  | Bancolumbia SA 3% 29-01-2025                       | 672.508,03                 | 0,74                         |                    |              |                            |                              |
| 650.000,00  | BBVA Bancomer SA/Texas<br>5.125% MULTI 18-01-2033  | 667.069,00                 | 0,73                         |                    |              |                            |                              |
| 500.000,00  | CAS Capital No 1 Ltd 4.000%<br>MULTI Perp FC2026   | 501.050,00                 | 0,55                         |                    |              |                            |                              |
| 500.000,00  | Cemex SAB de CV 5.125% MULTI<br>Perp FC2026        | 515.625,00                 | 0,57                         |                    |              |                            |                              |
| 600.000,00  | Chile Government Internation<br>2.45% 31-01-2031   | 593.256,00                 | 0,65                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Chile Government Internation<br>3.5% 15-04-2053    | 206.416,00                 | 0,23                         |                    |              |                            |                              |
| 700.000,00  | Chile Government Internation<br>3.5% 25-01-2050    | 726.369,00                 | 0,80                         |                    |              |                            |                              |
| 500.000,00  | Colbun SA 3.15% 19-01-2032                         | 494.750,00                 | 0,54                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Dominican Republic Internati<br>4.5% 30-01-2030    | 203.250,00                 | 0,22                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Egypt Government Internation<br>7.6003% 01-03-2029 | 198.224,00                 | 0,22                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | Egypt Government Internation<br>7.625% 29-05-2032  | 378.368,00                 | 0,42                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | Ghana Government Internation<br>7.875% 26-03-2027  | 351.170,40                 | 0,39                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Ghana Government Internation<br>8.875% 07-05-2042  | 161.768,00                 | 0,18                         |                    |              |                            |                              |
| 500.000,00  | Greenko Power II Ltd 4.3%<br>13-12-2028            | 507.500,00                 | 0,56                         |                    |              |                            |                              |
| 600.000,00  | Grupo Energia Bogota SA ESP<br>4.875% 15-05-2030   | 646.500,00                 | 0,71                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Guatemala Government Bond<br>6.125% 01-06-2050     | 229.250,00                 | 0,25                         |                    |              |                            |                              |
| 650.000,00  | Hikma Finance USA LLC 3.25%<br>09-07-2025          | 667.004,00                 | 0,73                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | HTA Group Ltd/Mauritius 7%<br>18-12-2025           | 416.400,00                 | 0,46                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | Hungary Government Internati<br>7.625% 29-03-2041  | 653.130,40                 | 0,72                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | IHS Holding Ltd 6.25% 29-11-<br>2028               | 202.500,00                 | 0,22                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | IHS Netherlands Holdco BV 8%<br>18-09-2027         | 211.604,00                 | 0,23                         |                    |              |                            |                              |
| 700.000,00  | Itau Unibanco Holding S 3.875%<br>MULTI 15-04-2031 | 670.397,00                 | 0,74                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | Ivory Coast Government Inter<br>5.375% 23-07-2024  | 415.860,00                 | 0,46                         |                    |              |                            |                              |
| 1.000.000,00  | Ivory Coast Government Inter<br>6.375% 03-03-2028  | 1.084.600,00               | 1,19                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Jamaica Government Internati<br>6.75% 28-04-2028   | 229.000,00                 | 0,25                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | Jamaica Government Internati<br>7.875% 28-07-2045  | 552.000,00                 | 0,61                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | Jordan Government Internatio<br>5.85% 07-07-2030   | 404.052,00                 | 0,44                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Jordan Government Internatio<br>7.375% 10-10-2047  | 201.948,00                 | 0,22                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Klabn Austria GmbH 3.2%<br>12-01-2031              | 185.250,00                 | 0,20                         |                    |              |                            |                              |
| 470.000,00  | Klabn Austria GmbH 5.75%<br>03-04-2029             | 513.475,00                 | 0,56                         |                    |              |                            |                              |
| 300.000,00  | Klabn Austria GmbH 7% 03-<br>04-2049               | 346.125,00                 | 0,38                         |                    |              |                            |                              |
| 800.000,00  | Kuwait International Governm<br>3.5% 20-03-2027    | 871.128,00                 | 0,96                         |                    |              |                            |                              |
| 500.000,00  | Lenovo Group Ltd 3.421% 02-<br>11-2030             | 503.881,64                 | 0,55                         |                    |              |                            |                              |
| 1.400.000,00  | Malaysia Wakala Sukuk Bhd<br>2.07% 28-04-2031      | 1.395.632,29               | 1,53                         |                    |              |                            |                              |
| 671.000,00  | Millicom International Cellu 4.5%<br>27-04-2031    | 676.039,21                 | 0,74                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Mongolia Government Internat<br>4.45% 07-07-2031   | 189.144,35                 | 0,21                         |                    |              |                            |                              |
| 1.446.000,00  | Mongolia Government Internat<br>5.125% 07-04-2026  | 1.478.590,89               | 1,62                         |                    |              |                            |                              |
| 800.000,00  | Morocco Government Internati<br>3% 15-12-2032      | 762.432,00                 | 0,84                         |                    |              |                            |                              |
| 2.000.000,00  | Namibia International Bonds<br>5.25% 29-10-2025    | 2.097.600,00               | 2,30                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Network i2i Ltd 3.975% MULTI<br>Perp FC2026        | 200.500,00                 | 0,22                         |                    |              |                            |                              |
| 480.000,00  | Network i2i Ltd 5.650% MULTI<br>Perp FC2025        | 504.000,00                 | 0,55                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | Oman Government Internationa<br>4.75% 15-06-2026   | 411.368,80                 | 0,45                         |                    |              |                            |                              |
| 700.000,00  | Oman Government Internationa<br>6.75% 17-01-2048   | 711.044,60                 | 0,78                         |                    |              |                            |                              |
| 500.000,00  | Oman Government Internationa<br>7.375% 28-10-2032  | 582.520,00                 | 0,64                         |                    |              |                            |                              |
| 800.000,00  | Paraguay Government Internat<br>4.95% 28-04-2031   | 896.808,00                 | 0,98                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Perusahaan Penerbit SBSN Ind<br>3.55% 09-06-2051   | 204.058,00                 | 0,22                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | Peruvian Government Internat<br>5.625% 18-11-2050  | 561.600,00                 | 0,62                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Philippine Government Intern<br>3.2% 06-07-2046    | 203.196,00                 | 0,22                         |                    |              |                            |                              |
| 500.000,00  | Prosus NV 4.027% 03-08-2050                        | 478.564,34                 | 0,53                         |                    |              |                            |                              |
| 800.000,00  | Qatar Government Internation<br>4.5% 23-04-2028    | 918.584,00                 | 1,01                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00  | Qatar Government Internation<br>5.103% 23-04-2048  | 270.616,00                 | 0,30                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00  | ReNew Power Pvt Ltd 5.875%<br>05-03-2027           | 415.326,23                 | 0,46                         |                    |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--------------|----------------------------|------------------------------|
| 400.000,00         | ReNew Wind Energy AP2 / ReNe<br>4,5% 14-07-2028   | 401.246,43                 | 0,44                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00         | Republic of Armenia Internat<br>3,6% 02-02-2031   | 372.648,00                 | 0,41                         |                    |              |                            |                              |
| 600.000,00         | Republic of Armenia Internat<br>3,95% 26-09-2029  | 582.000,00                 | 0,64                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00         | Republic of Kenya Government<br>6,875% 24-06-2024   | 211.245,60                 | 0,23                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00         | Republic of Kenya Government<br>7,25% 28-02-2028  | 215.164,00                 | 0,24                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00         | Republic of Kenya Government<br>8% 22-05-2032   | 436.248,00                 | 0,48                         |                    |              |                            |                              |
| 1.600.000,00       | Republic of Poland Governmen<br>3,25% 06-04-2026  | 1.716.025,60               | 1,88                         |                    |              |                            |                              |
| 500.000,00         | Republic of South Africa Gov<br>4,3% 12-10-2028   | 507.050,00                 | 0,56                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00         | Republic of South Africa Gov<br>5,75% 30-09-2049  | 192.040,00                 | 0,21                         |                    |              |                            |                              |
| 300.000,00         | Romanian Government Internat<br>6,125% 22-01-2044   | 393.048,00                 | 0,43                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00         | Rumo Luxembourg Sarl 4,2%<br>18-01-2032   | 188.750,00                 | 0,21                         |                    |              |                            |                              |
| 700.000,00         | Rumo Luxembourg Sarl 5,25%<br>10-01-2028  | 720.300,00                 | 0,79                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00         | Senegal Government Internati<br>6,25% 23-05-2033  | 205.850,40                 | 0,23                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00         | Senegal Government Internati<br>6,75% 13-03-2048  | 195.820,00                 | 0,22                         |                    |              |                            |                              |
| 600.000,00         | Serbia International Bond 2,125%<br>01-12-2030  | 561.778,80                 | 0,62                         |                    |              |                            |                              |
| 800.000,00         | Trinidad & Tobago Government<br>4,375% 16-01-2024   | 816.000,00                 | 0,90                         |                    |              |                            |                              |
| 1.300.000,00       | Trinidad & Tobago Government<br>4,5% 26-06-2030   | 1.316.900,00               | 1,45                         |                    |              |                            |                              |
| 690.000,00         | Turkcell Iletisim Hizmetleri 5,75%<br>15-10-2025  | 681.375,00                 | 0,75                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00         | Turkey Government Internatio<br>4,875% 16-04-2043   | 153.040,00                 | 0,17                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00         | Turkey Government Internatio<br>5,875% 26-06-2031   | 354.632,00                 | 0,39                         |                    |              |                            |                              |
| 300.000,00         | Ukraine Government Internati<br>7,253% 15-03-2033   | 264.000,00                 | 0,29                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00         | Ukraine Government Internati<br>9,75% 01-11-2028  | 201.986,40                 | 0,22                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00         | UltraTech Cement Ltd 2,8%<br>16-02-2031   | 387.586,80                 | 0,43                         |                    |              |                            |                              |
|                    |   | <b>45.838.942,81</b>       | <b>50,34</b>                 |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>ZAR</b>  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 4.140.967,00       | Republic of South Africa Gov<br>6,25% 31-03-2036  | 181.409,30                 | 0,20                         |                    |              |                            |                              |
|                    |   | <b>181.409,30</b>          | <b>0,20</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>57.639.554,55</b>       | <b>63,29</b>                 |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>57.639.554,55</b>       | <b>63,29</b>                 |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>CNY</b>  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 11.000.000,00      | China Government Bond 2,68%<br>21-05-2030   | 1.698.609,43               | 1,87                         |                    |              |                            |                              |
| 10.000.000,00      | China Government Bond 3,13%<br>21-11-2029   | 1.599.493,30               | 1,76                         |                    |              |                            |                              |
| 11.990.000,00      | China Government Bond 3,29%<br>23-05-2029   | 1.933.019,89               | 2,12                         |                    |              |                            |                              |
|                    |   | <b>5.231.122,62</b>        | <b>5,74</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>EGP</b>  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 32.500.000,00      | Egypt Treasury Bills 01-02-2022   | 2.051.599,65               | 2,25                         |                    |              |                            |                              |
| 2.000.000,00       | Egypt Treasury Bills 12-07-2022   | 119.806,76                 | 0,13                         |                    |              |                            |                              |
| 40.000.000,00      | Egypt Treasury Bills 18-01-2022   | 2.535.450,06               | 2,78                         |                    |              |                            |                              |
|                    |   | <b>4.706.856,47</b>        | <b>5,17</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>PHP</b>  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 210.000.000,00     | Philippine Government Intern<br>6,25% 14-01-2036  | 4.564.772,13               | 5,01                         |                    |              |                            |                              |
|                    |   | <b>4.564.772,13</b>        | <b>5,01</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>RUB</b>  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 61.645.000,00      | Russian Federal Bond - OFZ<br>7,25% 10-05-2034  | 757.165,86                 | 0,83                         |                    |              |                            |                              |
| 50.000.000,00      | Russian Federal Bond - OFZ 7,7%<br>16-03-2039   | 631.121,43                 | 0,69                         |                    |              |                            |                              |
| 86.270.000,00      | Russian Federal Bond - OFZ<br>8,5% 17-09-2031   | 1.165.394,93               | 1,28                         |                    |              |                            |                              |
|                    |   | <b>2.553.682,22</b>        | <b>2,80</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 600.000,00         | Colombia Government Internat<br>3,125% 15-04-2031   | 537.960,00                 | 0,59                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00         | Colombia Government Internat<br>4,125% 15-05-2051   | 162.300,00                 | 0,18                         |                    |              |                            |                              |
| 500.000,00         | Empresa Nacional de Telecomu<br>3,05% 14-09-2032  | 491.255,00                 | 0,54                         |                    |              |                            |                              |
| 600.000,00         | Guatemala Government Bond<br>4,875% 13-02-2028  | 644.106,00                 | 0,71                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00         | Mexico Government Internatio<br>6,05% 11-01-2040  | 246.472,00                 | 0,27                         |                    |              |                            |                              |
| 600.000,00         | Natura Cosmetics SA 4,125%<br>03-05-2028  | 588.000,00                 | 0,65                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00         | Panama Government Internatio<br>4,5% 01-04-2056   | 440.000,00                 | 0,48                         |                    |              |                            |                              |
| 2.000.000,00       | Paraguay Government Internat<br>6,1% 11-08-2044   | 2.455.000,00               | 2,70                         |                    |              |                            |                              |
| 500.000,00         | Uruguay Government Internati<br>4,375% 23-01-2031   | 575.755,00                 | 0,63                         |                    |              |                            |                              |
| 400.000,00         | Uruguay Government Internati<br>4,375% 27-10-2027   | 449.500,00                 | 0,49                         |                    |              |                            |                              |
| 200.000,00         | Uruguay Government Internati<br>5,1% 18-06-2050   | 264.260,00                 | 0,29                         |                    |              |                            |                              |
|                    |   | <b>6.854.608,00</b>        | <b>7,53</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>23.911.041,44</b>       | <b>26,26</b>                 |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>23.911.041,44</b>       | <b>26,26</b>                 |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>MYR</b>  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 3.500.000,00       | Malaysia Government Bond<br>2,632% 15-04-2031   | 776.116,19                 | 0,85                         |                    |              |                            |                              |
| 4.500.000,00       | Malaysia Government Bond<br>4,127% 15-04-2032   | 1.118.253,53               | 1,23                         |                    |              |                            |                              |
|                    |   | <b>1.894.369,72</b>        | <b>2,08</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>1.894.369,72</b>        | <b>2,08</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Summe sonstige übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>1.894.369,72</b>        | <b>2,08</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>83.444.965,71</b>       | <b>91,63</b>                 |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>4.276.851,31</b>        | <b>4,70</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Sonstige<br/>Nettovermögenswerte</b>   | <b>3.345.343,53</b>        | <b>3,67</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>91.067.160,55</b>       | <b>100,00</b>                |                    |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                         |              | Sektor               |              |
|------------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| Ägypten                      | 5,80         | Staatsanleihen       | 73,11        |
| China                        | 5,74         | Unternehmensanleihen | 18,52        |
| Kolumbien                    | 5,52         |                      |              |
| Philippinen                  | 5,24         |                      |              |
| Peru                         | 4,48         |                      |              |
| Indonesien                   | 4,36         |                      |              |
| Paraguay                     | 3,68         |                      |              |
| Malaysia                     | 3,61         |                      |              |
| Vereinigte Arabische Emirate | 2,84         |                      |              |
| Russische Föderation         | 2,80         |                      |              |
| Chile                        | 2,76         |                      |              |
| Trinidad und Tobago          | 2,34         |                      |              |
| Namibia                      | 2,30         |                      |              |
| Brasilien                    | 2,18         |                      |              |
| Mexiko                       | 2,14         |                      |              |
| Mauritius                    | 2,12         |                      |              |
| Polen                        | 1,88         |                      |              |
| Oman                         | 1,87         |                      |              |
| Mongolei                     | 1,83         |                      |              |
| Türkei                       | 1,79         |                      |              |
| Luxemburg                    | 1,74         |                      |              |
| Cote D'Ivoire                | 1,65         |                      |              |
| Uruguay                      | 1,42         |                      |              |
| Indien                       | 1,32         |                      |              |
| Panama                       | 1,31         |                      |              |
| Katar                        | 1,31         |                      |              |
| Österreich                   | 1,15         |                      |              |
| Armenien                     | 1,05         |                      |              |
| Südafrika                    | 0,97         |                      |              |
| Guatemala                    | 0,96         |                      |              |
| Kuwait                       | 0,96         |                      |              |
| Kenia                        | 0,95         |                      |              |
| Niederlande                  | 0,91         |                      |              |
| Jamaika                      | 0,86         |                      |              |
| Marokko                      | 0,84         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich       | 0,73         |                      |              |
| USA                          | 0,73         |                      |              |
| Ungarn                       | 0,72         |                      |              |
| Bahrain                      | 0,68         |                      |              |
| Jordanien                    | 0,67         |                      |              |
| Angola                       | 0,64         |                      |              |
| Republik Serbien             | 0,62         |                      |              |
| Ghana                        | 0,56         |                      |              |
| Britische Jungferninseln     | 0,55         |                      |              |
| Hongkong                     | 0,55         |                      |              |
| Ukraine                      | 0,51         |                      |              |
| Nigeria                      | 0,44         |                      |              |
| Senegal                      | 0,44         |                      |              |
| Rumänien                     | 0,43         |                      |              |
| Kroatien                     | 0,26         |                      |              |
| Kaimaninseln                 | 0,22         |                      |              |
| Dominikanische Republik      | 0,22         |                      |              |
| <b>Summe</b>                 | <b>91,63</b> |                      |              |
|                              |              | <b>Summe</b>         | <b>91,63</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswahrung (USD) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 4.714.383,36                                      | EUR                | 5.310.507,01      | USD                  | 32.198,97   | 28.01.2022  |
| 796.716.627,27                                    | NOK                | 88.954.298,62     | USD                  | 1.385.302,71  | 28.01.2022  |
| 5.313.574,24                                      | USD                | 4.714.383,36      | EUR                  | (29.131,85)   | 28.01.2022  |
| 1.200.613,12                                      | USD                | 10.802.192,79     | NOK                  | (24.246,00)   | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>1.364.123,83</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 1.860.000,00                                      | CZK                | 84.778,05         | USD                  | (171,17)  | 12.01.2022  |
| 7.891.000,00                                      | MYR                | 1.863.262,18      | USD                  | 31.798,13   | 12.01.2022  |
| 5.853.000,00                                      | PHP                | 114.573,75        | USD                  | (457,75)  | 12.01.2022  |
| 455.000,00  | PLN                | 114.669,45        | USD                  | (2.625,04)  | 12.01.2022  |
| 11.868.000,00                                     | TRY                | 934.675,79        | USD                  | (59.880,31)   | 12.01.2022  |
| 2.381.000,00                                      | TWD                | 85.619,76         | USD                  | 341,65  | 12.01.2022  |
| 4.379.011,04                                      | USD                | 18.291.000,00     | MYR                  | (13.659,13)   | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(44.653,62)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 1.526.625.000,00                                  | COP                | 398.200,86        | USD                  | (23.644,11)   | 12.01.2022  |
| 39.542.000,00                                     | CZK                | 1.795.900,45      | USD                  | 2.769,04  | 12.01.2022  |
| 2.281.296,84                                      | EUR                | 840.646.000,00    | HUF                  | 8.475,73  | 12.01.2022  |
| 2.127.006,70                                      | EUR                | 9.850.000,00      | PLN                  | (15.850,65)   | 12.01.2022  |
| 1.316.580.322,00                                  | HUF                | 4.215.894,61      | USD                  | (181.407,60)  | 12.01.2022  |
| 1.553.000,00                                      | MXN                | 75.432,01         | USD                  | 389,96  | 12.01.2022  |
| 5.712.000,00                                      | RON                | 1.326.161,97      | USD                  | (19.970,42)   | 12.01.2022  |
| 3.900.765,90                                      | USD                | 3.367.146,73      | EUR                  | 86.062,40   | 12.01.2022  |
| 157.624,76  | USD                | 51.378.000,00     | HUF                  | 183,76  | 12.01.2022  |
| 657.286,88  | USD                | 9.417.797.000,00  | IDR                  | (4.794,85)  | 12.01.2022  |
| 1.815.740,93                                      | USD                | 7.294.000,00      | PEN                  | (10.945,22)   | 12.01.2022  |
| 279.631,71  | USD                | 1.142.000,00      | PLN                  | (1.587,29)  | 12.01.2022  |
| 1.370.432,72                                      | USD                | 100.185.510,00    | RUB                  | 44.069,73   | 12.01.2022  |
| 66.171,48   | USD                | 90.000,00         | SGD                  | (510,80)  | 12.01.2022  |
| 10.064.000,00                                     | ZAR                | 651.976,22        | USD                  | (22.057,63)   | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(138.817,95)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 3.367.633.000,00                                  | COP                | 859.199,64        | USD                  | (32.952,88)   | 12.01.2022  |
| 5.748.000,00                                      | CZK                | 259.080,67        | USD                  | 2.381,85  | 12.01.2022  |
| 314.000,00  | EUR                | 353.484,62        | USD                  | 2.251,68  | 12.01.2022  |
| 11.691.000,00                                     | HUF                | 36.529,10         | USD                  | (703,58)  | 12.01.2022  |
| 18.108.000,00                                     | MXN                | 860.828,25        | USD                  | 23.256,61   | 12.01.2022  |
| 12.978.000,00                                     | PEN                | 3.127.216,99      | USD                  | 122.949,40  | 12.01.2022  |
| 13.449.159,00                                     | PLN                | 3.382.245,00      | USD                  | (70.370,44)   | 12.01.2022  |
| 5.236.000,00                                      | SGD                | 3.858.878,26      | USD                  | 20.549,02   | 12.01.2022  |
| 129.170.000,00                                    | THB                | 3.944.760,53      | USD                  | (69.474,03)   | 12.01.2022  |
| 278.084,58  | USD                | 6.151.000,00      | CZK                  | (1.709,44)  | 12.01.2022  |
| 345.030,48  | USD                | 107.251.000,00    | HUF                  | 16.373,89   | 12.01.2022  |
| 1.576.107,61                                      | USD                | 6.222.000,00      | PEN                  | 17.889,04   | 12.01.2022  |
| 4.244.927,79                                      | USD                | 217.803.000,00    | PHP                  | (1.579,19)  | 12.01.2022  |
| 1.009.199,20                                      | USD                | 34.228.000,00     | THB                  | (17.689,61)   | 12.01.2022  |
| 863.247,31  | USD                | 13.116.000,00     | ZAR                  | 42.299,92   | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>53.472,24</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 2.076.000,00                                      | BRL                | 369.667,04        | USD                  | 1.858,83  | 12.01.2022  |
| 123.066.000,00                                    | CLP                | 150.462,15        | USD                  | (6.253,28)  | 12.01.2022  |
| 13.251.000,00                                     | CZK                | 604.716,16        | USD                  | (1.960,33)  | 12.01.2022  |
| 169.104.000,00                                    | HUF                | 541.747,89        | USD                  | (23.550,93)   | 12.01.2022  |
| 1.503.000,00                                      | PEN                | 373.666,81        | USD                  | 2.739,71  | 12.01.2022  |
| 5.849.000,00                                      | PHP                | 116.446,67        | USD                  | (2.408,60)  | 12.01.2022  |
| 1.206.000,00                                      | PLN                | 302.936,45        | USD                  | (5.957,23)  | 12.01.2022  |
| 10.246.000,00                                     | THB                | 301.307,75        | USD                  | 6.086,85  | 12.01.2022  |
| 9.889.000,00                                      | TRY                | 745.432,04        | USD                  | (16.510,09)   | 12.01.2022  |
| 9.551.000,00                                      | TWD                | 344.567,59        | USD                  | 252,85  | 12.01.2022  |
| 132.824,17  | USD                | 109.390.000,00    | CLP                  | 4.640,88  | 12.01.2022  |
| 5.811.149,56                                      | USD                | 37.787.000,00     | CNY                  | (127.631,68)  | 12.01.2022  |
| 806.860,23  | USD                | 17.072.032,00     | MXN                  | (26.645,60)   | 12.01.2022  |
| 1.160.622,52                                      | USD                | 4.743.000,00      | PEN                  | (27.198,80)   | 12.01.2022  |
| 166.747,11  | USD                | 228.000,00        | SGD                  | (2.181,33)  | 12.01.2022  |
| 698.825,43  | USD                | 23.382.000,00     | THB                  | (2.668,07)  | 12.01.2022  |
| 3.906.604,50                                      | USD                | 37.150.000,00     | TRY                  | 1.168.245,18  | 12.01.2022  |
| 165.756,02  | USD                | 4.596.000,00      | TWD                  | (173,70)  | 12.01.2022  |
| 2.569.000,00                                      | ZAR                | 168.151,94        | USD                  | (7.354,93)  | 12.01.2022  |
| 24.301.295,00                                     | TRY                | 1.274.636,61      | USD                  | 430.071,80  | 09.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>1.363.401,53</b>   |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                                | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswahrung (USD) | Falligkeit |
|--|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 797.538.000,00                                   | CLP                | 948.751,78        | USD                  | (14.196,59)   | 12.01.2022  |
| 2.464.081.000,00                                 | COP                | 625.616,21        | USD                  | (21.055,48)   | 12.01.2022  |
| 66.000,00  | EUR                | 76.823,34         | USD                  | (2.050,69)  | 12.01.2022  |
| 954.438.000,00                                   | IDR                | 66.202,26         | USD                  | 895,80  | 12.01.2022  |
| 19.094.000,00                                    | MXN                | 891.061,13        | USD                  | 41.162,80   | 12.01.2022  |
| 22.557.000,00                                    | MYR                | 5.391.069,01      | USD                  | 26.100,99   | 12.01.2022  |
| 4.262.000,00                                     | PEN                | 1.059.471,07      | USD                  | 7.890,61  | 12.01.2022  |
| 31.874.000,00                                    | PHP                | 629.696,95        | USD                  | (8.249,08)  | 12.01.2022  |
| 5.249.000,00                                     | RUB                | 72.922,31         | USD                  | (3.430,41)  | 12.01.2022  |
| 9.019.000,00                                     | THB                | 266.007,96        | USD                  | 4.574,90  | 12.01.2022  |
| 23.886.700,00                                    | TRY                | 1.902.695,76      | USD                  | (141.996,29)  | 12.01.2022  |
| 249.805,81                                       | USD                | 1.398.000,00      | BRL                  | (383,60)  | 12.01.2022  |
| 395.256,01                                       | USD                | 8.802.000,00      | CZK                  | (5.125,50)  | 12.01.2022  |
| 134.836,90                                       | USD                | 1.934.505.000,00  | IDR                  | (1.160,97)  | 12.01.2022  |
| 7.941,91   | USD                | 595.000,00        | INR                  | (39,43)   | 12.01.2022  |
| 283.756,75                                       | USD                | 5.962.000,00      | MXN                  | (7.325,32)  | 12.01.2022  |
| 1.321.778,74                                     | USD                | 5.518.000,00      | MYR                  | (3.395,08)  | 12.01.2022  |
| 393.903,89                                       | USD                | 1.608.000,00      | PEN                  | (8.798,35)  | 12.01.2022  |
| 238.870,32                                       | USD                | 1.026.000,00      | RON                  | 4.249,77  | 12.01.2022  |
| 99.376,84  | USD                | 3.317.000,00      | THB                  | (137,92)  | 12.01.2022  |
| 77.270,01  | USD                | 1.166.000,00      | ZAR                  | 4.288,56  | 12.01.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(128.181,28)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: HSBC Continental Europe SA</b>   |                    |                   |                      |   |             |
| 4.804.000,00                                     | BRL                | 859.259,58        | USD                  | 475,71  | 12.01.2022  |
| 126.217.000,00                                   | CLP                | 153.446,92        | USD                  | (5.545,73)  | 12.01.2022  |
| 289.929.000,00                                   | COP                | 76.659,02         | USD                  | (5.525,04)  | 12.01.2022  |
| 87.504.000,00                                    | HUF                | 278.642,68        | USD                  | (10.498,22)   | 12.01.2022  |
| 14.578.450.000,00                                | IDR                | 1.013.270,04      | USD                  | 11.611,30   | 12.01.2022  |
| 42.993.000,00                                    | KRW                | 36.624,70         | USD                  | (520,39)  | 12.01.2022  |
| 38.280.000,00                                    | PHP                | 757.213,83        | USD                  | (10.868,05)   | 12.01.2022  |
| 2.306.000,00                                     | RON                | 537.241,36        | USD                  | (9.916,80)  | 12.01.2022  |
| 210.000,00                                       | SGD                | 155.850,17        | USD                  | (258,15)  | 12.01.2022  |
| 2.184.000,00                                     | TRY                | 176.362,73        | USD                  | (15.379,06)   | 12.01.2022  |
| 4.866.000,00                                     | TWD                | 175.778,92        | USD                  | (101,37)  | 12.01.2022  |
| 4.023.232,37                                     | USD                | 15.475.484.000,00 | COP                  | 226.329,66  | 12.01.2022  |
| 633.752,99                                       | USD                | 9.160.646.000,00  | IDR                  | (10.250,59)   | 12.01.2022  |
| 215.992,20                                       | USD                | 871.000,00        | PEN                  | (2.138,25)  | 12.01.2022  |
| 1.161.378,52                                     | USD                | 15.792.000,00     | TRY                  | (2.655,31)  | 12.01.2022  |
| 3.946.467,92                                     | USD                | 109.256.000,00    | TWD                  | 1.990,62  | 12.01.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>166.750,33</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| 477.986.000,00                                   | COP                | 123.397,08        | USD                  | (6.123,46)  | 12.01.2022  |
| 875.250,00                                       | CZK                | 39.689,53         | USD                  | 123,46  | 12.01.2022  |
| 708.981.000,00                                   | IDR                | 48.918,86         | USD                  | 923,29  | 12.01.2022  |
| 1.014.568.000,00                                 | KRW                | 864.897,49        | USD                  | (12.891,93)   | 12.01.2022  |
| 4.487.000,00                                     | MXN                | 215.001,63        | USD                  | 4.066,70  | 12.01.2022  |
| 14.170.000,00                                    | PEN                | 3.473.157,49      | USD                  | 75.530,84   | 12.01.2022  |
| 35.228.000,00                                    | PHP                | 687.051,67        | USD                  | (211,04)  | 12.01.2022  |
| 9.909.000,00                                     | PLN                | 2.139.997,06      | EUR                  | 15.662,46   | 12.01.2022  |
| 30.935.000,00                                    | RUB                | 418.901,94        | USD                  | (9.351,38)  | 12.01.2022  |
| 75.000,00  | SGD                | 54.848,59         | USD                  | 719,98  | 12.01.2022  |
| 3.873.000,00                                     | THB                | 114.218,78        | USD                  | 1.976,74  | 12.01.2022  |
| 2.209.000,00                                     | TRY                | 235.636,14        | USD                  | (72.808,74)   | 12.01.2022  |
| 64.236,62  | USD                | 20.747.000,00     | HUF                  | 660,21  | 12.01.2022  |
| 939.600,00                                       | USD                | 1.115.775.000,00  | KRW                  | 2.603,95  | 12.01.2022  |
| 1.793.259,58                                     | USD                | 7.097.000,00      | PLN                  | 45.613,07   | 12.01.2022  |
| 45.151,07  | USD                | 200.000,00        | RON                  | (583,90)  | 12.01.2022  |
| 426.434,35                                       | USD                | 31.366.000,00     | RUB                  | 11.177,72   | 12.01.2022  |
| 298.170,68                                       | USD                | 408.000,00        | SGD                  | (4.122,32)  | 12.01.2022  |
| 1.364.031,34                                     | USD                | 13.610.000,00     | TRY                  | 360.827,35  | 12.01.2022  |
| 1.092.000,00                                     | ZAR                | 68.387,70         | USD                  | (38,07)   | 12.01.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>413.754,93</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>          |                    |                   |                      |   |             |
| 4.382.000,00                                     | CNY                | 683.640,68        | USD                  | 5.055,14  | 12.01.2022  |
| 4.477.000,00                                     | RON                | 1.022.465,95      | USD                  | 1.311,70  | 12.01.2022  |
| 148.518,68                                       | USD                | 2.142.382.000,00  | IDR                  | (2.093,16)  | 12.01.2022  |
| 87.702,10  | USD                | 2.886.000,00      | THB                  | 1.117,94  | 12.01.2022  |
| 13.660.000,00                                    | ZAR                | 865.587,86        | USD                  | (10.591,37)   | 12.01.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(5.199,75)</b>   |             |
|  |                    |                   |                      | <b>1.680.526,43</b>   |             |
|  |                    |                   |                      | <b>3.044.650,26</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps

| Basiswert  | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal         | Währung | Kosten (USD)        | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (USD) | Marktwert (USD)     | Fälligkeit |
|--|--------------|-----------------|-----------------|---------|---------------------|---|---------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                 |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| Chile Government Internation 3.24%<br>06-02-2028   | Verkauf      | 1,00%           | (1.000.000,00)  | USD     | 11.180,60           | 2.735,95  | 13.916,55           | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>11.180,60</b>    | <b>2.735,95</b>                                     | <b>13.916,55</b>    |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>            |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| Brazilian Government Interna 4.25%<br>07-01-2025   | Verkauf      | 1,00%           | (600.000,00)    | USD     | (29.517,18)         | 574,27  | (28.942,91)         | 20.12.2026 |
| Philippine Government Intern 10.625%<br>16-03-2025 | Verkauf      | 1,00%           | (1.200.000,00)  | USD     | 28.780,44           | (3.732,96)  | 25.047,48           | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>(736,74)</b>     | <b>(3.158,69)</b>                                   | <b>(3.895,43)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>   |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| China Government Internation 7.5%<br>28-10-2027    | Verkauf      | 1,00%           | (31.700.000,00) | USD     | 926.334,67          | (15.693,08)   | 910.641,59          | 20.12.2026 |
| Indonesia Government Interna 4.125%<br>15-01-2025  | Verkauf      | 1,00%           | (1.300.000,00)  | USD     | 12.455,37           | 2.981,54  | 15.436,91           | 20.12.2026 |
| Malaysia (No ref obligation)                       | Verkauf      | 1,00%           | (3.200.000,00)  | USD     | 83.448,49           | 430,68  | 83.879,17           | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>1.022.238,53</b> | <b>(12.280,86)</b>                                  | <b>1.009.957,67</b> |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                   |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| Russian Foreign Bond - Eurob MULTI<br>31-03-2030   | Verkauf      | 1,00%           | (500.000,00)    | USD     | 3.547,59            | (9.377,43)  | (5.829,84)          | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>3.547,59</b>     | <b>(9.377,43)</b>                                   | <b>(5.829,84)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>       |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| Malaysia (No ref obligation)                       | Verkauf      | 1,00%           | (1.600.000,00)  | USD     | 33.685,29           | 8.254,29  | 41.939,58           | 20.12.2026 |
| Mexico Government Internatio 4.15%<br>28-03-2027   | Verkauf      | 1,00%           | (3.500.000,00)  | USD     | 7.070,58            | 7.901,18  | 14.971,76           | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>40.755,87</b>    | <b>16.155,47</b>                                    | <b>56.911,34</b>    |            |
|  |              |                 |                 |         | <b>1.076.985,85</b> | <b>(5.925,56)</b>                                   | <b>1.071.060,29</b> |            |

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>vom 30.12.2021 bis 31.12.2021<br>in der Basiswährung des<br>Teilfonds (USD) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (USD) |
|--|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                      |                             |   |  |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (135,00)                             | (17.604.843,75)             | 0,00  | (184.570,31)   |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (2,00)                               | (241.921,88)                | (109,38)  | (857,40)   |
| US LONG BOND(CBT) 3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (20,00)                              | (3.197.500,00)              | 0,00  | (14.187,31)  |
| US ULTRA BOND CBT 3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 18,00                                | 3.519.000,00                | (1.125,00)  | 48.818,78  |
|  |            |         |                                      |                             | <b>(1.234,38)</b>   | <b>(150.796,24)</b>  |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Zinsswaps

| Beschreibung                                     | Nominal          | Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs<br>(Wertminderung) im Teilfonds<br>Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|--|------------------|---------|--|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |                  |         |  |            |
| Paying floating rate MXN_28D 28 days             | (4.000.000,00)   | MXN     | 1.867,20   | 08.12.2027 |
| Receiving fixed rate 7,6100%                     |                  |         |  |            |
| Paying floating rate THFX 6 months               | (10.000.000,00)  | THB     | 4.475,13   | 12.12.2022 |
| Receiving fixed rate 1,9200%                     |                  |         |  |            |
| Paying floating rate THFX 6 months               | (6.000.000,00)   | THB     | 9.779,14   | 12.12.2027 |
| Receiving fixed rate 2,3300%                     |                  |         |  |            |
| Paying floating rate BZDIOVRA1D                  | (1.375.466,96)   | BRL     | 89,49  | 03.01.2022 |
| Receiving fixed rate 9,6800%                     |                  |         |  |            |
| Paying floating rate BZDIOVRA1D                  | (615.300,34)     | BRL     | 962,96   | 04.01.2027 |
| Receiving fixed rate 10,3600%                    |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 2,5350%                     | 80.000.000,00    | THB     | 158.738,62   | 30.10.2028 |
| Paying floating rate THFX 6 months               |                  |         |  |            |
| Paying fixed rate 6,6800%                        | (3.800.000,00)   | BRL     | 59.119,97  | 02.01.2024 |
| Receiving floating rate BZDIOVRA1D               |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 6,9025%                     | 6.500.000,00     | MXN     | (12.876,67)  | 23.04.2031 |
| Paying floating rate MXN_28D 28 days             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 2,8200%                     | 280.000.000,00   | HUF     | (109.613,62)   | 08.07.2031 |
| Paying floating rate BUBOR 6 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 2,5500%                     | 11.000.000,00    | MYR     | (39.273,86)  | 06.08.2026 |
| Paying floating rate KLIBOR 3 months             |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>73.268,36</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>    |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 6,5100%                     | 6.101.937,40     | BRL     | (80.387,84)  | 03.07.2023 |
| Paying floating rate BZDIOVRA1D                  |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 0,8900%                     | 1.500.000,00     | PLN     | (70.989,79)  | 07.07.2030 |
| Paying floating rate WIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 0,6200%                     | 4.500.000,00     | PLN     | (116.046,15)   | 08.10.2025 |
| Paying floating rate WIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>(267.423,78)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>    |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 4,6700%                     | 5.000.000,00     | ZAR     | (14.839,49)  | 05.11.2025 |
| Paying floating rate JIBAR 3 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1,2400%                     | 6.000.000,00     | CZK     | (44.181,84)  | 29.01.2031 |
| Paying floating rate PRIBOR 6 months             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 2,1600%                     | 1.500.000,00     | MYR     | (9.598,23)   | 29.01.2026 |
| Paying floating rate KLIBOR 3 months             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1,5800%                     | 27.000.000,00    | CZK     | (107.740,09)   | 19.03.2026 |
| Paying floating rate PRIBOR 6 months             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 5,9525%                     | 25.000.000,00    | ZAR     | (11.924,45)  | 17.03.2026 |
| Paying floating rate JIBAR 3 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1,5600%                     | 1.000.000.000,00 | HUF     | (214.434,21)   | 25.03.2024 |
| Paying floating rate BUBOR 6 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 2,5600%                     | 8.000.000,00     | MYR     | (26.652,27)  | 06.07.2026 |
| Paying floating rate KLIBOR 3 months             |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>(429.370,58)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 0,8600%                     | 9.000.000,00     | CZK     | (75.801,19)  | 12.10.2030 |
| Paying floating rate PRIBOR 6 months             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 0,8350%                     | 9.000.000,00     | CZK     | (76.615,63)  | 13.10.2030 |
| Paying floating rate PRIBOR 6 months             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 6,8450%                     | 8.000.000,00     | ZAR     | (13.520,99)  | 02.12.2030 |
| Paying floating rate JIBAR 3 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 5,4925%                     | 14.000.000,00    | MXN     | (89.808,37)  | 21.11.2030 |
| Paying floating rate MXN_28D 28 days             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 3,0040%                     | 3.000.000,00     | MYR     | (16.866,06)  | 05.05.2031 |
| Paying floating rate KLIBOR 3 months             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1,5600%                     | 47.200.000,00    | THB     | (19.634,16)  | 20.05.2031 |
| Paying floating rate THFX 6 months               |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 3,2900%                     | 6.000.000,00     | MYR     | (4.648,76)   | 07.12.2031 |
| Paying floating rate KLIBOR 3 months             |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>(296.895,16)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 6,4400%                     | 5.000.000,00     | MXN     | (6.514,09)   | 31.01.2025 |
| Paying floating rate MXN_28D 28 days             |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>(6.514,09)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 2,4950%                     | 7.000.000,00     | MYR     | (101.161,32)   | 09.12.2030 |
| Paying floating rate KLIBOR 3 months             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1,4800%                     | 11.000.000,00    | CZK     | (71.284,15)  | 12.02.2031 |
| Paying floating rate PRIBOR 6 months             |                  |         |  |            |
| Paying fixed rate 3,1000%                        | (6.500.000,00)   | MYR     | 24.759,85  | 18.05.2031 |
| Receiving floating rate KLIBOR 3 months          |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 0,9300%                     | 20.000.000,00    | THB     | (6.714,04)   | 08.07.2026 |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Zinsswaps (Fortsetzung)

| Beschreibung   | Nominal   | Währung  | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs<br>(Wertminderung) im Teilfonds<br>Basiswährung (USD)   | Fälligkeit   |
|--|---|--|--|--|
| Paying floating rate THFX 6 months<br>Receiving fixed rate 6.3100%<br>Paying floating rate MXN_28D 28 days   | 30.000.000,00   | MXN  | (51.211,84)  | 01.08.2025   |
|  |   |  | <b>(205.611,50)</b>  |  |
| <b>Gegenpartei: HSBC Continental Europe SA</b>   |   |  |  |  |
| Receiving fixed rate 2.8800%<br>Paying floating rate KLIBOR 3 months   | 10.000.000,00   | MYR  | (4.880,63)   | 07.12.2026   |
|  |   |  | <b>(4.880,63)</b>  |  |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>   |   |  |  |  |
| Paying floating rate WIBOR 6 months<br>Receiving fixed rate 2.4900%<br>Receiving fixed rate 2.3425%<br>Paying floating rate PRIBOR 6 months<br>Receiving fixed rate 2.2200%<br>Paying floating rate WIBOR 6 months<br>Paying fixed rate 8.1400%<br>Receiving floating rate BZDIOVRA1D<br>Receiving fixed rate 2.4900%<br>Paying floating rate KLIBOR 3 months<br>Receiving fixed rate 5.8800%<br>Paying floating rate MXN_28D 28 days<br>Receiving fixed rate 2.2600%<br>Paying floating rate KLIBOR 3 months<br>Receiving fixed rate 2.0150%<br>Paying floating rate KLIBOR 3 months<br>Receiving fixed rate 1.2350%<br>Paying floating rate BUBOR 6 months<br>Paying fixed rate 3.1250%<br>Receiving floating rate KLIBOR 3 months<br>Receiving fixed rate 1.1550%<br>Paying floating rate THFX 6 months   | (1.200.000,00)<br>35.000.000,00<br>4.500.000,00<br>(5.000.000,00)<br>1.100.000,00<br>11.000.000,00<br>2.000.000,00<br>3.000.000,00<br>250.000.000,00<br>(6.500.000,00)<br>10.000.000,00               | PLN<br>CZK<br>PLN<br>BRL<br>MYR<br>MXN<br>MYR<br>MYR<br>HUF<br>MYR<br>THB        | (2.613,01)<br>(53.604,53)<br>(26.403,32)<br>42.959,63<br>(19.785,68)<br>(54.397,60)<br>36.694,72<br>(20.839,66)<br>(93.111,51)<br>21.417,41<br>(1.056,74)                        | 11.12.2022<br>30.10.2023<br>29.10.2023<br>15.05.2023<br>05.06.2032<br>07.06.2030<br>06.10.2030<br>06.10.2025<br>13.10.2025<br>12.05.2031<br>09.12.2026               |
|  |   |  | <b>(244.129,73)</b>  |  |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>   |   |  |  |  |
| Receiving fixed rate 0.5300%<br>Paying floating rate PRIBOR 6 months<br>Receiving fixed rate 2.0000%<br>Paying floating rate KLIBOR 3 months<br>Receiving fixed rate 1.1650%<br>Paying floating rate THFX 6 months<br>Receiving fixed rate 2.1000%<br>Paying floating rate KLIBOR 3 months<br>Receiving fixed rate 1.0425%<br>Paying floating rate PRIBOR 6 months<br>Receiving fixed rate 1.1675%<br>Paying floating rate THFX 6 months<br>Receiving fixed rate 1.6200%<br>Paying floating rate THFX 6 months<br>Receiving fixed rate 1.6750%<br>Paying floating rate PRIBOR 6 months<br>Receiving fixed rate 1.6050%<br>Paying floating rate THFX 6 months<br>Receiving fixed rate 1.2900%<br>Paying floating rate WIBOR 6 months<br>Receiving fixed rate 7.2540%<br>Paying floating rate JIBAR 3 months<br>Receiving fixed rate 7.3100%<br>Paying floating rate MXN_28D 28 days | 24.000.000,00<br>2.000.000,00<br>32.000.000,00<br>9.000.000,00<br>25.000.000,00<br>10.000.000,00<br>45.000.000,00<br>10.000.000,00<br>47.200.000,00<br>6.000.000,00<br>13.000.000,00<br>25.000.000,00 | CZK<br>MYR<br>THB<br>MYR<br>CZK<br>THB<br>THB<br>CZK<br>THB<br>PLN<br>ZAR<br>MXN | (134.187,00)<br>(14.574,41)<br>(41.325,96)<br>(61.607,27)<br>(125.013,58)<br>(13.591,25)<br>(9.742,37)<br>(57.400,06)<br>(14.061,52)<br>(148.857,83)<br>(7.433,93)<br>(4.581,65) | 09.11.2025<br>06.11.2025<br>13.11.2030<br>12.01.2026<br>14.01.2026<br>03.02.2031<br>02.03.2031<br>02.03.2031<br>14.05.2031<br>09.08.2026<br>16.09.2031<br>01.10.2026 |
|  |   |  | <b>(632.376,83)</b>  |  |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>  |   |  |  |  |
| Paying floating rate BZDIOVRA1D<br>Receiving fixed rate 8.5150%  | (5.000.000,00)  | BRL  | (47.943,97)  | 02.01.2024   |
|  |   |  | <b>(47.943,97)</b>   |  |
|  |   |  | <b>(2.061.877,91)</b>  |  |

BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps, Devisenterminkontrakte und Zinsswaps 232.000,00 USD gezahlt.  
BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte und Zinsswaps 280.000,00 USD erhalten.  
Citibank Europe PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps, Devisenterminkontrakte und Zinsswaps 280.000,00 USD erhalten.  
Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps, Devisenterminkontrakte und Zinsswaps 700.000,00 USD gezahlt.  
J.P. Morgan SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps, Devisenterminkontrakte und Zinsswaps 152.000,00 USD erhalten.  
Morgan Stanley Europe SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Zinsswaps 410.000,00 USD erhalten.  
Société Générale hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte und Zinsswaps 170.000,00 USD gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              | 2.000.000,00       | Argentine Republic Governmen<br>MULTI 09-07-2046   | 642.500,00                 | 0,04                         |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              | 4.000.000,00       | Azure Power Energy Ltd 3.575%<br>19-08-2026        | 4.032.000,00               | 0,26                         |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              | 11.250.000,00      | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao 4.125%<br>20-09-2031   | 10.842.300,00              | 0,69                         |
| 5.000.000,00  | Arcelik AS 3% 27-05-2026                          | 5.518.882,43               | 0,35                         | 3.800.000,00       | Bahrain Government Internati<br>5.45% 16-09-2032   | 3.682.200,00               | 0,23                         |
| 7.000.000,00  | Benin Government Internation<br>4.95% 22-01-2035  | 7.560.585,99               | 0,48                         | 2.500.000,00       | Bahrain Government Internati<br>5.625% 18-05-2034  | 2.368.750,00               | 0,15                         |
| 3.000.000,00  | Chile Government Internation<br>0.555% 21-01-2029 | 3.364.378,25               | 0,21                         | 3.600.000,00       | Bahrain Government Internati<br>6.125% 01-08-2023  | 3.784.032,00               | 0,24                         |
| 340.000,00  | Croatia Government Internati 1.5%<br>17-06-2031   | 398.516,38                 | 0,03                         | 6.960.000,00       | Bahrain Government Internati<br>6.75% 20-09-2029   | 7.484.784,00               | 0,48                         |
| 390.000,00  | Croatia Government Internati<br>2.75% 27-01-2030  | 501.507,11                 | 0,03                         | 8.930.000,00       | Bahrain Government Internati 7%<br>12-10-2028      | 9.679.262,72               | 0,62                         |
| 610.000,00  | Egypt Government Internation<br>4.75% 11-04-2025  | 683.938,24                 | 0,04                         | 5.950.000,00       | Bahrain Government Internati 7%<br>26-01-2026      | 6.529.922,70               | 0,42                         |
| 700.000,00  | Egypt Government Internation<br>4.75% 16-04-2026  | 765.342,93                 | 0,05                         | 4.700.000,00       | Bahrain Government Internati<br>7.375% 14-05-2030  | 5.211.172,00               | 0,33                         |
| 1.450.000,00  | Egypt Government Internation<br>6.375% 11-04-2031 | 1.512.416,78               | 0,10                         | 6.740.000,00       | Bahrain Government Internati<br>7.5% 20-09-2047    | 6.810.096,00               | 0,43                         |
| 260.000,00  | Hungary Government Internati<br>1.625% 28-04-2032 | 307.440,63                 | 0,02                         | 7.000.000,00       | Banco General SA 4.125% 07-<br>08-2027             | 7.498.750,00               | 0,48                         |
| 3.000.000,00  | Indonesia Government Interna<br>1.3% 23-03-2034   | 3.286.225,40               | 0,21                         | 8.750.000,00       | Banco Colombia SA 3% 29-01-2025                    | 8.782.754,14               | 0,56                         |
| 880.000,00  | Prosus NV 2.031% 03-08-2032                       | 986.517,49                 | 0,06                         | 1.985.000,00       | Banque Centrale de Tunisie I<br>5.75% 30-01-2025   | 1.505.920,25               | 0,10                         |
| 370.000,00  | Senegal Government Internati<br>4.75% 13-03-2028  | 424.863,81                 | 0,03                         | 9.000.000,00       | BBVA Bancomer SA/Texas 5.125%<br>MULTI 18-01-2033  | 9.236.340,00               | 0,59                         |
| 1.000.000,00  | Senegal Government Internati<br>5.375% 08-06-2037 | 1.072.732,82               | 0,07                         | 400.000,00         | Brazilian Government Interna<br>2.625% 05-01-2023  | 407.000,00                 | 0,03                         |
| 170.000,00  | Ukraine Government Internati<br>4.375% 27-01-2030 | 154.483,27                 | 0,01                         | 8.900.000,00       | CAS Capital No 1 Ltd 4.000%<br>MULTI Perp FC2026   | 8.918.690,00               | 0,57                         |
| 1.220.000,00  | Ukraine Government Internati<br>6.75% 20-06-2026  | 1.312.232,84               | 0,08                         | 8.500.000,00       | Cemex SAB de CV 5.125% MULTI<br>Perp FC2026        | 8.818.750,00               | 0,56                         |
|   |   | <b>27.850.064,37</b>       | <b>1,77</b>                  | 1.500.000,00       | Chile Government Internation<br>2.45% 31-01-2031   | 1.483.995,00               | 0,09                         |
| <b>PEN</b>  |   |                            |                              | 12.200.000,00      | Chile Government Internation<br>2.55% 27-01-2032   | 12.175.600,00              | 0,77                         |
| 4.000.000,00  | Inter-American Development B<br>3.05% 07-02-2025  | 968.277,00                 | 0,06                         | 1.500.000,00       | Chile Government Internation<br>2.55% 27-07-2033   | 1.461.000,00               | 0,09                         |
|   |   | <b>968.277,00</b>          | <b>0,06</b>                  | 12.500.000,00      | Chile Government Internation 3.1%<br>07-05-2041    | 12.218.750,00              | 0,78                         |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              | 9.500.000,00       | Chile Government Internation 3.1%<br>22-01-2061    | 8.789.210,00               | 0,56                         |
| 9.400.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>1.625% 02-06-2028 | 9.284.756,00               | 0,59                         | 5.300.000,00       | Chile Government Internation<br>3.25% 21-09-2071   | 4.907.800,00               | 0,31                         |
| 4.000.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>1.7% 02-03-2031   | 3.888.000,00               | 0,25                         | 1.800.000,00       | Chile Government Internation<br>3.5% 15-04-2053    | 1.857.744,00               | 0,12                         |
| 2.000.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>2.5% 16-04-2025   | 2.075.000,00               | 0,13                         | 10.800.000,00      | Chile Government Internation<br>3.5% 25-01-2050    | 11.205.432,00              | 0,71                         |
| 4.000.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>2.7% 02-09-2070   | 3.638.832,00               | 0,23                         | 1.200.000,00       | Chile Government Internation<br>3.625% 30-10-2042  | 1.268.556,00               | 0,08                         |
| 2.500.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>3% 15-09-2051     | 2.500.500,00               | 0,16                         | 7.000.000,00       | Colbun SA 3.15% 19-01-2032                         | 6.926.500,00               | 0,44                         |
| 4.500.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>3.125% 03-05-2026 | 4.787.019,00               | 0,30                         | 870.000,00         | Colombia Government Internat<br>10.375% 28-01-2033 | 1.250.625,00               | 0,08                         |
| 7.500.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>3.125% 11-10-2027 | 8.054.265,00               | 0,51                         | 1.800.000,00       | Colombia Government Internat<br>3.25% 22-04-2032   | 1.615.500,00               | 0,10                         |
| 5.000.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>3.125% 16-04-2030 | 5.415.900,00               | 0,34                         | 3.500.000,00       | Colombia Government Internat<br>4.125% 22-02-2042  | 2.922.500,00               | 0,19                         |
| 6.440.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>3.125% 30-09-2049 | 6.578.138,00               | 0,42                         | 4.800.000,00       | Colombia Government Internat<br>5.2% 15-05-2049    | 4.399.488,00               | 0,28                         |
| 8.075.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>3.875% 16-04-2050 | 9.405.049,40               | 0,60                         | 4.320.000,00       | Colombia Government Internat<br>5.625% 26-02-2044  | 4.177.872,00               | 0,27                         |
| 4.000.000,00  | Abu Dhabi Government Interna<br>4.125% 11-10-2047 | 4.787.384,00               | 0,30                         | 5.745.000,00       | Colombia Government Internat<br>6.125% 18-01-2041  | 5.902.987,50               | 0,38                         |
| 6.100.000,00  | Access Bank PLC 6.125% 21-09-<br>2026             | 6.069.500,00               | 0,39                         | 200.000,00         | Dominican Republic Internati 4.5%<br>30-01-2030    | 203.202,00                 | 0,01                         |
| 10.400.000,00   | Angolan Government Internati 8%<br>26-11-2029     | 10.241.504,00              | 0,65                         | 2.100.000,00       | Dominican Republic Internati 5.5%<br>27-01-2025    | 2.270.121,00               | 0,14                         |
| 9.900.000,00  | Angolan Government Internati<br>8.25% 09-05-2028  | 9.931.086,00               | 0,63                         | 860.000,00         | Dominican Republic Internati<br>5.875% 30-01-2060  | 825.600,00                 | 0,05                         |
| 9.400.000,00  | Angolan Government Internati<br>9.125% 26-11-2049 | 9.007.644,00               | 0,57                         | 3.010.000,00       | Dominican Republic Internati 6%<br>19-07-2028      | 3.350.160,10               | 0,21                         |
| 9.800.000,00  | Angolan Government Internati<br>9.375% 08-05-2048 | 9.575.972,00               | 0,61                         | 1.500.000,00       | Dominican Republic Internati 6.5%<br>15-02-2048    | 1.590.000,00               | 0,10                         |
| 2.800.000,00  | Angolan Government Internati<br>9.5% 12-11-2025   | 2.993.312,00               | 0,19                         | 990.000,00         | Dominican Republic Internati<br>6.85% 27-01-2045   | 1.090.237,50               | 0,07                         |
| 10.300.000,00   | Antofagasta PLC 2.375% 14-10-<br>2030             | 9.797.978,00               | 0,62                         | 1.970.000,00       | Dominican Republic Internati<br>6.875% 29-01-2026  | 2.243.849,70               | 0,14                         |
| 1.788.590,00  | Argentine Republic Governmen<br>1% 09-07-2029     | 643.892,40                 | 0,04                         | 2.149.031,00       | Ecuador Government Internati<br>31-07-2030         | 1.195.398,49               | 0,08                         |
| 12.844.092,00   | Argentine Republic Governmen<br>MULTI 09-07-2030  | 4.482.588,11               | 0,29                         | 13.674.250,00      | Ecuador Government Internati<br>MULTI 31-07-2030   | 11.264.163,44              | 0,72                         |
| 15.961.705,00   | Argentine Republic Governmen<br>MULTI 09-07-2035  | 5.067.841,34               | 0,32                         |                    |  |                            |                              |
| 9.500.000,00  | Argentine Republic Governmen<br>MULTI 09-07-2041  | 3.348.750,00               | 0,21                         |                    |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 23.343.563,00      | Ecuador Government Internati<br>MULTI 31-07-2035   | 15.114.957,04              | 0,96                         | 2.000.000,00       | Hungary Government Internati<br>2.125% 22-09-2031   | 1.968.000,00               | 0,13                         |
| 18.489.110,00      | Ecuador Government Internati<br>MULTI 31-07-2040   | 10.677.461,03              | 0,68                         | 1.000.000,00       | Hungary Government Internati<br>7.625% 29-03-2041   | 1.633.224,00               | 0,10                         |
| 200.000,00         | Egypt Government Internation<br>4.55% 20-11-2023   | 204.600,00                 | 0,01                         | 5.800.000,00       | IHS Holding Ltd 6.25% 29-11-2028                    | 5.872.500,00               | 0,37                         |
| 3.700.000,00       | Egypt Government Internation<br>5.25% 06-10-2025   | 3.728.342,00               | 0,24                         | 2.800.000,00       | IHS Netherlands Holdco BV 8%<br>18-09-2027          | 2.962.456,00               | 0,19                         |
| 1.200.000,00       | Egypt Government Internation<br>5.577% 21-02-2023  | 1.241.856,00               | 0,08                         | 1.000.000,00       | Indonesia Government Interna<br>2.85% 14-02-2030    | 1.042.239,50               | 0,07                         |
| 4.000.000,00       | Egypt Government Internation<br>5.875% 16-02-2031  | 3.541.120,00               | 0,23                         | 4.300.000,00       | Indonesia Government Interna<br>3.85% 15-10-2030    | 4.829.183,80               | 0,31                         |
| 2.700.000,00       | Egypt Government Internation<br>6.588% 21-02-2028  | 2.624.157,00               | 0,17                         | 1.000.000,00       | Indonesia Government Interna<br>3.85% 18-07-2027    | 1.093.285,53               | 0,07                         |
| 1.400.000,00       | Egypt Government Internation<br>6.875% 30-04-2040  | 1.179.668,00               | 0,08                         | 1.900.000,00       | Indonesia Government Interna<br>4.1% 24-04-2028     | 2.119.139,94               | 0,13                         |
| 2.000.000,00       | Egypt Government Internation<br>7.0529% 15-01-2032 | 1.844.100,00               | 0,12                         | 2.000.000,00       | Indonesia Government Interna<br>4.2% 15-10-2050     | 2.282.581,38               | 0,15                         |
| 1.500.000,00       | Egypt Government Internation<br>7.3% 30-09-2033    | 1.380.060,00               | 0,09                         | 2.020.000,00       | Indonesia Government Interna<br>4.625% 15-04-2043   | 2.371.809,54               | 0,15                         |
| 1.000.000,00       | Egypt Government Internation<br>7.5% 16-02-2061    | 815.070,00                 | 0,05                         | 2.000.000,00       | Indonesia Government Interna<br>4.75% 11-02-2029    | 2.328.137,50               | 0,15                         |
| 1.650.000,00       | Egypt Government Internation<br>7.5% 31-01-2027    | 1.716.165,00               | 0,11                         | 3.000.000,00       | Indonesia Government Interna<br>5.125% 15-01-2045   | 3.732.471,12               | 0,24                         |
| 3.940.000,00       | Egypt Government Internation<br>7.6003% 01-03-2029 | 3.905.170,40               | 0,25                         | 3.360.000,00       | Indonesia Government Interna<br>5.25% 17-01-2042    | 4.202.755,77               | 0,27                         |
| 6.300.000,00       | Egypt Government Internation<br>7.625% 29-05-2032  | 5.959.674,00               | 0,38                         | 1.600.000,00       | Indonesia Government Interna<br>5.35% 11-02-2049    | 2.096.530,69               | 0,13                         |
| 200.000,00         | Egypt Government Internation<br>7.903% 21-02-2048  | 167.408,00                 | 0,01                         | 420.000,00         | Indonesia Government Interna<br>5.95% 08-01-2046    | 580.970,99                 | 0,04                         |
| 200.000,00         | Egypt Government Internation<br>8.15% 20-11-2059   | 170.540,00                 | 0,01                         | 3.070.000,00       | Indonesia Government Interna<br>6.625% 17-02-2037   | 4.279.856,30               | 0,27                         |
| 3.923.000,00       | Egypt Government Internation<br>8.5% 31-01-2047    | 3.471.133,17               | 0,22                         | 2.200.000,00       | Indonesia Government Interna<br>6.75% 15-01-2044    | 3.258.017,07               | 0,21                         |
| 1.760.000,00       | Egypt Government Internation<br>8.7002% 01-03-2049 | 1.561.225,60               | 0,10                         | 2.660.000,00       | Indonesia Government Interna<br>7.75% 17-01-2038    | 4.055.459,38               | 0,26                         |
| 600.000,00         | Egypt Government Internation<br>8.75% 30-09-2051   | 535.740,00                 | 0,03                         | 1.980.000,00       | Indonesia Government Interna<br>8.5% 12-10-2035     | 3.163.237,09               | 0,20                         |
| 2.900.000,00       | Egypt Government Internation<br>8.875% 29-05-2050  | 2.629.140,00               | 0,17                         | 10.500.000,00      | Itau Unibanco Holding S 3.875%<br>MULTI 15-04-2031  | 10.052.385,00              | 0,64                         |
| 5.070.000,00       | Emirate of Dubai Government<br>5.25% 30-01-2043    | 5.843.154,72               | 0,37                         | 11.500.000,00      | Ivory Coast Government Inter<br>6.125% 15-06-2033   | 12.103.750,00              | 0,77                         |
| 3.800.000,00       | Finance Department Governmen<br>4% 28-07-2050      | 3.430.792,00               | 0,22                         | 9.250.000,00       | Ivory Coast Government Inter<br>6.375% 03-03-2028   | 10.032.550,00              | 0,64                         |
| 3.000.000,00       | Georgia Global Utilities JSC 7.75%<br>30-07-2025   | 3.164.776,38               | 0,20                         | 1.220.000,00       | Ivory Coast Government Inter<br>MULTI 31-12-2032    | 803.684,96                 | 0,05                         |
| 1.000.000,00       | Georgia Government Internati<br>2.75% 22-04-2026   | 994.700,00                 | 0,06                         | 1.970.000,00       | Jamaica Government Internati<br>6.75% 28-04-2028    | 2.255.650,00               | 0,14                         |
| 910.000,00         | Ghana Government Internation<br>10.75% 14-10-2030  | 1.017.343,60               | 0,06                         | 3.480.000,00       | Jamaica Government Internati<br>7.875% 28-07-2045   | 4.819.800,00               | 0,31                         |
| 4.840.000,00       | Ghana Government Internation<br>6.375% 11-02-2027  | 4.074.989,60               | 0,26                         | 2.540.000,00       | Jamaica Government Internati 8%<br>15-03-2039       | 3.517.900,00               | 0,22                         |
| 2.000.000,00       | Ghana Government Internation<br>7.625% 16-05-2029  | 1.664.600,00               | 0,11                         | 1.000.000,00       | Jordan Government Internatio<br>5.75% 31-01-2027    | 1.050.080,00               | 0,07                         |
| 2.500.000,00       | Ghana Government Internation<br>7.75% 07-04-2029   | 2.089.990,00               | 0,13                         | 500.000,00         | Jordan Government Internatio<br>5.85% 07-07-2030    | 505.065,00                 | 0,03                         |
| 1.995.000,00       | Ghana Government Internation<br>7.875% 26-03-2027  | 1.751.462,37               | 0,11                         | 2.200.000,00       | Jordan Government Internatio<br>6.125% 29-01-2026   | 2.343.000,00               | 0,15                         |
| 3.470.000,00       | Ghana Government Internation<br>8.125% 18-01-2026  | 3.201.075,00               | 0,20                         | 3.090.000,00       | Jordan Government Internatio<br>7.375% 10-10-2047   | 3.120.096,60               | 0,20                         |
| 7.300.000,00       | Ghana Government Internation<br>8.125% 26-03-2032  | 5.958.771,00               | 0,38                         | 1.000.000,00       | Kazakhstan Government Intern<br>3.875% 14-10-2024   | 1.071.940,00               | 0,07                         |
| 2.500.000,00       | Ghana Government Internation<br>8.625% 07-04-2034  | 2.028.590,00               | 0,13                         | 6.257.000,00       | Kazakhstan Government Intern<br>4.875% 14-10-2044   | 7.678.290,06               | 0,49                         |
| 1.750.000,00       | Ghana Government Internation<br>8.627% 16-06-2049  | 1.383.812,50               | 0,09                         | 3.000.000,00       | Kazakhstan Government Intern<br>5.125% 21-07-2025   | 3.377.628,00               | 0,21                         |
| 1.160.000,00       | Ghana Government Internation<br>8.75% 11-03-2061   | 918.256,00                 | 0,06                         | 9.770.000,00       | Kazakhstan Government Intern<br>6.5% 21-07-2045     | 14.012.602,96              | 0,89                         |
| 1.400.000,00       | Ghana Government Internation<br>8.875% 07-05-2042  | 1.132.376,00               | 0,07                         | 2.600.000,00       | Klabin Austria GmbH 3.2% 12-<br>01-2031             | 2.408.250,00               | 0,15                         |
| 6.490.000,00       | Ghana Government Internation<br>8.95% 26-03-2051   | 5.185.510,00               | 0,33                         | 5.550.000,00       | Klabin Austria GmbH 5.75%<br>03-04-2029             | 6.063.375,00               | 0,39                         |
| 11.100.000,00      | Greenko Power II Ltd 4.3% 13-<br>12-2028           | 11.266.500,00              | 0,72                         | 5.900.000,00       | Klabin Austria GmbH 7% 03-<br>04-2049               | 6.807.125,00               | 0,43                         |
| 6.640.000,00       | Grupo Energia Bogota SA ESP<br>4.875% 15-05-2030   | 7.154.600,00               | 0,46                         | 2.500.000,00       | Lebanon Government Internati 7%<br>23-03-2032       | 262.500,00                 | 0,02                         |
| 1.500.000,00       | Guatemala Government Bond<br>4.9% 01-06-2030       | 1.608.750,00               | 0,10                         | 2.800.000,00       | Lebanon Government<br>International Bond 03-11-2028 | 289.856,00                 | 0,02                         |
| 1.990.000,00       | Guatemala Government Bond<br>6.125% 01-06-2050     | 2.278.550,00               | 0,14                         | 2.820.000,00       | Lebanon Government<br>International Bond 04-10-2022 | 287.775,36                 | 0,02                         |
| 9.900.000,00       | Hikma Finance USA LLC 3.25%<br>09-07-2025          | 10.158.984,00              | 0,65                         | 900.000,00         | Lebanon Government<br>International Bond 04-11-2024 | 94.500,00                  | 0,01                         |
| 8.100.000,00       | HTA Group Ltd/Mauritius 7%<br>18-12-2025           | 8.432.100,00               | 0,54                         | 3.000.000,00       | Lebanon Government<br>International Bond 12-04-2099 | 308.100,00                 | 0,02                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                     | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 3.640.000,00       | Lebanon Government International Bond 22-04-2024 | 382.200,00                 | 0,02                         | 5.000.000,00       | Paraguay Government Internat 4.95% 28-04-2031  | 5.605.050,00               | 0,36                         |
| 2.300.000,00       | Lebanon Government International Bond 23-03-2027 | 241.500,00                 | 0,02                         | 6.005.000,00       | Paraguay Government Internat 5.4% 30-03-2050   | 6.845.700,00               | 0,44                         |
| 1.000.000,00       | Lebanon Government International Bond 23-03-2037 | 106.224,00                 | 0,01                         | 6.500.000,00       | Paraguay Government Internat 5.6% 13-03-2048   | 7.507.500,00               | 0,48                         |
| 1.200.000,00       | Lebanon Government International Bond 26-02-2025 | 122.544,00                 | 0,01                         | 6.500.000,00       | Perusahaan Penerbit SBSN Ind 2.8% 23-06-2030   | 6.698.055,00               | 0,43                         |
| 2.750.000,00       | Lebanon Government International Bond 26-02-2030 | 282.150,00                 | 0,02                         | 3.000.000,00       | Perusahaan Penerbit SBSN Ind 3.55% 09-06-2051  | 3.060.120,00               | 0,19                         |
| 2.076.000,00       | Lebanon Government International Bond 27-01-2023 | 213.994,08                 | 0,01                         | 2.000.000,00       | Perusahaan Penerbit SBSN Ind 3.8% 23-06-2050   | 2.093.040,00               | 0,13                         |
| 2.530.000,00       | Lebanon Government International Bond 27-11-2026 | 265.650,00                 | 0,02                         | 1.000.000,00       | Peruvian Government Internat 2.844% 20-06-2030 | 1.009.800,00               | 0,06                         |
| 1.900.000,00       | Lebanon Government International Bond 29-11-2027 | 199.500,00                 | 0,01                         | 500.000,00         | Peruvian Government Internat 3% 15-01-2034     | 498.750,00                 | 0,03                         |
| 7.000.000,00       | Lenovo Group Ltd 3.421% 02-11-2030               | 7.087.632,09               | 0,45                         | 2.000.000,00       | Peruvian Government Internat 3.3% 11-03-2041   | 1.982.500,00               | 0,13                         |
| 2.330.000,00       | Malaysia Sovereign Sukuk Bhd 4.236% 22-04-2045   | 2.896.978,68               | 0,18                         | 1.500.000,00       | Peruvian Government Internat 3.6% 15-01-2072   | 1.460.250,00               | 0,09                         |
| 250.000,00         | Malaysia Sukuk Global Bhd 4.08% 27-04-2046       | 303.862,91                 | 0,02                         | 2.500.000,00       | Peruvian Government Internat 4.125% 25-08-2027 | 2.750.000,00               | 0,17                         |
| 6.600.000,00       | Malaysia Wakala Sukuk Bhd 2.07% 28-04-2031       | 6.586.074,00               | 0,42                         | 6.000.000,00       | Peruvian Government Internat 5.625% 18-11-2050 | 8.412.000,00               | 0,54                         |
| 3.500.000,00       | Mexico Government Internatio 3.771% 24-05-2061   | 3.206.490,00               | 0,20                         | 1.900.000,00       | Philippine Government Intern 3.2% 06-07-2046   | 1.930.548,58               | 0,12                         |
| 8.960.000,00       | Mexico Government Internatio 4.5% 31-01-2050     | 9.497.600,00               | 0,60                         | 630.000,00         | Philippine Government Intern 5% 13-01-2037     | 782.634,42                 | 0,05                         |
| 1.000.000,00       | Mexico Government Internatio 6.75% 27-09-2034    | 1.340.000,00               | 0,09                         | 2.310.000,00       | Philippine Government Intern 6.375% 23-10-2034 | 3.209.446,73               | 0,20                         |
| 6.180.000,00       | Mexico Government Internatio 7.5% 08-04-2033     | 8.641.185,00               | 0,55                         | 2.180.000,00       | Philippine Government Intern 9.5% 02-02-2030   | 3.383.294,95               | 0,22                         |
| 9.405.000,00       | Millicom International Cellu 4.5% 27-04-2031     | 9.475.631,55               | 0,60                         | 440.000,00         | Prosus NV 3.68% 21-01-2030                     | 453.146,64                 | 0,03                         |
| 2.500.000,00       | Mongolia Government Internat 4.45% 07-07-2031    | 2.366.776,28               | 0,15                         | 4.000.000,00       | Prosus NV 3.832% 08-02-2051                    | 3.730.201,48               | 0,24                         |
| 1.400.000,00       | Mongolia Government Internat 5.125% 07-04-2026   | 1.431.445,71               | 0,09                         | 2.700.000,00       | Prosus NV 4.027% 03-08-2050                    | 2.592.525,80               | 0,16                         |
| 1.776.000,00       | Mongolia Government Internat 5.625% 01-05-2023   | 1.827.091,01               | 0,12                         | 1.000.000,00       | Qatar Government Internation 3.25% 02-06-2026  | 1.065.000,00               | 0,07                         |
| 2.500.000,00       | Morocco Government Internati 2.375% 15-12-2027   | 2.434.375,00               | 0,15                         | 4.000.000,00       | Qatar Government Internation 3.375% 14-03-2024 | 4.188.320,00               | 0,27                         |
| 1.000.000,00       | Morocco Government Internati 4% 15-12-2050       | 906.250,00                 | 0,06                         | 7.500.000,00       | Qatar Government Internation 3.75% 16-04-2030  | 8.409.750,00               | 0,54                         |
| 6.360.000,00       | Morocco Government Internati 5.5% 11-12-2042     | 7.013.172,00               | 0,45                         | 4.500.000,00       | Qatar Government Internation 4% 14-03-2029     | 5.069.610,00               | 0,32                         |
| 1.440.000,00       | Namibia International Bonds 5.25% 29-10-2025     | 1.510.272,00               | 0,10                         | 3.680.000,00       | Qatar Government Internation 4.4% 16-04-2050   | 4.571.884,80               | 0,29                         |
| 2.800.000,00       | Network i2i Ltd 3.975% MULTI Perp FC2026         | 2.807.000,00               | 0,18                         | 3.450.000,00       | Qatar Government Internation 4.5% 23-04-2028   | 3.961.393,50               | 0,25                         |
| 8.500.000,00       | Network i2i Ltd 5.650% MULTI Perp FC2025         | 8.925.000,00               | 0,57                         | 5.500.000,00       | Qatar Government Internation 4.817% 14-03-2049 | 7.208.520,00               | 0,46                         |
| 4.200.000,00       | Oman Government Internationa 4.125% 17-01-2023   | 4.268.250,00               | 0,27                         | 10.000.000,00      | Qatar Government Internation 5.103% 23-04-2048 | 13.530.800,00              | 0,86                         |
| 10.960.000,00      | Oman Government Internationa 4.75% 15-06-2026    | 11.274.310,88              | 0,72                         | 1.000.000,00       | Qatar Government Internation 5.75% 20-01-2042  | 1.401.500,00               | 0,09                         |
| 11.100.000,00      | Oman Government Internationa 5.375% 08-03-2027   | 11.622.255,00              | 0,74                         | 2.000.000,00       | Qatar Government Internation 6.4% 20-01-2040   | 2.944.780,00               | 0,19                         |
| 11.900.000,00      | Oman Government Internationa 5.625% 17-01-2028   | 12.614.000,00              | 0,80                         | 2.257.000,00       | Qatar Government Internation 9.75% 15-06-2030  | 3.538.005,49               | 0,23                         |
| 4.800.000,00       | Oman Government Internationa 6% 01-08-2029       | 5.165.856,00               | 0,33                         | 5.700.000,00       | ReNew Power Pvt Ltd 5.875% 05-03-2027          | 5.917.950,90               | 0,38                         |
| 3.500.000,00       | Oman Government Internationa 6.25% 25-01-2031    | 3.823.155,00               | 0,24                         | 5.500.000,00       | ReNew Wind Energy AP2 / ReNe 4.5% 14-07-2028   | 5.519.477,76               | 0,35                         |
| 4.475.000,00       | Oman Government Internationa 6.5% 08-03-2047     | 4.434.277,50               | 0,28                         | 1.500.000,00       | Republic of Armenia Internat 3.6% 02-02-2031   | 1.397.430,00               | 0,09                         |
| 12.800.000,00      | Oman Government Internationa 6.75% 17-01-2048    | 13.006.080,00              | 0,83                         | 1.100.000,00       | Republic of Armenia Internat 3.95% 26-09-2029  | 1.067.000,00               | 0,07                         |
| 4.000.000,00       | Oman Government Internationa 6.75% 28-10-2027    | 4.480.000,00               | 0,29                         | 800.000,00         | Republic of Armenia Internat 7.15% 26-03-2025  | 891.526,40                 | 0,06                         |
| 1.600.000,00       | Oman Government Internationa 7% 25-01-2051       | 1.673.280,00               | 0,11                         | 2.700.000,00       | Republic of Kenya Government 6.3% 23-01-2034   | 2.646.108,00               | 0,17                         |
| 5.600.000,00       | Oman Government Internationa 7.375% 28-10-2032   | 6.524.224,00               | 0,42                         | 7.940.000,00       | Republic of Kenya Government 6.875% 24-06-2024 | 8.386.450,32               | 0,53                         |
| 3.000.000,00       | Panama Government Internatio 2.252% 29-09-2032   | 2.850.000,00               | 0,18                         | 930.000,00         | Republic of Kenya Government 7% 22-05-2027     | 980.917,50                 | 0,06                         |
| 2.500.000,00       | Panama Government Internatio 3.16% 23-01-2030    | 2.587.500,00               | 0,16                         | 5.910.000,00       | Republic of Kenya Government 7.25% 28-02-2028  | 6.358.273,50               | 0,40                         |
| 400.000,00         | Panama Government Internatio 3.75% 16-03-2025    | 423.604,00                 | 0,03                         | 8.190.000,00       | Republic of Kenya Government 8% 22-05-2032     | 8.932.341,60               | 0,57                         |
| 500.000,00         | Panama Government Internatio 3.875% 17-03-2028   | 539.255,00                 | 0,03                         | 2.620.000,00       | Republic of Kenya Government 8.25% 28-02-2048  | 2.659.169,00               | 0,17                         |
| 2.300.000,00       | Panama Government Internatio 4.3% 29-04-2053     | 2.466.773,00               | 0,16                         | 500.000,00         | Republic of Poland Governmen 4% 22-01-2024     | 528.886,00                 | 0,03                         |
|                    |  |                            |                              | 6.000.000,00       | Republic of South Africa Gov 4.85% 27-09-2027  | 6.318.000,00               | 0,40                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 6.000.000,00       | Republic of South Africa Gov 4.85% 30-09-2029  | 6.195.000,00               | 0,39                         | 1.700.000,00       | Turkey Government Internatio 5.75% 22-03-2024   | 1.657.785,60               | 0,11                         |
| 2.000.000,00       | Republic of South Africa Gov 4.875% 14-04-2026 | 2.131.000,00               | 0,14                         | 4.000.000,00       | Turkey Government Internatio 5.875% 26-06-2031  | 3.547.477,60               | 0,23                         |
| 600.000,00         | Republic of South Africa Gov 5% 12-10-2046     | 543.000,00                 | 0,03                         | 2.500.000,00       | Turkey Government Internatio 5.95% 15-01-2031   | 2.233.610,00               | 0,14                         |
| 3.990.000,00       | Republic of South Africa Gov 5.65% 27-09-2047  | 3.822.659,40               | 0,24                         | 2.090.000,00       | Turkey Government Internatio 6% 14-01-2041  | 1.734.700,00               | 0,11                         |
| 5.000.000,00       | Republic of South Africa Gov 5.75% 30-09-2049  | 4.801.000,00               | 0,31                         | 600.000,00         | Turkey Government Internatio 6% 25-03-2027  | 564.838,80                 | 0,04                         |
| 2.740.000,00       | Republic of South Africa Gov 6.3% 22-06-2048   | 2.842.750,00               | 0,18                         | 720.000,00         | Turkey Government Internatio 6.35% 10-08-2024   | 707.011,20                 | 0,04                         |
| 4.000.000,00       | Republic of Uzbekistan Inter 3.7% 25-11-2030   | 3.836.400,00               | 0,24                         | 2.454.000,00       | Turkey Government Internatio 6.625% 17-02-2045  | 2.165.041,50               | 0,14                         |
| 18.000.000,00      | Republic of Uzbekistan Inter 3.9% 19-10-2031   | 17.226.000,00              | 1,10                         | 4.136.000,00       | Turkey Government Internatio 6.875% 17-03-2036  | 3.877.500,00               | 0,25                         |
| 2.000.000,00       | Republic of Uzbekistan Inter 5.375% 20-02-2029 | 2.126.460,00               | 0,14                         | 300.000,00         | Turkey Government Internatio 7.25% 05-03-2038   | 290.248,20                 | 0,02                         |
| 2.000.000,00       | Romanian Government Internat 3% 14-02-2031     | 2.028.228,00               | 0,13                         | 240.000,00         | Turkey Government Internatio 7.25% 23-12-2023   | 242.827,20                 | 0,02                         |
| 3.200.000,00       | Romanian Government Internat 4% 14-02-2051     | 3.192.665,60               | 0,20                         | 4.130.000,00       | Turkey Government Internatio 7.375% 05-02-2025  | 4.155.672,08               | 0,26                         |
| 3.500.000,00       | Romanian Government Internat 4.875% 22-01-2024 | 3.728.557,00               | 0,24                         | 3.000.000,00       | Turkey Government Internatio 7.625% 26-04-2029  | 2.998.848,00               | 0,19                         |
| 2.500.000,00       | Romanian Government Internat 5.125% 15-06-2048 | 2.946.625,00               | 0,19                         | 4.200.000,00       | Ukraine Government Internati 6.876% 21-05-2029  | 3.713.337,60               | 0,24                         |
| 2.000.000,00       | Romanian Government Internat 6.125% 22-01-2044 | 2.622.352,00               | 0,17                         | 5.800.000,00       | Ukraine Government Internati 7.253% 15-03-2033  | 5.104.000,00               | 0,32                         |
| 8.000.000,00       | Rumo Luxembourg Sarl 4.2% 18-01-2032           | 7.550.000,00               | 0,48                         | 5.795.000,00       | Ukraine Government Internati 7.375% 25-09-2032  | 5.159.056,70               | 0,33                         |
| 1.000.000,00       | Rumo Luxembourg Sarl 5.25% 10-01-2028          | 1.029.000,00               | 0,07                         | 1.958.000,00       | Ukraine Government Internati 7.75% 01-09-2023   | 1.913.733,54               | 0,12                         |
| 5.800.000,00       | Rumo Luxembourg Sarl 5.875% 18-01-2025         | 5.966.808,00               | 0,38                         | 1.500.000,00       | Ukraine Government Internati 7.75% 01-09-2024   | 1.452.702,00               | 0,09                         |
| 2.000.000,00       | Russian Foreign Bond - Eurob 5.1% 28-03-2035   | 2.357.700,00               | 0,15                         | 2.770.000,00       | Ukraine Government Internati 7.75% 01-09-2025   | 2.654.906,50               | 0,17                         |
| 1.600.000,00       | Russian Foreign Bond - Eurob 5.625% 04-04-2042 | 2.085.408,00               | 0,13                         | 1.550.000,00       | Ukraine Government Internati 7.75% 01-09-2026   | 1.476.951,60               | 0,09                         |
| 3.200.000,00       | Rwanda International Governm 5.5% 09-08-2031   | 3.223.680,00               | 0,21                         | 2.286.000,00       | Ukraine Government Internati 7.75% 01-09-2027   | 2.165.985,00               | 0,14                         |
| 10.960.000,00      | Senegal Government Internati 6.25% 23-05-2033  | 11.280.601,92              | 0,72                         | 2.770.000,00       | Ukraine Government Internati 8.994% 01-02-2024  | 2.760.426,88               | 0,18                         |
| 2.240.000,00       | Senegal Government Internati 6.75% 13-03-2048  | 2.193.856,00               | 0,14                         | 2.515.000,00       | Ukraine Government Internati 9.75% 01-11-2028   | 2.539.978,98               | 0,16                         |
| 1.600.000,00       | Sri Lanka Government Interna 5.75% 18-04-2023  | 891.232,00                 | 0,06                         | 1.454.000,00       | Ukraine Government Internati MULTI 31-05-2040   | 1.321.686,00               | 0,08                         |
| 3.110.000,00       | Sri Lanka Government Interna 5.875% 25-07-2022 | 2.106.589,60               | 0,13                         | 8.200.000,00       | UltraTech Cement Ltd 2.8% 16-02-2031  | 7.920.216,00               | 0,50                         |
| 1.800.000,00       | Sri Lanka Government Interna 6.125% 03-06-2025 | 933.246,00                 | 0,06                         | 430.000,00         | Uruguay Government Internati 4.125% 20-11-2045  | 510.199,30                 | 0,03                         |
| 2.870.000,00       | Sri Lanka Government Interna 6.2% 11-05-2027   | 1.443.208,20               | 0,09                         | 340.000,00         | Uruguay Government Internati 6.875% 28-09-2025  | 391.000,00                 | 0,02                         |
| 1.000.000,00       | Sri Lanka Government Interna 6.35% 28-06-2024  | 520.860,00                 | 0,03                         | 1.790.000,00       | Uruguay Government Internati 7.625% 21-03-2036  | 2.705.137,50               | 0,17                         |
| 2.200.000,00       | Sri Lanka Government Interna 6.75% 18-04-2028  | 1.104.312,00               | 0,07                         | 850.000,00         | Uruguay Government Internati 7.875% 15-01-2033  | 1.255.875,00               | 0,08                         |
| 2.000.000,00       | Sri Lanka Government Interna 6.825% 18-07-2026 | 1.009.800,00               | 0,06                         | 1.000.000,00       | Vietnam Government Internati 4.8% 19-11-2024  | 1.082.389,00               | 0,07                         |
| 3.270.000,00       | Sri Lanka Government Interna 6.85% 14-03-2024  | 1.705.599,30               | 0,11                         |                    |   | <b>1.176.346.321,40</b>    | <b>74,84</b>                 |
| 2.820.000,00       | Sri Lanka Government Interna 7.55% 28-03-2030  | 1.395.900,00               | 0,09                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>1.205.164.662,77</b>    | <b>76,68</b>                 |
| 3.930.000,00       | Sri Lanka Government Interna 7.85% 14-03-2029  | 1.969.480,20               | 0,13                         |                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>1.205.164.662,77</b>    | <b>76,68</b>                 |
| 1.700.000,00       | Trinidad & Tobago Government 4.375% 16-01-2024 | 1.734.000,00               | 0,11                         |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
| 2.810.000,00       | Trinidad & Tobago Government 4.5% 04-08-2026   | 2.873.225,00               | 0,18                         |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
| 1.300.000,00       | Trinidad & Tobago Government 4.5% 26-06-2030   | 1.316.900,00               | 0,08                         |                    | <b>CNY</b>  |                            |                              |
| 4.100.000,00       | Turkcell İletişim Hizmetleri 5.75% 15-10-2025  | 4.036.450,00               | 0,26                         | 190.000.000,00     | China Government Bond 2.68% 21-05-2030  | 29.339.617,34              | 1,87                         |
| 5.000.000,00       | Turkcell İletişim Hizmetleri 5.8% 11-04-2028   | 4.788.000,00               | 0,30                         | 90.000.000,00      | China Government Bond 3.13% 21-11-2029  | 14.395.439,67              | 0,92                         |
| 800.000,00         | Turkey Government Internatio 3.25% 23-03-2023  | 776.537,60                 | 0,05                         |                    |   | <b>43.735.057,01</b>       | <b>2,78</b>                  |
| 350.000,00         | Turkey Government Internatio 4.25% 13-03-2025  | 322.875,00                 | 0,02                         |                    | <b>EGP</b>  |                            |                              |
| 1.000.000,00       | Turkey Government Internatio 4.75% 26-01-2026  | 915.840,00                 | 0,06                         | 313.500.000,00     | Egypt Treasury Bills 01-02-2022   | 19.790.045,90              | 1,26                         |
| 4.000.000,00       | Turkey Government Internatio 4.875% 16-04-2043 | 3.060.000,00               | 0,19                         | 412.000.000,00     | Egypt Treasury Bills 12-07-2022   | 24.680.191,78              | 1,57                         |
| 4.140.000,00       | Turkey Government Internatio 5.75% 11-05-2047  | 3.336.840,00               | 0,21                         | 283.000.000,00     | Egypt Treasury Bills 18-01-2022   | 17.938.309,16              | 1,14                         |
|                    |  |                            |                              |                    |   | <b>62.408.546,84</b>       | <b>3,97</b>                  |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>USD</b>         |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 9.400.000,00       | Argentine Republic Governmen<br>MULTI 09-01-2038  | 3.548.500,00               | 0,23                         | 5.500.000,00       | Peruvian Government Internat<br>2.78% 01-12-2060  | 4.796.880,00               | 0,31                         |
| 1.000.000,00       | Barbados Government Internat<br>6.5% 01-10-2029   | 997.500,00                 | 0,06                         | 8.600.000,00       | Peruvian Government Internat<br>2.783% 23-01-2031   | 8.535.500,00               | 0,54                         |
| 400.000,00         | Brazilian Government Interna<br>4.25% 07-01-2025  | 423.500,00                 | 0,03                         | 5.000.000,00       | Peruvian Government Internat<br>7.35% 21-07-2025  | 5.956.250,00               | 0,38                         |
| 800.000,00         | Brazilian Government Interna<br>4.625% 13-01-2028 | 835.600,00                 | 0,05                         | 2.900.000,00       | Philippine Government Intern<br>2.65% 10-12-2045  | 2.744.621,92               | 0,17                         |
| 400.000,00         | Brazilian Government Interna 5%<br>27-01-2045     | 374.800,00                 | 0,02                         | 1.240.000,00       | Philippine Government Intern<br>2.95% 05-05-2045  | 1.223.262,62               | 0,08                         |
| 800.000,00         | Brazilian Government Interna<br>5.625% 21-02-2047 | 792.000,00                 | 0,05                         | 200.000,00         | Philippine Government Intern<br>3.7% 01-03-2041   | 218.478,08                 | 0,01                         |
| 2.000.000,00       | Chile Government Internation<br>3.125% 21-01-2026 | 2.105.000,00               | 0,13                         | 4.960.000,00       | Philippine Government Intern<br>3.7% 02-02-2042   | 5.400.984,77               | 0,34                         |
| 1.500.000,00       | Chile Government Internation<br>3.86% 21-06-2047  | 1.650.180,00               | 0,10                         | 3.380.000,00       | Philippine Government Intern<br>3.95% 20-01-2040  | 3.779.350,11               | 0,24                         |
| 1.330.000,00       | Colombia Government Internat<br>4.125% 15-05-2051 | 1.077.300,00               | 0,07                         | 2.630.000,00       | Philippine Government Intern<br>6.375% 15-01-2032   | 3.512.269,45               | 0,22                         |
| 2.500.000,00       | Colombia Government Internat<br>7.375% 18-09-2037 | 2.897.525,00               | 0,18                         | 1.810.000,00       | Philippine Government Intern<br>7.75% 14-01-2031  | 2.634.692,89               | 0,17                         |
| 200.000,00         | Dominican Republic Internati<br>5.3% 21-01-2041   | 197.000,00                 | 0,01                         | 6.650.000,00       | Uruguay Government Internati<br>4.375% 23-01-2031   | 7.657.541,50               | 0,49                         |
| 4.000.000,00       | Dominican Republic Internati<br>7.45% 30-04-2044  | 4.724.040,00               | 0,30                         | 2.900.000,00       | Uruguay Government Internati<br>4.375% 27-10-2027   | 3.258.875,00               | 0,21                         |
| 3.000.000,00       | Emirate of Dubai Government<br>3.9% 09-09-2050    | 2.868.750,00               | 0,18                         | 1.000.000,00       | Uruguay Government Internati<br>4.5% 14-08-2024   | 1.059.010,00               | 0,07                         |
| 6.100.000,00       | Empresa Nacional de Telecomu<br>3.05% 14-09-2032  | 5.993.311,00               | 0,38                         | 4.142.000,00       | Uruguay Government Internati<br>4.975% 20-04-2055   | 5.425.067,34               | 0,35                         |
| 1.400.000,00       | Guatemala Government Bond<br>4.5% 03-05-2026      | 1.470.700,00               | 0,09                         | 8.400.000,00       | Uruguay Government Internati<br>5.1% 18-06-2050   | 11.098.920,00              | 0,71                         |
| 200.000,00         | Guatemala Government Bond<br>4.65% 07-10-2041     | 199.750,00                 | 0,01                         |                    |   | <b>216.949.775,02</b>      | <b>13,80</b>                 |
| 2.730.000,00       | Guatemala Government Bond<br>4.875% 13-02-2028    | 2.930.682,30               | 0,19                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>323.093.378,87</b>      | <b>20,56</b>                 |
| 2.500.000,00       | Guatemala Government Bond<br>5.375% 24-04-2032    | 2.786.250,00               | 0,18                         |                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b> | <b>323.093.378,87</b>      | <b>20,56</b>                 |
| 790.000,00         | Jamaica Government Internati<br>7.625% 09-07-2025 | 882.825,00                 | 0,06                         |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
| 6.200.000,00       | Mexico Government Internatio<br>3.75% 19-04-2071  | 5.549.000,00               | 0,35                         |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
| 5.000.000,00       | Mexico Government Internatio<br>4.28% 14-08-2041  | 5.162.500,00               | 0,33                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 700.000,00         | Mexico Government Internatio<br>4.5% 22-04-2029   | 779.212,00                 | 0,05                         | 500.000,00         | Perusahaan Penerbit SBSN Ind<br>3.9% 20-08-2024   | 535.200,00                 | 0,03                         |
| 5.500.000,00       | Mexico Government Internatio<br>4.6% 10-02-2048   | 5.822.190,00               | 0,37                         |                    |   | <b>535.200,00</b>          | <b>0,03</b>                  |
| 4.000.000,00       | Mexico Government Internatio<br>4.6% 23-01-2046   | 4.255.120,00               | 0,27                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>535.200,00</b>          | <b>0,03</b>                  |
| 4.000.000,00       | Mexico Government Internatio<br>4.75% 27-04-2032  | 4.516.000,00               | 0,29                         |                    | <b>Summe sonstige übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>535.200,00</b>          | <b>0,03</b>                  |
| 3.000.000,00       | Mexico Government Internatio 5%<br>27-04-2051     | 3.420.000,00               | 0,22                         |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>1.528.793.241,64</b>    | <b>97,27</b>                 |
| 3.700.000,00       | Mexico Government Internatio<br>5.55% 21-01-2045  | 4.413.175,00               | 0,28                         |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>6.281.891,38</b>        | <b>0,40</b>                  |
| 2.584.000,00       | Mexico Government Internatio<br>5.75% 12-10-2110  | 2.956.638,64               | 0,19                         |                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>36.695.193,23</b>       | <b>2,33</b>                  |
| 6.840.000,00       | Mexico Government Internatio<br>6.05% 11-01-2040  | 8.440.970,40               | 0,54                         |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>1.571.770.326,25</b>    | <b>100,00</b>                |
| 7.100.000,00       | Natura Cosmeticos SA 4.125%<br>03-05-2028         | 6.958.000,00               | 0,44                         |                    |   |                            |                              |
| 620.000,00         | Panama Government Internatio<br>3.87% 23-07-2060  | 618.450,00                 | 0,04                         |                    |   |                            |                              |
| 3.080.000,00       | Panama Government Internatio<br>4.5% 01-04-2056   | 3.388.000,00               | 0,22                         |                    |   |                            |                              |
| 1.700.000,00       | Panama Government Internatio<br>4.5% 15-05-2047   | 1.878.500,00               | 0,12                         |                    |   |                            |                              |
| 12.900.000,00      | Panama Government Internatio<br>4.5% 16-04-2050   | 14.209.350,00              | 0,90                         |                    |   |                            |                              |
| 3.050.000,00       | Panama Government Internatio<br>6.7% 26-01-2036   | 4.079.375,00               | 0,26                         |                    |   |                            |                              |
| 1.500.000,00       | Panama Government Internatio<br>8.875% 30-09-2027 | 2.017.500,00               | 0,13                         |                    |   |                            |                              |
| 3.010.000,00       | Panama Government Internatio<br>9.375% 01-04-2029 | 4.311.825,00               | 0,27                         |                    |   |                            |                              |
| 7.700.000,00       | Paraguay Government Internat<br>2.739% 29-01-2033 | 7.419.027,00               | 0,47                         |                    |   |                            |                              |
| 7.500.000,00       | Paraguay Government Internat<br>4.7% 27-03-2027   | 8.287.500,00               | 0,53                         |                    |   |                            |                              |
| 7.470.000,00       | Paraguay Government Internat<br>5% 15-04-2026     | 8.273.025,00               | 0,53                         |                    |   |                            |                              |
| 5.000.000,00       | Paraguay Government Internat<br>6.1% 11-08-2044   | 6.137.500,00               | 0,39                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                         |              | Sektor               |       |
|------------------------------|--------------|----------------------|-------|
| Ägypten                      | 6,49         | Staatsanleihen       | 81,00 |
| Mexiko                       | 5,48         | Unternehmensanleihen | 16,27 |
| Oman                         | 5,02         |                      |       |
| Chile                        | 4,80         |                      |       |
| Vereinigte Arabische Emirate | 4,62         |                      |       |
| Indonesien                   | 3,63         |                      |       |
| Katar                        | 3,56         |                      |       |
| Paraguay                     | 3,19         |                      |       |
| Türkei                       | 2,99         |                      |       |
| Panama                       | 2,98         |                      |       |
| Bahrain                      | 2,90         |                      |       |
| China                        | 2,78         |                      |       |
| Angola                       | 2,66         |                      |       |
| Kolumbien                    | 2,56         |                      |       |
| Ecuador                      | 2,43         |                      |       |
| Mauritius                    | 2,26         |                      |       |
| Peru                         | 2,25         |                      |       |
| Uruguay                      | 2,12         |                      |       |
| Ukraine                      | 2,02         |                      |       |
| Brasilien                    | 1,95         |                      |       |
| Ghana                        | 1,93         |                      |       |
| Kenia                        | 1,91         |                      |       |
| Philippinen                  | 1,83         |                      |       |
| Südafrika                    | 1,70         |                      |       |
| Kasachstan                   | 1,66         |                      |       |
| Luxemburg                    | 1,53         |                      |       |
| Usbekistan                   | 1,48         |                      |       |
| Cote D'Ivoire                | 1,46         |                      |       |
| Indien                       | 1,23         |                      |       |
| Argentinien                  | 1,13         |                      |       |
| Dominikanische Republik      | 1,05         |                      |       |
| Österreich                   | 0,97         |                      |       |
| Senegal                      | 0,95         |                      |       |
| Rumänien                     | 0,92         |                      |       |
| Sri Lanka                    | 0,83         |                      |       |
| Jamaika                      | 0,73         |                      |       |
| Guatemala                    | 0,72         |                      |       |
| Niederlande                  | 0,68         |                      |       |
| Marokko                      | 0,66         |                      |       |
| USA                          | 0,65         |                      |       |
| Malaysia                     | 0,62         |                      |       |
| Vereinigtes Königreich       | 0,62         |                      |       |
| Britische Jungferninseln     | 0,57         |                      |       |
| Benin                        | 0,48         |                      |       |
| Hongkong                     | 0,45         |                      |       |
| Jordanien                    | 0,45         |                      |       |
| Nigeria                      | 0,39         |                      |       |
| Trinidad und Tobago          | 0,38         |                      |       |
| Kaimaninseln                 | 0,37         |                      |       |
| Mongolei                     | 0,36         |                      |       |
| Russische Föderation         | 0,28         |                      |       |
| Georgien                     | 0,26         |                      |       |
| Ungarn                       | 0,25         |                      |       |
| Armenien                     | 0,21         |                      |       |
| Ruanda                       | 0,21         |                      |       |
| Libanon                      | 0,19         |                      |       |
| Namibia                      | 0,10         |                      |       |
| Tunesien                     | 0,10         |                      |       |
| Vietnam                      | 0,07         |                      |       |
| Barbados                     | 0,06         |                      |       |
| Kroatien                     | 0,06         |                      |       |
| Länderübergreifend           | 0,06         |                      |       |
| Polen                        | 0,03         |                      |       |
| <b>Summe</b>                 | <b>97,27</b> |                      |       |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswahrung (USD) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 5.970,89  | CHF                | 6.412,81          | USD                  | 139,24  | 28.01.2022  |
| 999.053.169,86                                    | DKK                | 151.341.448,73    | USD                  | 915.290,15  | 28.01.2022  |
| 504.303.676,06                                    | EUR                | 568.154.120,91    | USD                  | 3.362.040,23  | 28.01.2022  |
| 4.483,82  | GBP                | 5.989,49          | USD                  | 55,72   | 28.01.2022  |
| 1.594.921.332,03                                  | NOK                | 178.072.235,03    | USD                  | 2.775.700,47  | 28.01.2022  |
| 199.649.528,44                                    | SEK                | 22.194.503,80     | USD                  | (131.882,74)  | 28.01.2022  |
| 129,65  | USD                | 120,10            | CHF                  | (2,13)  | 28.01.2022  |
| 4.158.547,69                                      | USD                | 27.397.271,75     | DKK                  | (16.825,27)   | 28.01.2022  |
| 39.686.362,35                                     | USD                | 35.078.866,89     | EUR                  | (67.745,46)   | 28.01.2022  |
| 101,74  | USD                | 76,34             | GBP                  | (1,19)  | 28.01.2022  |
| 3.649.541,87                                      | USD                | 32.781.674,66     | NOK                  | (67.567,79)   | 28.01.2022  |
| 733.722,26  | USD                | 6.659.852,54      | SEK                  | (2.236,17)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>6.766.965,06</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 144.246.000,00                                    | TRY                | 11.360.232,85     | USD                  | (727.797,07)  | 12.01.2022  |
| 1.083.197,86                                      | USD                | 908.868.000,00    | CLP                  | 18.186,10   | 12.01.2022  |
| 46.206.855,23                                     | USD                | 192.775.000,00    | MYR                  | (88.974,16)   | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(798.585,13)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 495.162.000,00                                    | CZK                | 22.489.041,00     | USD                  | 34.675,08   | 12.01.2022  |
| 27.369.741,08                                     | EUR                | 10.085.607.000,00 | HUF                  | 101.687,10  | 12.01.2022  |
| 25.861.378,33                                     | EUR                | 119.762.000,00    | PLN                  | (192.721,25)  | 12.01.2022  |
| 8.916.018.000,00                                  | HUF                | 28.533.122,07     | USD                  | (1.211.159,45)  | 12.01.2022  |
| 6.384.000,00                                      | PLN                | 1.524.175,15      | USD                  | 47.892,57   | 12.01.2022  |
| 1.391.730,37                                      | USD                | 5.507.290.000,00  | COP                  | 40.520,38   | 12.01.2022  |
| 1.067.099,67                                      | USD                | 24.325.000,00     | CZK                  | (39.384,83)   | 12.01.2022  |
| 42.953.586,38                                     | USD                | 37.080.985,43     | EUR                  | 943.844,59  | 12.01.2022  |
| 1.079.496,01                                      | USD                | 1.289.035.000,00  | KRW                  | (2.998,69)  | 12.01.2022  |
| 11.886.266,81                                     | USD                | 51.322.000,00     | RON                  | 150.209,43  | 12.01.2022  |
| 320.921,04  | USD                | 23.460.939,00     | RUB                  | 10.320,02   | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(117.115,05)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 45.746.303.000,00                                 | COP                | 11.671.463,96     | USD                  | (447.635,70)  | 12.01.2022  |
| 245.986.000,00                                    | MXN                | 11.693.820,30     | USD                  | 315.926,67  | 12.01.2022  |
| 81.421.000,00                                     | PLN                | 20.476.058,75     | USD                  | (426.021,53)  | 12.01.2022  |
| 40.478.000,00                                     | SGD                | 29.831.870,53     | USD                  | 158.858,56  | 12.01.2022  |
| 1.523.706.000,00                                  | THB                | 46.532.904,56     | USD                  | (819.524,55)  | 12.01.2022  |
| 1.055.445,83                                      | USD                | 4.382.000,00      | PEN                  | (41.967,41)   | 12.01.2022  |
| 29.282.016,80                                     | USD                | 1.502.431.000,00  | PHP                  | (10.893,46)   | 12.01.2022  |
| 44.080.669,89                                     | USD                | 1.495.040.000,00  | THB                  | (772.662,09)  | 12.01.2022  |
| 1.488.802,51                                      | USD                | 18.732.000,00     | TRY                  | 108.058,37  | 12.01.2022  |
| 10.738.135,68                                     | USD                | 163.153.000,00    | ZAR                  | 526.178,62  | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.409.682,52)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 1.156.201.000,00                                  | HUF                | 3.503.349,57      | USD                  | 39.672,76   | 12.01.2022  |
| 1.904.000,00                                      | SGD                | 1.398.217,27      | USD                  | 12.483,47   | 12.01.2022  |
| 42.903.960,02                                     | USD                | 278.983.000,00    | CNY                  | (942.310,04)  | 12.01.2022  |
| 11.576.313,23                                     | USD                | 244.785.000,00    | MXN                  | (374.796,43)  | 12.01.2022  |
| 21.899.231,62                                     | USD                | 215.938.000,00    | TRY                  | 5.982.264,50  | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>4.717.314,26</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                    |                   |                      |   |             |
| 9.820.276.000,00                                  | CLP                | 11.681.691,23     | USD                  | (174.289,80)  | 12.01.2022  |
| 189.516.000,00                                    | MYR                | 45.230.817,72     | USD                  | 282.342,43  | 12.01.2022  |
| 207.728.000,00                                    | TRY                | 17.925.257,73     | USD                  | (2.613.509,52)  | 12.01.2022  |
| 11.791.300,60                                     | USD                | 65.282.000,00     | BRL                  | 108.275,32  | 12.01.2022  |
| 3.575.520,90                                      | USD                | 3.174.000,00      | EUR                  | (20.361,34)   | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(2.417.542,91)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: HSBC Continental Europe SA</b>    |                    |                   |                      |   |             |
| 65.260.000,00                                     | BRL                | 11.672.622,82     | USD                  | 6.462,38  | 12.01.2022  |
| 10.773.462,85                                     | USD                | 8.861.658.000,00  | CLP                  | 389.364,29  | 12.01.2022  |
| 10.592.092,35                                     | USD                | 40.742.801.000,00 | COP                  | 595.865,32  | 12.01.2022  |
| 180.564,87  | USD                | 2.609.993.000,00  | IDR                  | (2.920,54)  | 12.01.2022  |
| 1.541.150,32                                      | USD                | 78.349.000,00     | PHP                  | 13.578,83   | 12.01.2022  |
| 2.400.322,08                                      | USD                | 41.277.000,00     | TRY                  | (642.209,29)  | 12.01.2022  |
| 31.242.550,03                                     | USD                | 865.036.000,00    | TWD                  | 12.092,62   | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>372.233,61</b>   |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                       | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswahrung (USD) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>        |                    |                   |                      |   |             |
| 13.782.001.000,00                       | KRW                | 11.748.860,66     | USD                  | (175.125,36)  | 12.01.2022  |
| 120.810.000,00                          | PLN                | 26.090.730,09     | EUR                  | 190.955,89  | 12.01.2022  |
| 21.264.473,75                           | USD                | 468.933.000,00    | CZK                  | (66.148,30)   | 12.01.2022  |
| 10.619.638,74                           | USD                | 12.610.821.000,00 | KRW                  | 29.430,65   | 12.01.2022  |
| 22.456.552,37                           | USD                | 88.874.000,00     | PLN                  | 571.201,49  | 12.01.2022  |
| 6.696.473,47                            | USD                | 76.234.000,00     | TRY                  | 1.077.220,28  | 12.01.2022  |
| 1.388.258,32                            | USD                | 22.016.000,00     | ZAR                  | 10.249,46   | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>1.637.784,11</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 51.250.000,00                           | RON                | 11.709.751,97     | USD                  | 9.838,12  | 12.01.2022  |
| 185.562.000,00                          | ZAR                | 11.758.434,38     | USD                  | (143.876,73)  | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(134.038,61)</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>1.850.367,76</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>8.617.332,82</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

## Credit Default Swaps

| Basiswert                                     | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal       | Wahrung | Kosten (USD)        | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (USD) | Marktwert (USD)   | Falligkeit |
|---|--------------|-----------------|---------------|----------|---------------------|---|-------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |              |                 |               |          |                     |   |                   |             |
| Brazilian Government Interna 4.25% 07-01-2025 | Kauf         | 1,00%           | 16.500.000,00 | USD      | 1.122.353,49        | (326.423,40)  | 795.930,09        | 20.12.2026  |
|   |              |                 |               |          | <b>1.122.353,49</b> | <b>(326.423,40)</b>                                 | <b>795.930,09</b> |             |

## Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Falligkeit | Wahrung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (USD) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (USD) |
|--|-------------|----------|-------------------------------|---------------------------|--|---|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |             |          |                               |                           |  |   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | (116,00)                      | (19.878.920,00)           | 0,00   | 403.163,11  |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022  | USD      | (954,00)                      | (124.482.098,52)          | (74.536,02)  | (1.304.296,87)  |
| US 2YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022  | USD      | 556,00                        | 121.312.250,00            | 34.750,00  | (173.750,00)  |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022  | USD      | 652,00                        | 78.866.532,88             | 35.657,88  | 234.312,50  |
| US LONG BOND(CBT) 3/2022               | 31.03.2022  | USD      | (116,00)                      | (18.581.750,00)           | (36.250,00)  | (88.811,48)   |
| US ULTRA BOND CBT 3/2022               | 31.03.2022  | USD      | 39,00                         | 7.624.500,00              | (2.437,50)   | 105.774,04  |
|  |             |          |                               |                           | <b>(42.815,64)</b>   | <b>(823.608,70)</b>   |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Zinsswaps

| Beschreibung                                     | Nominal         | Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs<br>(Wertminderung) im Teilfonds<br>Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|--|-----------------|---------|--|------------|
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                 |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.5600%                     | 346.000.000,00  | THB     | (143.928,33)   | 20.05.2031 |
| Paying floating rate THFX 6 months               |                 |         |  |            |
|  |                 |         | <b>(143.928,33)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate 3.1000%                        | (49.245.000,00) | MYR     | 187.584,39   | 18.05.2031 |
| Receiving floating rate KLIBOR 3 months          |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate 3.0450%                        | (8.000.000,00)  | MYR     | 39.794,95  | 08.06.2031 |
| Receiving floating rate KLIBOR 3 months          |                 |         |  |            |
|  |                 |         | <b>227.379,34</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate 3.1250%                        | (49.245.000,00) | MYR     | 162.261,60   | 12.05.2031 |
| Receiving floating rate KLIBOR 3 months          |                 |         |  |            |
|  |                 |         | <b>162.261,60</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>     |                 |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.6050%                     | 346.000.000,00  | THB     | (103.078,10)   | 14.05.2031 |
| Paying floating rate THFX 6 months               |                 |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.5600%                     | 100.000.000,00  | THB     | (41.849,04)  | 10.06.2031 |
| Paying floating rate THFX 6 months               |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate 3.1680%                        | (4.000.000,00)  | MYR     | 10.428,51  | 17.06.2031 |
| Receiving floating rate KLIBOR 3 months          |                 |         |  |            |
|  |                 |         | <b>(134.498,63)</b>  |            |
|  |                 |         | <b>111.213,98</b>  |            |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte 200.000,00 USD gezahlt.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 360.000,00 USD gezahlt.  
 Citibank Europe PLC hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte und Zinsswaps 695.254,00 USD erhalten.  
 Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte und Zinsswaps 540.000,00 USD gezahlt.  
 Morgan Stanley Europe SE hat als Sicherheit für Zinsswaps 20.000,00 USD gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                          | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                     | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------------------------------|----------------------------|------------------------------|---|----------------------------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>       |                                       |                            |                              | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                                  |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |                                       |                            |                              | <b>Aktien</b>   |                                  |                            |                              |
| <b>BRL</b>  |                                       |                            |                              | <b>CNY</b>  |                                  |                            |                              |
| 23.704.291,00   | Hapvida Participacoes e Investimentos | 44.174.244,27              | 0,76                         | 21.224.448,00   | East Money Information           | 123.583.243,55             | 2,12                         |
| 20.404.440,00   | Itau Unibanco Holding                 | 76.745.604,67              | 1,31                         | 6.945.178,00  | Foshan Haitian Flavouring & Food | 114.540.651,24             | 1,96                         |
| 19.157.746,00   | Lojas Renner                          | 84.060.199,68              | 1,44                         | 5.331.763,00  | Glodon                           | 53.523.844,88              | 0,92                         |
| 23.343.100,00   | Raia Drogasil                         | 101.837.940,75             | 1,74                         |   |                                  | <b>291.647.739,67</b>      | <b>4,99</b>                  |
| 471.094,00  | XP                                    | 13.573.765,90              | 0,23                         |   | <b>TWD</b>                       |                            |                              |
|   |                                       | <b>320.391.755,27</b>      | <b>5,49</b>                  | 1.121.880,00  | ASPEED Technology                | 144.558.567,45             | 2,48                         |
|   |                                       |                            |                              |   |                                  | <b>144.558.567,45</b>      | <b>2,48</b>                  |
| <b>EUR</b>  |                                       |                            |                              | <b>Summe Aktien</b>   |                                  |                            |                              |
| 689.601,00  | Delivery Hero                         | 76.545.504,12              | 1,31                         |   |                                  | <b>436.206.307,12</b>      | <b>7,47</b>                  |
|   |                                       | <b>76.545.504,12</b>       | <b>1,31</b>                  | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |                                  |                            |                              |
| <b>GBP</b>  |                                       |                            |                              |   |                                  | <b>436.206.307,12</b>      | <b>7,47</b>                  |
| 5.132.518,00  | Antofagasta                           | 92.626.529,25              | 1,59                         | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>92.626.529,25</b>       | <b>1,59</b>                  |   |                                  | <b>5.739.519.647,94</b>    | <b>98,28</b>                 |
| <b>HKD</b>  |                                       |                            |                              | <b>Bankguthaben</b>   |                                  |                            |                              |
| 15.545.288,00   | Alia Group                            | 156.664.741,03             | 2,68                         |   |                                  | <b>112.950.606,63</b>      | <b>1,93</b>                  |
| 19.294.260,00   | Alibaba Group Holding                 | 294.143.955,21             | 5,04                         | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  |                                  |                            |                              |
| 3.032.650,00  | JD.com                                | 106.542.479,71             | 1,82                         |   |                                  | <b>(12.556.326,72)</b>     | <b>(0,22)</b>                |
| 29.487.000,00   | Kingdee International Software Group  | 90.738.538,14              | 1,55                         | <b>Summe Nettovermögen</b>  |                                  |                            |                              |
| 10.887.000,00   | Li Ning                               | 119.141.124,57             | 2,04                         |   |                                  | <b>5.839.913.927,85</b>    | <b>100,00</b>                |
| 6.500.600,00  | Meituan                               | 187.869.942,27             | 3,22                         |   |                                  |                            |                              |
| 12.486.500,00   | Ping An Insurance Group Co of China   | 89.896.012,61              | 1,54                         |   |                                  |                            |                              |
| 7.312.400,00  | Tencent Holdings                      | 428.288.074,59             | 7,33                         |   |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>1.473.284.868,13</b>    | <b>25,23</b>                 |   |                                  |                            |                              |
| <b>HUF</b>  |                                       |                            |                              |   |                                  |                            |                              |
| 2.476.003,00  | OTP Bank Nyrt                         | 126.105.615,82             | 2,16                         |   |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>126.105.615,82</b>      | <b>2,16</b>                  |   |                                  |                            |                              |
| <b>IDR</b>  |                                       |                            |                              |   |                                  |                            |                              |
| 321.584.884,00  | Bank Rakyat Indonesia Persero         | 92.735.581,35              | 1,59                         |   |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>92.735.581,35</b>       | <b>1,59</b>                  |   |                                  |                            |                              |
| <b>INR</b>  |                                       |                            |                              |   |                                  |                            |                              |
| 4.281.069,00  | Havells India                         | 80.454.713,09              | 1,38                         |   |                                  |                            |                              |
| 8.260.177,00  | HDFC Bank                             | 164.390.919,48             | 2,81                         |   |                                  |                            |                              |
| 10.141.438,00   | HDFC Life Insurance                   | 88.616.579,70              | 1,52                         |   |                                  |                            |                              |
| 3.363.259,00  | Hindustan Unilever                    | 106.783.161,63             | 1,83                         |   |                                  |                            |                              |
| 4.915.205,00  | Housing Development Finance           | 171.020.660,64             | 2,93                         |   |                                  |                            |                              |
| 3.721.467,00  | ICICI Lombard General Insurance       | 70.150.804,27              | 1,20                         |   |                                  |                            |                              |
| 1.614.306,00  | Info Edge India                       | 121.106.094,72             | 2,07                         |   |                                  |                            |                              |
| 6.882.189,00  | Varun Beverages                       | 82.241.138,52              | 1,41                         |   |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>884.764.072,05</b>      | <b>15,15</b>                 |   |                                  |                            |                              |
| <b>KRW</b>  |                                       |                            |                              |   |                                  |                            |                              |
| 556.983,00  | LEENO Industrial                      | 92.912.520,95              | 1,59                         |   |                                  |                            |                              |
| 94.418,00   | LG Household & Health Care            | 87.130.662,03              | 1,49                         |   |                                  |                            |                              |
| 6.992.269,00  | Samsung Electronics                   | 460.563.460,16             | 7,89                         |   |                                  |                            |                              |
| 229.038,00  | Samsung SDI                           | 126.199.731,87             | 2,16                         |   |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>766.806.375,01</b>      | <b>13,13</b>                 |   |                                  |                            |                              |
| <b>MXN</b>  |                                       |                            |                              |   |                                  |                            |                              |
| 19.760.900,00   | Grupo Financiero Banorte              | 129.370.964,04             | 2,22                         |   |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>129.370.964,04</b>      | <b>2,22</b>                  |   |                                  |                            |                              |
| <b>TWD</b>  |                                       |                            |                              |   |                                  |                            |                              |
| 384.000,00  | Silergy                               | 69.743.732,54              | 1,19                         |   |                                  |                            |                              |
| 25.577.560,00   | Taiwan Semiconductor Manufacturing    | 568.554.529,34             | 9,74                         |   |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>638.298.261,88</b>      | <b>10,93</b>                 |   |                                  |                            |                              |
| <b>USD</b>  |                                       |                            |                              |   |                                  |                            |                              |
| 2.234.459,00  | Kingsoft Cloud Holdings ADR           | 36.287.614,16              | 0,62                         |   |                                  |                            |                              |
| 5.957.105,00  | Magnit PJSC GDR                       | 89.356.575,00              | 1,53                         |   |                                  |                            |                              |
| 320.884,00  | Magnit PJSC                           | 23.385.659,79              | 0,40                         |   |                                  |                            |                              |
| 92.432,00   | MercadoLibre                          | 125.938.600,00             | 2,16                         |   |                                  |                            |                              |
| 38.510.856,00   | Sberbank of Russia PJSC               | 151.443.864,20             | 2,59                         |   |                                  |                            |                              |
| 360.779,00  | Sea ADR                               | 80.572.774,07              | 1,38                         |   |                                  |                            |                              |
| 1.780.526,00  | Yandex                                | 108.843.554,38             | 1,86                         |   |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>615.828.641,60</b>      | <b>10,55</b>                 |   |                                  |                            |                              |
| <b>ZAR</b>  |                                       |                            |                              |   |                                  |                            |                              |
| 676.809,00  | Capitec Bank Holdings                 | 86.555.172,30              | 1,48                         |   |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>86.555.172,30</b>       | <b>1,48</b>                  |   |                                  |                            |                              |
| <b>Summe Aktien</b>   |                                       |                            |                              |   |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>5.303.313.340,82</b>    | <b>90,81</b>                 |   |                                  |                            |                              |
| <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                                       |                            |                              |   |                                  |                            |                              |
|   |                                       | <b>5.303.313.340,82</b>    | <b>90,81</b>                 |   |                                  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor   |              |
|------------------------|--------------|--|--------------|
| Kaimaninseln           | 24,43        | Halbleiter                                       | 15,00        |
| Indien                 | 15,15        | Verschiedene Banken                              | 14,17        |
| Republik Korea         | 13,13        | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)      | 13,55        |
| Taiwan, Provinz Chinas | 12,21        | Interaktive Medien und Dienstleistungen          | 11,27        |
| China                  | 6,53         | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie | 7,89         |
| Brasilien              | 5,25         | Lebens- und Krankenversicherung                  | 5,74         |
| Russische Föderation   | 4,52         | Produkte für den persönlichen Gebrauch           | 3,32         |
| Hongkong               | 2,68         | Bausparkassen und Hypothekenfinanzierung         | 2,93         |
| Mexiko                 | 2,22         | Anwendungssoftware                               | 2,47         |
| Ungarn                 | 2,16         | Elektronische Komponenten                        | 2,16         |
| USA                    | 2,16         | Börsen und Finanzdaten                           | 2,12         |
| Niederlande            | 1,86         | Bekleidung, Accessoires und Luxusgüter           | 2,04         |
| Indonesien             | 1,59         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch              | 1,96         |
| Vereinigtes Königreich | 1,59         | Lebensmitteleinzelhandel                         | 1,93         |
| Südafrika              | 1,48         | Arzneimittel-Einzelhandel                        | 1,74         |
| Deutschland            | 1,31         | Kupfer   | 1,59         |
|                        |              | Kaufhäuser                                       | 1,44         |
|                        |              | Alkoholfreie Getränke                            | 1,41         |
|                        |              | Elektrische Komponenten und Ausrüstung           | 1,38         |
|                        |              | Interaktives Home Entertainment                  | 1,38         |
|                        |              | Sach- und Unfallversicherung                     | 1,20         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Managed Health Care            | 0,76         |
|                        |              | Internet-Dienste und -Infrastruktur              | 0,62         |
|                        |              | Investmentbanken und Broker                      | 0,23         |
| <b>Summe</b>           | <b>98,28</b> | <b>Summe</b>                                     | <b>98,28</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswahrung (USD) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 18.351.443,87                                     | CHF                | 19.725.467,72     | USD                  | 412.141,40  | 28.01.2022  |
| 95.111.867,01                                     | EUR                | 107.172.656,03    | USD                  | 615.512,23  | 28.01.2022  |
| 428.586,55  | GBP                | 572.412,04        | USD                  | 5.419,51  | 28.01.2022  |
| 2.864.427,78                                      | USD                | 2.642.108,46      | CHF                  | (34.840,81)   | 28.01.2022  |
| 29.876.966,75                                     | USD                | 26.530.341,46     | EUR                  | (189.279,78)  | 28.01.2022  |
| 78.954,89   | USD                | 59.409,04         | GBP                  | (1.141,90)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>807.810,65</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |              |      |
|---|---|----------------------------|------------------------------|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------|------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |   |   |                            |                              |              |      |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |   |   |                            |                              |              |      |
| <b>BRL</b>  |   |                            |                              |   |   |                            |                              |              |      |
| 5.000,00  | Brazil Notas do Tesouro Naci 10% 01-01-2023   | 882.729,94                 | 1,38                         | 16.000.000,00   | International Bank for Recon 6.25% 07-10-2026 | 755.151,16                 | 1,18                         |              |      |
| 4.379,00  | Brazil Notas do Tesouro Naci 10% 01-01-2025   | 773.310,30                 | 1,21                         | 50.000,00   | Mexican Bonos 10% 20-11-2036                  | 293.638,10                 | 0,46                         |              |      |
| 2.600,00  | Brazil Notas do Tesouro Naci 10% 01-01-2027   | 456.728,11                 | 0,72                         | 65.517,00   | Mexican Bonos 5.75% 05-03-2026                | 302.214,07                 | 0,47                         |              |      |
| 3.500.000,00  | European Investment Bank 4.75% 29-10-2025     | 533.482,87                 | 0,84                         | 154.936,00  | Mexican Bonos 7.5% 03-06-2027                 | 760.162,61                 | 1,19                         |              |      |
| 6.610.000,00  | International Bank for Recon 5% 22-01-2026    | 1.011.429,20               | 1,58                         | 110.000,00  | Mexican Bonos 7.75% 13-11-2042                | 522.018,39                 | 0,82                         |              |      |
| 5.000.000,00  | International Bank for Recon 5.75% 14-01-2028 | 733.225,39                 | 1,15                         | 110.000,00  | Mexican Bonos 7.75% 23-11-2034                | 542.170,53                 | 0,85                         |              |      |
|   |   | <b>4.390.905,81</b>        | <b>6,88</b>                  | 60.000,00   | Mexican Bonos 7.75% 29-05-2031                | 296.733,20                 | 0,46                         |              |      |
|   |   |                            |                              | 170.000,00  | Mexican Bonos 8.5% 31-05-2029                 | 879.705,51                 | 1,38                         |              |      |
|   |   |                            |                              |   |   | <b>4.351.793,57</b>        | <b>6,81</b>                  |              |      |
| <b>CLP</b>  |   |                            |                              | <b>PEN</b>  |   |                            |                              |              |      |
| 155.000.000,00  | Bonos de la Tesoreria de la 4.5% 01-03-2026   | 175.785,17                 | 0,28                         | 1.000.000,00  | Inter-American Development B 3.05% 07-02-2025 | 242.069,25                 | 0,38                         |              |      |
| 170.000.000,00  | Bonos de la Tesoreria de la 4.7% 01-09-2030   | 187.773,61                 | 0,29                         | 1.000.000,00  | Peru Government Bond 5.4% 12-08-2034          | 228.048,91                 | 0,36                         |              |      |
| 280.000.000,00  | Bonos de la Tesoreria de la 5% 01-03-2035     | 309.606,59                 | 0,48                         | 1.500.000,00  | Peru Government Bond 6.15% 12-08-2032         | 378.698,44                 | 0,59                         |              |      |
| 150.000.000,00  | Bonos de la Tesoreria de la 6% 01-01-2043     | 180.365,27                 | 0,28                         | 250.000,00  | Peru Government Bond 6.7142% 12-02-2055       | 61.585,78                  | 0,10                         |              |      |
|   |   | <b>853.530,64</b>          | <b>1,34</b>                  | 350.000,00  | Peru Government Bond 6.9% 12-08-2037          | 89.195,41                  | 0,14                         |              |      |
| <b>COP</b>  |   |                            |                              | <b>PLN</b>  |   |                            |                              |              |      |
| 500.000.000,00  | Colombian TES 10% 24-07-2024                  | 131.581,38                 | 0,21                         | 2.000.000,00  | Republic of Poland Governmen 1.25% 25-10-2030 | 405.960,89                 | 0,64                         |              |      |
| 100.000,00  | Colombian TES 4.75% 23-02-2023                | 7.402,63                   | 0,01                         | 950.000,00  | Republic of Poland Governmen 2.5% 25-04-2024  | 228.742,56                 | 0,36                         |              |      |
| 500.000.000,00  | Colombian TES 6% 28-04-2028                   | 111.042,73                 | 0,17                         | 3.500.000,00  | Republic of Poland Governmen 2.5% 25-07-2026  | 813.104,58                 | 1,27                         |              |      |
| 1.500.000.000,00  | Colombian TES 7% 26-03-2031                   | 340.227,27                 | 0,53                         | 4.500.000,00  | Republic of Poland Governmen 2.75% 25-10-2029 | 1.036.221,06               | 1,62                         |              |      |
| 3.000.000.000,00  | Colombian TES 7% 30-06-2032                   | 671.947,55                 | 1,05                         | 3.850.000,00  | Republic of Poland Governmen 3.25% 25-07-2025 | 931.791,14                 | 1,46                         |              |      |
| 2.467.800.000,00  | Colombian TES 7.25% 18-10-2034                | 555.038,29                 | 0,87                         |   |   | <b>1.403.245,79</b>        | <b>2,20</b>                  |              |      |
| 3.000.000.000,00  | Colombian TES 7.5% 26-08-2026                 | 731.796,39                 | 1,15                         |   |   | <b>3.415.820,23</b>        | <b>5,35</b>                  |              |      |
|   |   | <b>2.549.036,24</b>        | <b>3,99</b>                  | <b>RON</b>  |   |                            |                              |              |      |
| <b>CZK</b>  |   |                            |                              | 2.000.000,00 Romania Government Bond 3.7% 25-11-2024      |   |                            |                              | 446.043,77   | 0,70 |
| 18.230.000,00   | Czech Republic Government Bo 0.95% 15-05-2030 | 704.681,92                 | 1,10                         | 1.000.000,00  | Romania Government Bond 4.85% 22-04-2026      | 228.796,36                 | 0,36                         |              |      |
| 12.040.000,00   | Czech Republic Government Bo 1% 26-06-2026    | 495.489,24                 | 0,78                         | 1.000.000,00  | Romania Government Bond 5% 12-02-2029         | 227.755,08                 | 0,36                         |              |      |
| 15.000.000,00   | Czech Republic Government Bo 2.5% 25-08-2028  | 657.745,66                 | 1,03                         | 2.170.000,00  | Romania Government Bond 5.8% 26-07-2027       | 517.241,31                 | 0,81                         |              |      |
| 14.320.000,00   | Czech Republic Government Bo 2.75% 23-07-2029 | 637.861,87                 | 1,00                         |   |   | <b>1.419.836,52</b>        | <b>2,22</b>                  |              |      |
|   |   | <b>2.495.778,69</b>        | <b>3,91</b>                  | <b>RSD</b>  |   |                            |                              |              |      |
| <b>HUF</b>  |   |                            |                              | 20.000.000,00 Serbia Treasury Bonds 5.875% 08-02-2028     |   |                            |                              | 212.152,82   | 0,33 |
| 383.000.000,00  | Hungary Government Bond 3% 21-08-2030         | 1.047.064,87               | 1,64                         |   |   | <b>212.152,82</b>          | <b>0,33</b>                  |              |      |
| 50.000.000,00   | Hungary Government Bond 3.25% 22-10-2031      | 140.304,51                 | 0,22                         | <b>RUB</b>  |   |                            |                              |              |      |
| 180.000.000,00  | Hungary Government Bond 5.5% 24-06-2025       | 574.190,13                 | 0,90                         | 60.000.000,00   | International Bank for Recon 06-05-2031       | 438.180,76                 | 0,69                         |              |      |
|   |   | <b>1.761.559,51</b>        | <b>2,76</b>                  | 85.000.000,00   | International Bank for Recon 4.25% 22-01-2026 | 1.016.333,78               | 1,59                         |              |      |
| <b>IDR</b>  |   |                            |                              | 82.765.000,00 Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19-01-2028 |   |                            |                              | 1.032.568,89 | 1,62 |
| 15.500.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 6.125% 15-05-2028     | 1.106.006,55               | 1,73                         | 43.000.000,00   | Russian Federal Bond - OFZ 7.15% 12-11-2025   | 549.846,97                 | 0,86                         |              |      |
| 3.500.000.000,00  | Indonesia Treasury Bond 6.625% 15-05-2033     | 247.412,08                 | 0,39                         |   |   | <b>3.036.930,40</b>        | <b>4,76</b>                  |              |      |
| 6.493.000.000,00  | Indonesia Treasury Bond 7.5% 15-04-2040       | 475.750,91                 | 0,74                         | <b>ZAR</b>  |   |                            |                              |              |      |
| 2.277.000.000,00  | Indonesia Treasury Bond 8.25% 15-05-2036      | 177.419,54                 | 0,28                         | 11.800.000,00   | Republic of South Africa Gov 10.5% 21-12-2026 | 818.242,04                 | 1,28                         |              |      |
| 15.206.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-03-2024     | 1.161.246,03               | 1,82                         | 9.000.000,00  | Republic of South Africa Gov 6.25% 31-03-2036 | 394.108,76                 | 0,62                         |              |      |
| 8.067.000.000,00  | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-03-2034     | 635.046,21                 | 0,99                         | 11.500.000,00   | Republic of South Africa Gov 6.5% 28-02-2041  | 476.804,28                 | 0,75                         |              |      |
| 15.400.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 8.75% 15-05-2031      | 1.244.695,13               | 1,95                         | 10.858.249,00   | Republic of South Africa Gov 7% 28-02-2031    | 572.236,35                 | 0,90                         |              |      |
| 15.350.000.000,00   | Indonesia Treasury Bond 9% 15-03-2029         | 1.246.038,85               | 1,95                         | 8.000.000,00  | Republic of South Africa Gov 7.75% 28-02-2023 | 515.100,98                 | 0,81                         |              |      |
|   |   | <b>6.293.615,30</b>        | <b>9,85</b>                  | 12.000.000,00   | Republic of South Africa Gov 8% 31-01-2030    | 693.818,05                 | 1,09                         |              |      |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 8.000.000,00       | Republic of South Africa Gov<br>8.25% 31-03-2032  | 452.409,78                 | 0,71                         |                    |   |                            |                              |
| 10.600.000,00      | Republic of South Africa Gov<br>8.75% 28-02-2048  | 552.134,04                 | 0,86                         |                    |   |                            |                              |
| 14.500.500,00      | Republic of South Africa Gov<br>8.75% 31-01-2044  | 755.393,70                 | 1,18                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>5.230.247,98</b>        | <b>8,19</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>37.414.453,50</b>       | <b>58,58</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>37.414.453,50</b>       | <b>58,58</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>CNY</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 11.000.000,00      | China Government Bond 1.99%<br>09-04-2025   | 1.695.456,86               | 2,65                         |                    |   |                            |                              |
| 10.190.000,00      | China Government Bond 2.68%<br>21-05-2030   | 1.573.530,00               | 2,46                         |                    |   |                            |                              |
| 11.000.000,00      | China Government Bond 2.85%<br>04-06-2027   | 1.742.469,75               | 2,73                         |                    |   |                            |                              |
| 4.100.000,00       | China Government Bond 3.13%<br>21-11-2029   | 655.792,25                 | 1,03                         |                    |   |                            |                              |
| 5.000.000,00       | China Government Bond 3.19%<br>11-04-2024   | 796.755,24                 | 1,25                         |                    |   |                            |                              |
| 11.570.000,00      | China Government Bond 3.29%<br>23-05-2029   | 1.865.307,77               | 2,92                         |                    |   |                            |                              |
| 1.000.000,00       | China Government Bond 3.81%<br>14-09-2050   | 168.176,86                 | 0,26                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>8.497.488,73</b>        | <b>13,31</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>EGP</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 17.000.000,00      | Egypt Treasury Bills 01-02-2022   | 1.073.144,43               | 1,68                         |                    |   |                            |                              |
| 15.000.000,00      | Egypt Treasury Bills 12-07-2022   | 898.550,67                 | 1,41                         |                    |   |                            |                              |
| 10.000.000,00      | Egypt Treasury Bills 18-01-2022   | 633.862,51                 | 0,99                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>2.605.557,61</b>        | <b>4,08</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>PHP</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 5.000.000,00       | Philippine Government Intern<br>6.25% 14-01-2036  | 108.845,95                 | 0,17                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>108.845,95</b>          | <b>0,17</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>RUB</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 85.000.000,00      | Russian Federal Bond - OFZ<br>6.9% 23-05-2029   | 1.043.678,17               | 1,63                         |                    |   |                            |                              |
| 44.000.000,00      | Russian Federal Bond - OFZ<br>8.5% 17-09-2031   | 594.382,48                 | 0,93                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>1.638.060,65</b>        | <b>2,56</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>THB</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 20.000.000,00      | Thailand Government Bond<br>0.75% 17-06-2024  | 598.713,98                 | 0,94                         |                    |   |                            |                              |
| 10.000.000,00      | Thailand Government Bond<br>2.875% 17-06-2046   | 301.964,84                 | 0,47                         |                    |   |                            |                              |
| 17.293.000,00      | Thailand Government Bond<br>2.875% 17-12-2028   | 556.904,55                 | 0,87                         |                    |   |                            |                              |
| 11.557.000,00      | Thailand Government Bond 3.3%<br>17-06-2038   | 380.661,78                 | 0,60                         |                    |   |                            |                              |
| 23.000.000,00      | Thailand Government Bond 3.4%<br>17-06-2036   | 766.637,78                 | 1,20                         |                    |   |                            |                              |
| 17.043.000,00      | Thailand Government Bond<br>3.775% 25-06-2032   | 597.025,38                 | 0,93                         |                    |   |                            |                              |
| 51.500.000,00      | Thailand Government Bond<br>3.85% 12-12-2025  | 1.704.929,43               | 2,67                         |                    |   |                            |                              |
| 16.500.000,00      | Thailand Government Bond<br>4.875% 22-06-2029   | 597.414,68                 | 0,94                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>5.504.252,42</b>        | <b>8,62</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>18.354.205,36</b>       | <b>28,74</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>18.354.205,36</b>       | <b>28,74</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>MYR</b>  |                            |                              |
| 4.600.000,00       | Malaysia Government Bond<br>3.733% 15-06-2028   | 1.124.327,91               | 1,76                         |                    |   |                            |                              |
| 1.000.000,00       | Malaysia Government Bond<br>3.757% 22-05-2040   | 229.171,87                 | 0,36                         |                    |   |                            |                              |
| 2.500.000,00       | Malaysia Government Bond 3.9%<br>30-11-2026   | 619.983,21                 | 0,97                         |                    |   |                            |                              |
| 4.800.000,00       | Malaysia Government Bond<br>4.127% 15-04-2032   | 1.192.803,76               | 1,87                         |                    |   |                            |                              |
| 5.223.000,00       | Malaysia Government Bond<br>4.181% 15-07-2024   | 1.294.163,20               | 2,03                         |                    |   |                            |                              |
| 1.200.000,00       | Malaysia Government Bond<br>4.254% 31-05-2035   | 297.689,88                 | 0,47                         |                    |   |                            |                              |
| 1.500.000,00       | Malaysia Government Investme<br>3.465% 15-10-2030   | 355.612,28                 | 0,56                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>5.113.752,11</b>        | <b>8,01</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>5.113.752,11</b>        | <b>8,01</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                     | <b>5.113.752,11</b>        | <b>8,01</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>60.882.410,97</b>       | <b>95,33</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>1.964.683,84</b>        | <b>3,08</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>1.019.464,66</b>        | <b>1,60</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>63.866.559,47</b>       | <b>100,00</b>                |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                  |              | Sektor         |              |
|-----------------------|--------------|----------------|--------------|
| China                 | 13,31        | Staatsanleihen | 95,33        |
| Indonesien            | 9,85         |                |              |
| Thailand              | 8,62         | <b>Summe</b>   | <b>95,33</b> |
| Südafrika             | 8,19         |                |              |
| Malaysia              | 8,01         |                |              |
| Länderübergreifend    | 7,41         |                |              |
| Mexiko                | 5,63         |                |              |
| Polen                 | 5,35         |                |              |
| Russische Föderation  | 5,04         |                |              |
| Ägypten               | 4,08         |                |              |
| Kolumbien             | 3,99         |                |              |
| Tschechische Republik | 3,91         |                |              |
| Brasilien             | 3,31         |                |              |
| Ungarn                | 2,76         |                |              |
| Rumänien              | 2,22         |                |              |
| Peru                  | 1,82         |                |              |
| Chile                 | 1,34         |                |              |
| Republik Serbien      | 0,33         |                |              |
| Philippinen           | 0,17         |                |              |
| <b>Summe</b>          | <b>95,33</b> |                |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswahrung (USD) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 236.614,34  | EUR                | 266.557,32        | USD                  | 1.592,45  | 28.01.2022  |
| 11.367.872,43                                     | SEK                | 1.264.081,02      | USD                  | (7.854,34)  | 28.01.2022  |
| 42.667,11   | USD                | 37.755,71         | EUR                  | (120,60)  | 28.01.2022  |
| 31.245,74   | USD                | 283.677,30        | SEK                  | (102,49)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(6.484,98)</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 21.539.000,00                                     | HUF                | 59.663,33         | EUR                  | (1.590,27)  | 12.01.2022  |
| 16.718.000,00                                     | MXN                | 798.158,74        | USD                  | 18.062,36   | 12.01.2022  |
| 5.186.000,00                                      | MYR                | 1.233.755,06      | USD                  | 11.687,17   | 12.01.2022  |
| 5.868.000,00                                      | TRY                | 462.140,00        | USD                  | (29.607,16)   | 12.01.2022  |
| 250.645,39  | USD                | 1.602.000,00      | CNY                  | (1.132,51)  | 12.01.2022  |
| 3.132.130,79                                      | USD                | 13.102.000,00     | MYR                  | (14.376,36)   | 12.01.2022  |
| 342.282,86  | USD                | 5.217.000,00      | ZAR                  | 15.744,11   | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.212,66)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 25.505.000,00                                     | CZK                | 1.158.374,41      | USD                  | 1.786,06  | 12.01.2022  |
| 1.206.307,42                                      | EUR                | 444.518.000,00    | HUF                  | 4.481,81  | 12.01.2022  |
| 1.423.906,82                                      | EUR                | 6.594.000,00      | PLN                  | (10.611,08)   | 12.01.2022  |
| 430.249.000,00                                    | HUF                | 1.376.886,77      | USD                  | (58.445,39)   | 12.01.2022  |
| 105.223.000,00                                    | KRW                | 88.219,24         | USD                  | 144,03  | 12.01.2022  |
| 561.400,00  | RON                | 130.340,92        | USD                  | (1.962,78)  | 12.01.2022  |
| 38.508.000,00                                     | RUB                | 526.749,06        | USD                  | (16.938,94)   | 12.01.2022  |
| 138.307,06  | USD                | 900.000,00        | CNY                  | (3.141,14)  | 12.01.2022  |
| 99.993,95   | USD                | 396.987.000,00    | COP                  | 2.593,46  | 12.01.2022  |
| 296.611,61  | USD                | 6.699.000,00      | CZK                  | (8.109,49)  | 12.01.2022  |
| 1.643.629,86                                      | USD                | 1.418.913,30      | EUR                  | 36.116,45   | 12.01.2022  |
| 427.448,55  | USD                | 138.422.000,00    | HUF                  | 3.272,82  | 12.01.2022  |
| 341.356,52  | USD                | 4.893.692.000,00  | IDR                  | (2.675,53)  | 12.01.2022  |
| 186.602,30  | USD                | 769.000,00        | PLN                  | (2.764,93)  | 12.01.2022  |
| 353.698,44  | USD                | 26.690.000,00     | RUB                  | 347,85  | 12.01.2022  |
| 30.322,56   | USD                | 459.000,00        | ZAR                  | 1.593,16  | 12.01.2022  |
| 10.948.000,00                                     | ZAR                | 700.726,62        | USD                  | (15.477,50)   | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(69.791,14)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 1.878.789.000,00                                  | COP                | 479.344,05        | USD                  | (18.384,28)   | 12.01.2022  |
| 261.518.000,00                                    | HUF                | 838.652,18        | USD                  | (37.264,69)   | 12.01.2022  |
| 10.103.000,00                                     | MXN                | 480.282,07        | USD                  | 12.975,57   | 12.01.2022  |
| 4.564.000,00                                      | PEN                | 1.099.282,24      | USD                  | 43.710,46   | 12.01.2022  |
| 15.177.000,00                                     | PLN                | 3.816.768,94      | USD                  | (79.411,07)   | 12.01.2022  |
| 2.129.000,00                                      | SGD                | 1.569.051,15      | USD                  | 8.355,40  | 12.01.2022  |
| 85.657.000,00                                     | THB                | 2.603.760,84      | USD                  | (33.927,37)   | 12.01.2022  |
| 53.117,16   | USD                | 43.393.000,00     | CLP                  | 2.269,20  | 12.01.2022  |
| 1.157.435,14                                      | USD                | 4.582.000,00      | PEN                  | 9.933,22  | 12.01.2022  |
| 1.569.656,40                                      | USD                | 80.537.500,00     | PHP                  | (583,94)  | 12.01.2022  |
| 2.169.389,08                                      | USD                | 73.577.000,00     | THB                  | (38.025,85)   | 12.01.2022  |
| 913.465,18  | USD                | 13.879.000,00     | ZAR                  | 44.760,64   | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(85.592,71)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 2.366.000,00                                      | BRL                | 416.449,02        | USD                  | 6.975,81  | 12.01.2022  |
| 145.028.000,00                                    | COP                | 38.357,05         | USD                  | (2.774,48)  | 12.01.2022  |
| 1.922.000,00                                      | MXN                | 91.254,25         | USD                  | 2.583,34  | 12.01.2022  |
| 11.286.000,00                                     | RUB                | 152.212,59        | USD                  | (2.796,48)  | 12.01.2022  |
| 4.975.000,00                                      | THB                | 147.123,62        | USD                  | 2.133,48  | 12.01.2022  |
| 7.692.000,00                                      | TWD                | 276.645,87        | USD                  | 1.058,93  | 12.01.2022  |
| 1.607.996,92                                      | USD                | 10.456.000,00     | CNY                  | (35.316,83)   | 12.01.2022  |
| 174.314,60  | USD                | 681.401.000,00    | COP                  | 7.133,26  | 12.01.2022  |
| 48.207,35   | USD                | 1.020.000,00      | MXN                  | (1.591,99)  | 12.01.2022  |
| 263.973,24  | USD                | 1.154.000,00      | RON                  | 82,36   | 12.01.2022  |
| 848.732,72  | USD                | 8.442.000,00      | TRY                  | 226.466,10  | 12.01.2022  |
| 2.006.000,00                                      | ZAR                | 129.129,95        | USD                  | (3.571,87)  | 12.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>200.381,63</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                    |                   |                      |   |             |
| 4.152.000,00                                      | BRL                | 751.833,41        | USD                  | (8.781,36)  | 12.01.2022  |
| 371.051.000,00                                    | CLP                | 441.383,03        | USD                  | (6.585,39)  | 12.01.2022  |
| 205.156.000,00                                    | COP                | 54.134,16         | USD                  | (3.799,21)  | 12.01.2022  |
| 682.000,00  | CZK                | 31.018,31         | USD                  | 4,21  | 12.01.2022  |
| 181.000,00  | EUR                | 205.170,05        | USD                  | (111,84)  | 12.01.2022  |
| 661.000,00  | INR                | 8.822,86          | USD                  | 43,81   | 12.01.2022  |
| 13.976.000,00                                     | MXN                | 650.683,35        | USD                  | 31.665,10   | 12.01.2022  |
| 9.196.000,00                                      | MYR                | 2.193.883,55      | USD                  | 14.579,15   | 12.01.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                              | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|--|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| 165.000,00                                     | RON               | 38.644,27          | USD                | (912,89)   | 12.01.2022 |
| 8.285.000,00                                   | RUB               | 113.702,48         | USD                | (4.016,78)   | 12.01.2022 |
| 12.525.000,00                                  | THB               | 380.537,16         | USD                | (4.769,11)   | 12.01.2022 |
| 5.793.000,00                                   | TRY               | 499.889,37         | USD                | (72.884,07)  | 12.01.2022 |
| 213.084,11                                     | USD               | 1.197.000,00       | BRL                | (1.133,84)   | 12.01.2022 |
| 42.974,03                                      | USD               | 36.007.000,00      | CLP                | 781,02   | 12.01.2022 |
| 133.922,41                                     | USD               | 535.849.000,00     | COP                | 2.452,25   | 12.01.2022 |
| 457.052,02                                     | USD               | 10.010.000,00      | CZK                | 1.721,40   | 12.01.2022 |
| 455.873,54                                     | USD               | 6.539.506.000,00   | IDR                | (3.861,08)   | 12.01.2022 |
| 527.409,79                                     | USD               | 11.349.000,00      | MXN                | (26.680,96)  | 12.01.2022 |
| 76.699,06                                      | USD               | 337.000,00         | RON                | (364,39)   | 12.01.2022 |
| 403.438,48                                     | USD               | 13.493.000,00      | THB                | (1.370,85)   | 12.01.2022 |
| 81.162,13                                      | USD               | 963.000,00         | TRY                | 10.178,89  | 12.01.2022 |
| 3.872.000,00                                   | ZAR               | 239.020,81         | USD                | 3.332,41   | 12.01.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>(70.513,53)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: HSBC Continental Europe SA</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 2.502.000,00                                   | BRL               | 447.516,12         | USD                | 247,77   | 12.01.2022 |
| 10.830.000,00                                  | CLP               | 13.166,45          | USD                | (475,85)   | 12.01.2022 |
| 1.619.693.000,00                               | COP               | 421.079,00         | USD                | (23.688,09)  | 12.01.2022 |
| 2.366.000,00                                   | CZK               | 106.923,31         | USD                | 700,28   | 12.01.2022 |
| 1.752.777.000,00                               | IDR               | 121.260,84         | USD                | 1.961,33   | 12.01.2022 |
| 26.538.000,00                                  | MXN               | 1.283.337,62       | USD                | 12.324,55  | 12.01.2022 |
| 15.617.000,00                                  | PHP               | 309.357,99         | USD                | (4.873,08)   | 12.01.2022 |
| 1.915.000,00                                   | PLN               | 458.986,72         | USD                | 12.584,38  | 12.01.2022 |
| 1.104.000,00                                   | RUB               | 15.314,25          | USD                | (698,31)   | 12.01.2022 |
| 709.224,22                                     | USD               | 3.986.000,00       | BRL                | (4.119,75)   | 12.01.2022 |
| 1.243.279,73                                   | USD               | 7.999.000,00       | CNY                | (13.880,77)  | 12.01.2022 |
| 500.164,09                                     | USD               | 7.215.067.000,00   | IDR                | (7.063,16)   | 12.01.2022 |
| 715.714,40                                     | USD               | 14.749.000,00      | MXN                | (4.374,63)   | 12.01.2022 |
| 160.081,10                                     | USD               | 655.000,00         | PEN                | (3.954,94)   | 12.01.2022 |
| 666.977,60                                     | USD               | 2.709.000,00       | PLN                | (117,27)   | 12.01.2022 |
| 273.648,42                                     | USD               | 3.081.000,00       | TRY                | 46.546,05  | 12.01.2022 |
| 1.535.849,74                                   | USD               | 42.520.000,00      | TWD                | 747,09   | 12.01.2022 |
| 7.995.000,00                                   | TRY               | 418.205,62         | USD                | 142.634,47   | 09.03.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>154.500,07</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>               |                   |                    |                    |  |            |
| 1.614.000,00                                   | BRL               | 287.225,45         | USD                | 1.619,81   | 12.01.2022 |
| 14.877.000,00                                  | CZK               | 678.952,12         | USD                | (2.233,48)   | 12.01.2022 |
| 566.023.000,00                                 | KRW               | 482.522,48         | USD                | (7.192,35)   | 12.01.2022 |
| 6.527.000,00                                   | PLN               | 1.410.135,66       | EUR                | 9.713,86   | 12.01.2022 |
| 943.000,00                                     | PLN               | 236.126,10         | USD                | (3.911,02)   | 12.01.2022 |
| 2.367.000,00                                   | RUB               | 31.863,44          | USD                | (526,57)   | 12.01.2022 |
| 1.555.000,00                                   | THB               | 46.469,08          | USD                | 183,14   | 12.01.2022 |
| 632.917,12                                     | USD               | 2.402.400.000,00   | COP                | 43.489,20  | 12.01.2022 |
| 883.894,12                                     | USD               | 19.492.000,00      | CZK                | (2.749,57)   | 12.01.2022 |
| 76.850,53                                      | USD               | 24.918.000,00      | HUF                | 492,65   | 12.01.2022 |
| 219.796,29                                     | USD               | 3.161.330.000,00   | IDR                | (2.448,75)   | 12.01.2022 |
| 563.854,32                                     | USD               | 669.577.000,00     | KRW                | 1.562,64   | 12.01.2022 |
| 249.535,46                                     | USD               | 5.247.000,00       | MXN                | (6.638,23)   | 12.01.2022 |
| 2.616.303,41                                   | USD               | 10.417.000,00      | PLN                | 51.102,37  | 12.01.2022 |
| 584.549,72                                     | USD               | 42.495.000,00      | RUB                | 21.955,38  | 12.01.2022 |
| 300.800,71                                     | USD               | 413.000,00         | SGD                | (5.196,83)   | 12.01.2022 |
| 51.743,60                                      | USD               | 517.000,00         | TRY                | 13.635,12  | 12.01.2022 |
| 514.846,83                                     | USD               | 8.188.000,00       | ZAR                | 2.349,73   | 12.01.2022 |
| 3.320.000,00                                   | ZAR               | 207.387,62         | USD                | 415,28   | 12.01.2022 |
| 3.427.000,00                                   | TRY               | 256.074,06         | USD                | (15.664,64)  | 09.03.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>99.957,74</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>        |                   |                    |                    |  |            |
| 8.671.000,00                                   | CNY               | 1.351.615,33       | USD                | 11.159,95  | 12.01.2022 |
| 20.031.781.000,00                              | IDR               | 1.396.269,12       | USD                | 11.987,58  | 12.01.2022 |
| 1.596.000,00                                   | MXN               | 75.762,28          | USD                | 2.159,05   | 12.01.2022 |
| 2.217.000,00                                   | RON               | 506.546,73         | USD                | 425,58   | 12.01.2022 |
| 7.277.000,00                                   | THB               | 217.920,67         | USD                | 399,77   | 12.01.2022 |
| 285.910,27                                     | USD               | 1.834.000,00       | CNY                | (2.329,83)   | 12.01.2022 |
| 535.476,78                                     | USD               | 17.654.000,00      | THB                | 5.831,35   | 12.01.2022 |
| 7.621.000,00                                   | ZAR               | 482.916,91         | USD                | (5.908,98)   | 12.01.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>23.724,47</b>   |            |
|  |                   |                    |                    | <b>251.453,87</b>  |            |
|  |                   |                    |                    | <b>244.968,89</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>vom 30.12.2021 bis 31.12.2021<br>in der Basiswährung des<br>Teilfonds (USD) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (USD) |
|--|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                      |                             |   |  |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (16,00)                              | (2.087.750,08)              | (1.250,08)  | (21.875,00)  |
|  |            |         |                                      |                             | <b>(1.250,08)</b>   | <b>(21.875,00)</b>   |

### Zinsswaps

| Beschreibung                                     | Nominal         | Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs<br>(Wertminderung) im Teilfonds<br>Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|--|-----------------|---------|--|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate 1.9675%                        | (1.500.000,00)  | CZK     | 6.407,33   | 25.05.2028 |
| Receiving floating rate PRIBOR 6 months          |                 |         |  |            |
|  |                 |         | <b>6.407,33</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                 |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.5600%                     | 16.500.000,00   | THB     | (6.863,64)   | 20.05.2031 |
| Paying floating rate THFX 6 months               |                 |         |  |            |
|  |                 |         | <b>(6.863,64)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |                 |         |  |            |
| Receiving fixed rate 5.2250%                     | 9.946.640,74    | BRL     | (114.648,16)   | 02.01.2023 |
| Paying floating rate BZDIOVRA1D                  |                 |         |  |            |
|  |                 |         | <b>(114.648,16)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate 3.1000%                        | (2.345.000,00)  | MYR     | 8.932,59   | 18.05.2031 |
| Receiving floating rate KLIBOR 3 months          |                 |         |  |            |
|  |                 |         | <b>8.932,59</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |                 |         |  |            |
| Paying floating rate MXN_28D 28 days             | (13.000.000,00) | MXN     | 5.699,56   | 17.07.2023 |
| Receiving fixed rate 7.8050%                     |                 |         |  |            |
| Receiving fixed rate 6.3550%                     | 3.524.816,44    | BRL     | (48.014,12)  | 03.07.2023 |
| Paying floating rate BZDIOVRA1D                  |                 |         |  |            |
| Receiving fixed rate 0.7850%                     | 120.000.000,00  | THB     | 2.751,63   | 25.02.2022 |
| Paying floating rate THFX 6 months               |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate 3.1250%                        | (2.345.000,00)  | MYR     | 7.726,74   | 12.05.2031 |
| Receiving floating rate KLIBOR 3 months          |                 |         |  |            |
|  |                 |         | <b>(31.836,19)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>     |                 |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.6050%                     | 16.500.000,00   | THB     | (4.915,58)   | 14.05.2031 |
| Paying floating rate THFX 6 months               |                 |         |  |            |
|  |                 |         | <b>(4.915,58)</b>  |            |
|  |                 |         | <b>(142.923,65)</b>  |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                          | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------------------------------|----------------------------|------------------------------|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| <b>CNY</b>  |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| 144.100,00  | Wuliangye Yibin                       | 4.444.702,40               | 3,19                         | 318.555,00  | Trip.com Group ADR                              | 7.014.313,08               | 5,03                         |
|   |                                       | <b>4.444.702,40</b>        | <b>3,19</b>                  | 4.910,00  | Walt Disney                                     | 674.434,12                 | 0,48                         |
| <b>DKK</b>  |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| 5.814,00  | Chr. Hansen Holding                   | 402.960,53                 | 0,29                         | 121.195,00  | Yum China Holdings                              | 5.289.073,29               | 3,79                         |
| 25.135,00   | Novo Nordisk B                        | 2.484.330,09               | 1,78                         |   |   | <b>43.537.437,22</b>       | <b>31,23</b>                 |
|   |                                       | <b>2.887.290,62</b>        | <b>2,07</b>                  | <b>Summe Aktien</b>   |   |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| 1.009,00  | Hermes International                  | 1.549.824,00               | 1,11                         |   |   | <b>121.462.973,98</b>      | <b>87,11</b>                 |
| 155.700,00  | Infinion Technologies                 | 6.346.332,00               | 4,55                         | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   |   |                            |                              |
| 2.058,00  | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton      | 1.496.166,00               | 1,07                         |   |   | <b>121.462.973,98</b>      | <b>87,11</b>                 |
| 21.820,00   | Moncler                               | 1.396.916,40               | 1,00                         | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |   |                            |                              |
|   |                                       | <b>10.789.238,40</b>       | <b>7,74</b>                  | <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |
| <b>HKD</b>  |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| 470.400,00  | AIA Group                             | 4.185.468,46               | 3,00                         | <b>CNY</b>  |   |                            |                              |
| 407.352,00  | Alibaba Group Holding                 | 5.482.844,42               | 3,93                         | 49.000,00   | Angel Yeast                                     | 409.714,95                 | 0,29                         |
| 758.398,00  | Alibaba Health Information Technology | 565.765,95                 | 0,41                         | 7.900,00  | Beijing Kingsoft Office Software                | 290.007,66                 | 0,21                         |
| 280.400,00  | Baidu                                 | 4.589.871,40               | 3,29                         | 1.186.863,00  | China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical | 5.629.513,29               | 4,04                         |
| 2.157.600,00  | China International Capital           | 5.251.261,05               | 3,77                         | 404.880,00  | East Money Information                          | 2.081.391,52               | 1,49                         |
| 582.480,00  | CSPC Pharmaceutical Group             | 558.494,17                 | 0,40                         | 114.060,00  | Foshan Haitian Flavouring & Food                | 1.660.786,88               | 1,19                         |
| 641.000,00  | Haidilao International Holding        | 1.277.100,02               | 0,92                         | 128.869,00  | Jiangsu Hengrui Medicine                        | 905.270,92                 | 0,65                         |
| 49.000,00   | Hong Kong Exchanges & Clearing        | 2.526.058,02               | 1,81                         | 78.400,00   | Shenzhen Inovance Technology                    | 745.035,01                 | 0,53                         |
| 58.900,00   | JD Health International               | 409.723,99                 | 0,29                         | 42.500,00   | Skshu Paint                                     | 819.235,27                 | 0,59                         |
| 404.600,00  | Kingsoft                              | 1.568.702,79               | 1,13                         |   |   | <b>12.540.955,50</b>       | <b>8,99</b>                  |
| 32.775,00   | Kuaishou Technology                   | 267.319,66                 | 0,19                         | <b>Summe Aktien</b>   |   |                            |                              |
| 45.900,00   | Meituan                               | 1.171.172,35               | 0,84                         |   |   | <b>12.540.955,50</b>       | <b>8,99</b>                  |
| 2.836.400,00  | Sands China                           | 5.830.926,08               | 4,18                         | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |   |                            |                              |
| 131.450,00  | Tencent Holdings                      | 6.797.369,85               | 4,88                         |   |   | <b>12.540.955,50</b>       | <b>8,99</b>                  |
| 137.000,00  | Wuxi Biologics Cayman                 | 1.435.328,16               | 1,03                         | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  |   |                            |                              |
| 180.400,00  | Yeahka                                | 526.878,47                 | 0,38                         |   |   | <b>134.003.929,48</b>      | <b>96,11</b>                 |
|   |                                       | <b>42.444.284,84</b>       | <b>30,44</b>                 | <b>Bankguthaben</b>   |   |                            |                              |
| <b>IDR</b>  |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| 921.200,00  | Bank Central Asia                     | 416.598,88                 | 0,30                         |   |   | <b>6.358.720,65</b>        | <b>4,56</b>                  |
|   |                                       | <b>416.598,88</b>          | <b>0,30</b>                  | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  |   |                            |                              |
| <b>INR</b>  |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| 49.605,00   | Asian Paints                          | 1.993.095,71               | 1,43                         |   |   | <b>(934.013,54)</b>        | <b>(0,67)</b>                |
| 77.940,00   | Eicher Motors                         | 2.399.306,69               | 1,72                         | <b>Summe Nettovermögen</b>  |   |                            |                              |
| 39.950,00   | Jubilant Foodworks                    | 1.703.928,65               | 1,22                         |   |   | <b>139.428.636,59</b>      | <b>100,00</b>                |
| 244.825,00  | Kotak Mahindra Bank                   | 5.222.679,77               | 3,75                         |   |   |                            |                              |
| 329.800,00  | LIC Housing Finance                   | 1.447.933,06               | 1,04                         |   |   |                            |                              |
| 40.785,00   | Titan                                 | 1.221.860,28               | 0,88                         |   |   |                            |                              |
|   |                                       | <b>13.988.804,16</b>       | <b>10,03</b>                 |   |   |                            |                              |
| <b>KRW</b>  |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| 17.050,00   | SK Hynix                              | 1.658.857,59               | 1,19                         |   |   |                            |                              |
|   |                                       | <b>1.658.857,59</b>        | <b>1,19</b>                  |   |   |                            |                              |
| <b>MXN</b>  |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| 153.750,00  | Wal-Mart de Mexico                    | 507.063,02                 | 0,36                         |   |   |                            |                              |
|   |                                       | <b>507.063,02</b>          | <b>0,36</b>                  |   |   |                            |                              |
| <b>NGN</b>  |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| 8.846.095,00  | Standard Alliance Insurance           | 3.683,05                   | 0,00                         |   |   |                            |                              |
|   |                                       | <b>3.683,05</b>            | <b>0,00</b>                  |   |   |                            |                              |
| <b>TWD</b>  |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| 40.000,00   | Taiwan Semiconductor Manufacturing    | 785.013,80                 | 0,56                         |   |   |                            |                              |
|   |                                       | <b>785.013,80</b>          | <b>0,56</b>                  |   |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |                                       |                            |                              |   |   |                            |                              |
| 2.806,00  | Estee Lauder Cos                      | 912.392,83                 | 0,65                         |   |   |                            |                              |
| 98.671,00   | HDFC Bank ADR                         | 5.659.001,60               | 4,06                         |   |   |                            |                              |
| 126.260,00  | Huazhu Group ADR                      | 4.185.814,69               | 3,00                         |   |   |                            |                              |
| 3.400,00  | KLA                                   | 1.287.056,02               | 0,92                         |   |   |                            |                              |
| 141.769,00  | MakeMyTrip                            | 3.558.462,61               | 2,55                         |   |   |                            |                              |
| 5.041,00  | Mastercard                            | 1.609.523,90               | 1,15                         |   |   |                            |                              |
| 5.366,00  | NIKE                                  | 790.130,65                 | 0,57                         |   |   |                            |                              |
| 30.919,00   | Ozon Holdings ADR                     | 826.854,29                 | 0,59                         |   |   |                            |                              |
| 53.661,00   | QUALCOMM                              | 8.688.377,52               | 6,23                         |   |   |                            |                              |
| 4.802,00  | Starbucks                             | 494.466,31                 | 0,35                         |   |   |                            |                              |
| 416.975,00  | Tencent Music Entertainment ADR       | 2.547.536,31               | 1,83                         |   |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| Kaimaninseln           | 30,92        | Halbleiter  | 12,54        |
| China                  | 15,95        | Hotels, Ferienanlagen und Kreuzfahrtslinien         | 10,59        |
| USA                    | 14,16        | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 8,36         |
| Indien                 | 14,09        | Verschiedene Banken                                 | 8,10         |
| Hongkong               | 5,21         | Pharmazeutika                                       | 6,87         |
| Deutschland            | 4,55         | Restaurants   | 6,29         |
| Mauritius              | 2,55         | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 5,66         |
| Frankreich             | 2,18         | Casinos und Glücksspiel                             | 4,18         |
| Dänemark               | 2,07         | Bekleidung, Accessoires und Luxusgüter              | 4,06         |
| Republik Korea         | 1,19         | Investmentbanken und Broker                         | 3,77         |
| Italien                | 1,00         | Börsen und Finanzdaten                              | 3,30         |
| Zypern                 | 0,59         | Brennereien und Winzereien                          | 3,19         |
| Taiwan, Provinz Chinas | 0,56         | Lebens- und Krankenversicherung                     | 3,00         |
| Bermuda                | 0,41         | Filme und Entertainment                             | 2,31         |
| Mexiko                 | 0,36         | Motorradhersteller                                  | 1,72         |
| Indonesien             | 0,30         | Spezialchemikalien                                  | 1,72         |
|                        |              | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 1,53         |
|                        |              | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 1,48         |
|                        |              | Interaktives Home Entertainment                     | 1,13         |
|                        |              | Bausparkassen und Hypothekenfinanzierung            | 1,04         |
|                        |              | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen      | 1,03         |
|                        |              | Halbleiter-Ausrüstung                               | 0,92         |
|                        |              | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 0,65         |
|                        |              | Rohstoffchemikalien                                 | 0,59         |
|                        |              | Schuhe  | 0,57         |
|                        |              | Industriemaschinen                                  | 0,53         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Technologie                       | 0,41         |
|                        |              | Großmärkte  | 0,36         |
|                        |              | Anwendungssoftware                                  | 0,21         |
|                        |              | <b>Summe</b>  | <b>96,11</b> |
| <b>Summe</b>           | <b>96,11</b> |   |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|---|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |   |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |   |            |
| 546,61  | EUR               | 2.551,26           | PLN                | (713)   | 28.01.2022 |
| 16.487,32   | PLN               | 3.488,06           | EUR                | 90,48   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>83,35</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - European Corporate Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapiieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 3.800.000,00  | Abanca Corp Bancaria SA 0.500% MULTI 08-09-2027 | 3.723.589,60               | 0,68                         | 185.000,00         | British Telecommunications P 1.5% 23-06-2027   | 190.759,42                 | 0,03                         |
| 103.000,00  | AbbVie Inc 2.125% 01-06-2029                    | 113.545,55                 | 0,02                         | 2.776.000,00       | British Telecommunications P 1.75% 10-03-2026  | 2.890.343,44               | 0,53                         |
| 3.333.000,00  | AbbVie Inc 2.625% 15-11-2028                    | 3.783.088,25               | 0,69                         | 3.787.000,00       | British Telecommunications P 2.125% 26-09-2028 | 4.033.094,41               | 0,74                         |
| 858.000,00  | Aeroporti di Roma SpA 1.625% 08-06-2027         | 883.800,06                 | 0,16                         | 5.000.000,00       | Caisse Francaise de Financem 0.01% 22-02-2028  | 4.976.410,00               | 0,91                         |
| 1.800.000,00  | Allianz SE 1.301% MULTI 25-09-2049              | 1.792.148,40               | 0,33                         | 1.800.000,00       | Caisse Francaise de Financem 0.625% 13-04-2026 | 1.850.868,00               | 0,34                         |
| 1.500.000,00  | Allianz SE 2.121% MULTI 08-07-2050              | 1.572.891,00               | 0,29                         | 600.000,00         | CaixaBank SA 2.250% MULTI 17-04-2030           | 622.870,80                 | 0,11                         |
| 3.300.000,00  | Allianz SE 2.241% MULTI 07-07-2045              | 3.465.323,40               | 0,63                         | 1.900.000,00       | Cellnex Finance Co SA 2% 15-02-2033            | 1.804.829,00               | 0,33                         |
| 1.400.000,00  | Allianz SE 5.625% MULTI 17-10-2042              | 1.459.631,60               | 0,27                         | 4.500.000,00       | Cellnex Finance Co SA 2% 15-09-2032            | 4.322.790,00               | 0,79                         |
| 5.851.000,00  | Argentum Netherlands BV 3.500% MULTI 01-10-2046 | 6.531.494,70               | 1,20                         | 1.200.000,00       | Cellnex Telecom SA 1.75% 23-10-2030            | 1.152.772,80               | 0,21                         |
| 2.082.000,00  | ASTM SpA 1% 25-11-2026                          | 2.087.646,38               | 0,38                         | 5.900.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.01% 15-07-2026  | 5.908.236,40               | 1,08                         |
| 3.624.000,00  | ASTM SpA 1.5% 25-01-2030                        | 3.569.654,50               | 0,65                         | 4.100.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.01% 25-10-2027  | 4.089.389,20               | 0,75                         |
| 3.895.000,00  | ASTM SpA 2.375% 25-11-2033                      | 3.873.086,73               | 0,71                         | 1.500.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.225% 14-09-2026 | 1.516.455,00               | 0,28                         |
| 866.000,00  | AT&T Inc 1.6% 19-05-2028                        | 914.944,59                 | 0,17                         | 1.300.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.75% 21-01-2025  | 1.335.887,80               | 0,24                         |
| 1.148.000,00  | AT&T Inc 2.45% 15-03-2035                       | 1.267.212,91               | 0,23                         | 3.273.000,00       | Cloverie PLC for Swiss 6.625% MULTI 01-09-2042 | 3.413.352,79               | 0,63                         |
| 2.843.000,00  | AT&T Inc 3.15% 04-09-2036                       | 3.376.619,73               | 0,62                         | 1.170.000,00       | Cloverie PLC for Zurich Insu 1.5% 15-12-2028   | 1.247.337,00               | 0,23                         |
| 1.751.000,00  | AT&T Inc FRN 05-09-2023                         | 1.767.627,50               | 0,32                         | 800.000,00         | Coentreprise de Transport d' 1.5% 29-07-2028   | 842.240,00                 | 0,15                         |
| 3.138.000,00  | Avinor AS 0.75% 01-10-2030                      | 3.137.428,88               | 0,57                         | 1.000.000,00       | Coentreprise de Transport d' 2.125% 29-07-2032 | 1.116.514,00               | 0,20                         |
| 6.319.000,00  | Avinor AS 1% 29-04-2025                         | 6.495.552,86               | 1,19                         | 1.027.000,00       | Commerzbank AG 0.1% 11-09-2025                 | 1.021.936,89               | 0,19                         |
| 2.843.000,00  | AXA SA 3.250% MULTI 28-05-2049                  | 3.185.017,11               | 0,58                         | 10.000,00          | Commerzbank AG 0.5% 04-12-2026                 | 10.086,60                  | 0,00                         |
| 675.000,00  | AXA SA 3.375% MULTI 06-07-2047                  | 755.122,50                 | 0,14                         | 1.118.000,00       | Commerzbank AG 0.5% 28-08-2023                 | 1.129.258,26               | 0,21                         |
| 587.000,00  | Banca Monte dei Paschi di Si 0.875% 08-10-2026  | 603.194,16                 | 0,11                         | 51.000,00          | Commerzbank AG 0.625% 28-08-2024               | 51.694,82                  | 0,01                         |
| 2.900.000,00  | Banca Monte dei Paschi di Si 2% 29-01-2024      | 3.025.581,60               | 0,55                         | 3.600.000,00       | Credit Agricole Assurances S 1.5% 06-10-2031   | 3.539.556,00               | 0,65                         |
| 300.000,00  | Banco Bilbao Vizcaya Argenta 0.625% 17-01-2022  | 300.117,00                 | 0,05                         | 2.700.000,00       | Credit Agricole Assurances S 2% 17-07-2030     | 2.787.399,00               | 0,51                         |
| 800.000,00  | Banco Bilbao Vizcaya Argenta FRN 09-09-2023     | 811.664,00                 | 0,15                         | 1.400.000,00       | Credit Agricole Home Loan SF 0.01% 12-04-2028  | 1.393.492,80               | 0,26                         |
| 12.221.000,00   | Bank of America Corp 0.694% MULTI 22-03-2031    | 12.030.288,00              | 2,20                         | 6.110.000,00       | Credit Suisse AG/London 0.25% 01-09-2028       | 5.917.388,36               | 1,08                         |
| 3.574.000,00  | Bank of America Corp 1.102% MULTI 24-05-2032    | 3.600.662,22               | 0,66                         | 819.000,00         | Daimler AG 1.625% 22-08-2023                   | 843.946,74                 | 0,15                         |
| 4.200.000,00  | Banque Federative du Credit 0.01% 07-03-2025    | 4.188.861,60               | 0,77                         | 10.000,00          | Daimler AG 1.875% 08-07-2024                   | 10.500,94                  | 0,00                         |
| 5.100.000,00  | Banque Federative du Credit 0.625% 03-11-2028   | 5.085.638,40               | 0,93                         | 3.868.000,00       | Daimler International Financ 0.625% 27-02-2023 | 3.911.205,56               | 0,72                         |
| 5.500.000,00  | Banque Federative du Credit 1.125% 19-11-2031   | 5.396.435,00               | 0,99                         | 2.470.000,00       | Danske Bank A/S 0.625% 26-05-2025              | 2.502.085,30               | 0,46                         |
| 2.000.000,00  | Banque Federative du Credit 1.25% 26-05-2027    | 2.091.976,00               | 0,38                         | 769.000,00         | Danske Bank A/S 1.500% MULTI 02-09-2030        | 781.127,13                 | 0,14                         |
| 2.100.000,00  | Banque Federative du Credit 1.875% 18-06-2029   | 2.214.374,40               | 0,41                         | 2.200.000,00       | Danske Mortgage Bank PLC 0.375% 21-11-2023     | 2.229.722,00               | 0,41                         |
| 3.300.000,00  | Bayer AG 0.05% 12-01-2025                       | 3.289.921,80               | 0,60                         | 4.300.000,00       | de Volksbank NV 0.375% 03-03-2028              | 4.221.069,20               | 0,77                         |
| 1.500.000,00  | Bayer AG 0.75% 06-01-2027                       | 1.517.994,00               | 0,28                         | 5.500.000,00       | de Volksbank NV 1.750% MULTI 22-10-2030        | 5.695.756,00               | 1,04                         |
| 1.200.000,00  | Bayer Capital Corp BV 1.5% 26-06-2026           | 1.257.544,80               | 0,23                         | 1.900.000,00       | Deutsche Bahn Finance 0.950% MULTI Perp FC2025 | 1.890.500,00               | 0,35                         |
| 115.000,00  | BMW Finance NV 0.000000% 24-03-2023             | 115.414,00                 | 0,02                         | 1.804.000,00       | Deutsche Bahn Finance GMBH 0.625% 15-04-2036   | 1.730.043,22               | 0,32                         |
| 800.000,00  | BMW Finance NV 0.375% 10-07-2023                | 807.592,00                 | 0,15                         | 4.444.000,00       | DNB Boligkreditt AS 0.01% 08-10-2027           | 4.427.894,94               | 0,81                         |
| 867.000,00  | BMW Finance NV 0.625% 06-10-2023                | 879.599,24                 | 0,16                         | 4.520.000,00       | DNB Boligkreditt AS 0.01% 12-05-2028           | 4.491.524,00               | 0,82                         |
| 2.659.000,00  | Booking Holdings Inc 0.1% 08-03-2025            | 2.659.303,13               | 0,49                         | 502.000,00         | DNB Boligkreditt AS 0.25% 07-09-2026           | 507.858,34                 | 0,09                         |
| 2.300.000,00  | BPCE SA 0.25% 14-01-2031                        | 2.198.800,00               | 0,40                         | 588.000,00         | DNB Boligkreditt AS 0.375% 20-11-2024          | 597.404,47                 | 0,11                         |
| 100.000,00  | BPCE SA 0.625% 15-01-2030                       | 99.865,40                  | 0,02                         | 2.197.000,00       | DXC Capital Funding DAC 0.45% 15-09-2027       | 2.128.677,69               | 0,39                         |
| 900.000,00  | BPCE SA 1.125% 18-01-2023                       | 913.514,40                 | 0,17                         | 2.915.000,00       | DZ HYP AG 0.01% 26-10-2026                     | 2.921.972,68               | 0,54                         |
| 400.000,00  | BPCE SA 2.875% 16-01-2024                       | 425.585,60                 | 0,08                         |                    |  |                            |                              |
| 700.000,00  | BPCE SFH SA 0.5% 11-10-2022                     | 705.528,60                 | 0,13                         |                    |  |                            |                              |
| 195.000,00  | British Telecommunications P 0.5% 12-09-2025    | 195.645,45                 | 0,04                         |                    |  |                            |                              |
| 4.434.000,00  | British Telecommunications P 1.125% 10-03-2023  | 4.493.823,53               | 0,82                         |                    |  |                            |                              |
| 1.178.000,00  | British Telecommunications P 1.125% 12-09-2029  | 1.190.840,20               | 0,22                         |                    |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Corporate Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 168.000,00         | E.ON International Finance B 3% 17-01-2024        | 178.701,60                 | 0,03                         | 2.681.000,00       | National Grid PLC 0.163% 20-01-2028             | 2.615.985,75               | 0,48                         |
| 1.435.000,00       | Eika Boligkredit AS 2.125% 30-01-2023             | 1.475.610,50               | 0,27                         | 4.333.000,00       | National Grid PLC 0.553% 18-09-2029             | 4.296.524,81               | 0,79                         |
| 3.800.000,00       | Electricite de France 2.625% MULTI Perp FC2027    | 3.809.500,00               | 0,70                         | 1.537.000,00       | National Grid PLC 0.75% 01-09-2033              | 1.494.136,14               | 0,27                         |
| 600.000,00         | Electricite de France 4.000% MULTI Perp FC2024    | 634.554,00                 | 0,12                         | 2.293.000,00       | Nationwide Building Society 0.25% 14-09-2028    | 2.249.501,79               | 0,41                         |
| 100.000,00         | Electricite de France SA 3.875% 18-01-2022        | 100.166,00                 | 0,02                         | 1.215.000,00       | Nationwide Building Society 0.625% 19-04-2023   | 1.230.394,05               | 0,23                         |
| 5.598.000,00       | Elering AS 0.875% 03-05-2023                      | 5.649.235,70               | 1,03                         | 6.916.000,00       | Natwest Group PLC 0.670% MULTI 14-09-2029       | 6.788.856,26               | 1,24                         |
| 1.545.000,00       | Enel Finance International N 0.000000% 28-05-2026 | 1.523.524,50               | 0,28                         | 2.967.000,00       | Natwest Group PLC 1.043% MULTI 14-09-2032       | 2.921.598,97               | 0,54                         |
| 400.000,00         | Eurogrid GmbH 1.625% 03-11-2023                   | 410.992,00                 | 0,08                         | 1.820.000,00       | NGG Finance PLC 2.125% MULTI 05-09-2082         | 1.838.200,00               | 0,34                         |
| 2.500.000,00       | Eutelsat SA 1.5% 13-10-2028                       | 2.523.335,00               | 0,46                         | 3.231.000,00       | Nykredit Realkredit 0.75% 01-20-2027            | 3.267.980,73               | 0,60                         |
| 5.150.000,00       | Fiat Chrysler Finance Europe 4.75% 15-07-2022     | 5.285.630,40               | 0,97                         | 2.100.000,00       | Nykredit Realkredit FRN 07-28-2031              | 2.090.466,00               | 0,38                         |
| 2.209.000,00       | Fidelity National Informatio 0.75% 21-05-2023     | 2.232.760,00               | 0,41                         | 2.937.000,00       | PPF Telecom Group BV 2.125% 31-01-2025          | 3.000.145,50               | 0,55                         |
| 1.469.000,00       | Fresenius Finance Ireland PL 0.000000% 01-10-2025 | 1.451.210,41               | 0,27                         | 1.239.000,00       | PPF Telecom Group BV 3.125% 27-03-2026          | 1.314.269,25               | 0,24                         |
| 4.591.000,00       | Global Switch Finance BV 1.375% 07-10-2030        | 4.550.195,19               | 0,83                         | 1.713.000,00       | PPF Telecom Group BV 3.25% 29-09-2027           | 1.836.164,70               | 0,34                         |
| 9.534.000,00       | Global Switch Holdings Ltd 2.25% 31-05-2027       | 9.811.134,31               | 1,80                         | 108.000,00         | RELX Finance BV 0.000000% 18-03-2024            | 108.166,32                 | 0,02                         |
| 1.800.000,00       | Goldman Sachs Group Inc/The FRN 26-09-2023        | 1.804.464,00               | 0,33                         | 500.000,00         | Renault SA 1% 18-04-2024                        | 498.750,00                 | 0,09                         |
| 3.992.000,00       | H Lundbeck A/S 0.875% 14-10-2027                  | 4.022.882,11               | 0,74                         | 3.047.000,00       | Renault SA 1% 28-11-2025                        | 3.008.912,50               | 0,55                         |
| 1.500.000,00       | Hannover Rueck SE 1.750% MULTI 08-10-2040         | 1.531.169,25               | 0,28                         | 900.000,00         | Renault SA 1.25% 24-06-2025                     | 883.427,40                 | 0,16                         |
| 3.300.000,00       | Holding d'Infrastructures de 0.625% 14-09-2028    | 3.221.149,80               | 0,59                         | 800.000,00         | RTE Reseau de Transport d'El 0.625% 08-07-2032  | 788.784,00                 | 0,14                         |
| 4.900.000,00       | Holding d'Infrastructures de 1.625% 18-09-2029    | 5.104.780,80               | 0,94                         | 5.100.000,00       | RTE Reseau de Transport d'El 1.125% 08-07-2040  | 5.119.380,00               | 0,94                         |
| 900.000,00         | Holding d'Infrastructures de 1.625% 27-11-2027    | 940.519,80                 | 0,17                         | 2.100.000,00       | RTE Reseau de Transport d'El 1.625% 08-10-2024  | 2.188.452,00               | 0,40                         |
| 2.700.000,00       | Holding d'Infrastructures de 2.5% 04-05-2027      | 2.945.365,20               | 0,54                         | 1.800.000,00       | RTE Reseau de Transport d'El 1.625% 27-11-2025  | 1.899.014,40               | 0,35                         |
| 300.000,00         | HSBC Bank PLC FRN 08-03-2023                      | 303.215,40                 | 0,06                         | 1.100.000,00       | RTE Reseau de Transport d'El 2% 18-04-2036      | 1.247.292,20               | 0,23                         |
| 1.713.000,00       | Intesa Sanpaolo SpA 1.125% 04-03-2022             | 1.717.364,72               | 0,31                         | 931.000,00         | Scania CV AB 0.000000% 23-11-2022               | 932.005,48                 | 0,17                         |
| 4.424.000,00       | JPMorgan Chase & Co 0.597% MULTI 17-02-2033       | 4.262.037,36               | 0,78                         | 2.584.000,00       | SES SA 2% 02-07-2028                            | 2.718.068,26               | 0,50                         |
| 679.000,00         | JPMorgan Chase & Co 1.001% MULTI 25-07-2031       | 687.805,27                 | 0,13                         | 3.040.000,00       | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.01% 22-09-2027     | 3.031.378,56               | 0,56                         |
| 2.224.000,00       | JPMorgan Chase & Co 1.638% MULTI 18-05-2028       | 2.353.432,35               | 0,43                         | 3.474.000,00       | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.05% 03-11-2028     | 3.451.794,19               | 0,63                         |
| 2.917.000,00       | Jyske Bank A/S 2.250% MULTI 05-04-2029            | 3.014.894,52               | 0,55                         | 3.115.000,00       | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.125% 14-05-2026    | 3.136.717,78               | 0,57                         |
| 149.000,00         | Kraft Heinz Foods Co 1.5% 24-05-2024              | 152.888,01                 | 0,03                         | 2.432.000,00       | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.25% 30-08-2026     | 2.461.013,76               | 0,45                         |
| 1.445.000,00       | Kraft Heinz Foods Co 2.25% 25-05-2028             | 1.547.479,40               | 0,28                         | 1.585.000,00       | Sparebanken Soer Boligkredit 0.01% 26-10-2026   | 1.583.988,77               | 0,29                         |
| 4.709.000,00       | LeasePlan Corp NV 0.125% 13-09-2023               | 4.721.073,88               | 0,86                         | 1.145.000,00       | Sparebanken Vest Boligkredit 0.375% 14-02-2024  | 1.161.400,98               | 0,21                         |
| 2.491.000,00       | LeasePlan Corp NV 0.25% 07-09-2026                | 2.457.356,55               | 0,45                         | 4.298.000,00       | Statkraft AS 1.125% 20-03-2025                  | 4.428.753,76               | 0,81                         |
| 6.938.000,00       | LeasePlan Corp NV 0.25% 23-02-2026                | 6.884.286,00               | 1,26                         | 6.262.000,00       | Statkraft AS 1.5% 21-09-2023                    | 6.411.787,04               | 1,17                         |
| 801.000,00         | LeasePlan Corp NV 3.5% 09-04-2025                 | 885.359,72                 | 0,16                         | 603.000,00         | Statkraft AS 1.5% 26-03-2030                    | 647.888,53                 | 0,12                         |
| 2.014.000,00       | Lseg Netherlands BV 0.000000% 06-04-2025          | 2.008.380,94               | 0,37                         | 2.300.000,00       | Stellantis NV 2% 20-03-2025                     | 2.415.460,00               | 0,44                         |
| 1.399.000,00       | Molnlycke Holding AB 0.875% 05-09-2029            | 1.397.866,81               | 0,26                         | 4.438.000,00       | Stellantis NV 3.875% 05-01-2026                 | 4.999.806,42               | 0,92                         |
| 2.108.000,00       | Molnlycke Holding AB 1.75% 28-02-2024             | 2.183.023,72               | 0,40                         | 1.500.000,00       | Swiss Re Finance UK PLC 2.714% MULTI 04-06-2052 | 1.602.912,00               | 0,29                         |
| 6.558.000,00       | Moody's Corp 0.95% 25-02-2030                     | 6.683.323,38               | 1,22                         | 759.000,00         | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1% 09-07-2029      | 776.604,25                 | 0,14                         |
| 2.226.000,00       | Motability Operations Group 0.875% 14-03-2025     | 2.280.982,20               | 0,42                         | 6.204.000,00       | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1.375% 09-07-2032  | 6.432.021,82               | 1,18                         |
| 1.658.000,00       | Motability Operations Group 1.625% 09-06-2023     | 1.702.358,13               | 0,31                         | 169.000,00         | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3% 21-11-2030      | 200.190,64                 | 0,04                         |
| 6.381.000,00       | MPT Operating Partnership LP 0.993% 15-10-2026    | 6.331.483,44               | 1,16                         | 1.200.000,00       | Talanx Finanz Luxembour 8.367% MULTI 15-06-2042 | 1.243.752,00               | 0,23                         |
| 5.817.000,00       | Nasdaq Inc 0.875% 13-02-2030                      | 5.822.735,56               | 1,07                         | 4.527.000,00       | Teollisuuden Voima Oyj 1.125% 09-03-2026        | 4.504.681,89               | 0,83                         |
| 3.372.000,00       | Nasdaq Inc 0.9% 30-07-2033                        | 3.281.866,44               | 0,60                         | 3.737.000,00       | Teollisuuden Voima Oyj 1.375% 23-06-2028        | 3.674.891,06               | 0,67                         |
| 425.000,00         | National Grid Electricity Tr 0.872% 26-11-2040    | 399.146,40                 | 0,07                         | 2.626.000,00       | Teollisuuden Voima Oyj 2% 08-05-2024            | 2.705.557,30               | 0,50                         |
|                    |   |                            |                              | 6.128.000,00       | Teollisuuden Voima Oyj 2.125% 04-02-2025        | 6.369.345,15               | 1,17                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - European Corporate Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 1.309.000,00       | Thermo Fisher Scientific Inc 1.4%<br>23-01-2026   | 1.368.842,24               | 0,25                         |                    |   |                            |                              |
| 565.000,00         | Thermo Fisher Scientific Inc 1.45%<br>16-03-2027  | 596.732,66                 | 0,11                         |                    |   |                            |                              |
| 5.300.000,00       | Traton Finance Luxembourg SA<br>0.125% 24-03-2025   | 5.267.256,60               | 0,96                         |                    |   |                            |                              |
| 4.338.000,00       | UBS AG/London 0.5% 31-03-2031   | 4.265.954,50               | 0,78                         |                    |   |                            |                              |
| 2.911.000,00       | UBS AG/London 0.625% 23-01-<br>2023   | 2.936.861,32               | 0,54                         |                    |   |                            |                              |
| 403.000,00         | UBS AG/London 0.75% 21-04-<br>2023  | 407.760,24                 | 0,07                         |                    |   |                            |                              |
| 2.922.000,00       | UBS Group AG 0.875% 03-11-2031  | 2.906.238,73               | 0,53                         |                    |   |                            |                              |
| 3.200.000,00       | Unicaja Banco SA 1.000% MULTI<br>01-12-2026   | 3.185.504,00               | 0,58                         |                    |   |                            |                              |
| 1.619.000,00       | Upjohn Finance BV 0.816% 23-<br>06-2022   | 1.627.263,38               | 0,30                         |                    |   |                            |                              |
| 3.675.000,00       | Urenco Finance NV 2.25% 05-<br>08-2022  | 3.708.442,50               | 0,68                         |                    |   |                            |                              |
| 3.088.000,00       | Urenco Finance NV 2.375% 02-<br>12-2024   | 3.276.491,52               | 0,60                         |                    |   |                            |                              |
| 200.000,00         | Vantage Towers AG 0.000000%<br>31-03-2025   | 197.842,80                 | 0,04                         |                    |   |                            |                              |
| 2.018.000,00       | Verizon Communications Inc<br>2.875% 15-01-2038   | 2.410.125,65               | 0,44                         |                    |   |                            |                              |
| 431.000,00         | Verizon Communications Inc<br>3.25% 17-02-2026  | 485.158,60                 | 0,09                         |                    |   |                            |                              |
| 700.000,00         | Volkswagen Bank GmbH 1.875%<br>31-01-2024   | 726.068,00                 | 0,13                         |                    |   |                            |                              |
| 700.000,00         | Volkswagen Bank GmbH 2.5%<br>31-07-2026   | 764.043,00                 | 0,14                         |                    |   |                            |                              |
| 4.067.000,00       | Volkswagen Financial Service<br>0.000000% 12-02-2025  | 4.039.320,00               | 0,74                         |                    |   |                            |                              |
| 1.335.000,00       | Volkswagen Financial Service 3%<br>06-04-2025   | 1.451.716,38               | 0,27                         |                    |   |                            |                              |
| 1.400.000,00       | Volkswagen Internation 2.700%<br>MULTI Perp FC2022  | 1.426.264,00               | 0,26                         |                    |   |                            |                              |
| 10.762.000,00      | Volkswagen Leasing GmbH<br>0.000000% 19-07-2024   | 10.731.005,44              | 1,97                         |                    |   |                            |                              |
| 2.152.000,00       | Volkswagen Leasing GmbH 0.25%<br>12-01-2026   | 2.139.806,77               | 0,39                         |                    |   |                            |                              |
| 732.000,00         | Volkswagen Leasing GmbH 1%<br>16-02-2023  | 741.573,10                 | 0,14                         |                    |   |                            |                              |
| 2.198.000,00       | Volkswagen Leasing GmbH<br>1.375% 20-01-2025  | 2.273.061,70               | 0,42                         |                    |   |                            |                              |
| 1.707.000,00       | Volkswagen Leasing GmbH<br>1.625% 15-08-2025  | 1.784.890,41               | 0,33                         |                    |   |                            |                              |
| 356.000,00         | Volkswagen Leasing GmbH<br>2.625% 15-01-2024  | 374.772,59                 | 0,07                         |                    |   |                            |                              |
| 700.000,00         | Vonovia Finance BV 0.625%<br>09-07-2026   | 705.952,80                 | 0,13                         |                    |   |                            |                              |
| 1.000.000,00       | Vonovia Finance BV 1.125% 14-<br>09-2034  | 968.602,00                 | 0,18                         |                    |   |                            |                              |
| 2.300.000,00       | Vonovia SE 0.000000% 01-09-<br>2023   | 2.305.391,20               | 0,42                         |                    |   |                            |                              |
| 600.000,00         | Vonovia SE 1% 16-06-2033  | 586.849,20                 | 0,11                         |                    |   |                            |                              |
| 1.000.000,00       | Vonovia SE 1.5% 14-06-2041  | 960.568,00                 | 0,18                         |                    |   |                            |                              |
| 1.190.000,00       | Wells Fargo & Co 0.625% 14-<br>08-2030  | 1.162.570,50               | 0,21                         |                    |   |                            |                              |
| 2.046.000,00       | Wells Fargo & Co 0.625% 25-<br>03-2030  | 2.000.255,53               | 0,37                         |                    |   |                            |                              |
| 1.320.000,00       | Wells Fargo & Co 1.338% MULTI<br>04-05-2025   | 1.357.181,76               | 0,25                         |                    |   |                            |                              |
| 3.688.000,00       | Wells Fargo & Co 1.5% 24-05-2027  | 3.844.850,64               | 0,70                         |                    |   |                            |                              |
| 9.268.000,00       | Wells Fargo & Co 1.741% MULTI<br>04-05-2030   | 9.793.328,78               | 1,79                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>528.552.371,50</b>      | <b>96,83</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>528.552.371,50</b>      | <b>96,83</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>528.552.371,50</b>      | <b>96,83</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
|                    |   |                            |                              | 1.818.000,00       | Molnlycke Holding AB 1.875%<br>28-02-2025   | 1.908.190,98               | 0,35                         |
|                    |   |                            |                              |                    |   | <b>1.908.190,98</b>        | <b>0,35</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>1.908.190,98</b>        | <b>0,35</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>1.908.190,98</b>        | <b>0,35</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
|                    |   |                            |                              | 8.109.000,00       | UniCredit SpA 1.250% MULTI<br>16-06-2026  | 8.308.854,41               | 1,52                         |
|                    |   |                            |                              |                    |   | <b>8.308.854,41</b>        | <b>1,52</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>8.308.854,41</b>        | <b>1,52</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                     | <b>8.308.854,41</b>        | <b>1,52</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>538.769.416,89</b>      | <b>98,70</b>                 |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>2.237.768,67</b>        | <b>0,41</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>4.860.554,63</b>        | <b>0,89</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>545.867.740,19</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Corporate Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                     |              | Sektor               |              |
|--------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| Frankreich               | 16,77        | Unternehmensanleihen | 95,48        |
| USA                      | 16,06        | Hypothekenanleihen   | 2,88         |
| Niederlande              | 13,19        | Staatsanleihen       | 0,34         |
| Deutschland              | 9,84         |                      |              |
| Norwegen                 | 8,69         | <b>Summe</b>         | <b>98,70</b> |
| Vereinigtes Königreich   | 7,83         |                      |              |
| Italien                  | 4,41         |                      |              |
| Finnland                 | 3,57         |                      |              |
| Schweiz                  | 3,01         |                      |              |
| Spanien                  | 2,92         |                      |              |
| Dänemark                 | 2,87         |                      |              |
| Luxemburg                | 2,66         |                      |              |
| Britische Jungferninseln | 1,80         |                      |              |
| Irland                   | 1,51         |                      |              |
| Japan                    | 1,36         |                      |              |
| Schweden                 | 1,18         |                      |              |
| Estland                  | 1,03         |                      |              |
| <b>Summe</b>             | <b>98,70</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - European Corporate Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 374.961.993,97                                    | DKK                | 50.424.437,41     | EUR                  | (213,09)  | 28.01.2022  |
| 1.197.962,21                                      | EUR                | 12.146.762,91     | NOK                  | (17.391,30)   | 28.01.2022  |
| 3.649.329,91                                      | EUR                | 37.414.078,70     | SEK                  | 1.060,54  | 28.01.2022  |
| 541.974.110,46                                    | NOK                | 53.709.115,58     | EUR                  | 518.381,08  | 28.01.2022  |
| 35.057,28   | PLN                | 7.399,76          | EUR                  | 209,36  | 28.01.2022  |
| 2.043.322.609,85                                  | SEK                | 201.739.321,26    | EUR                  | (2.494.951,95)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.992.905,36)</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Credit Default Swaps

| Basiswert                                       | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal        | Wahrung | Kosten (EUR)      | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)   | Falligkeit |
|---|--------------|-----------------|----------------|----------|-------------------|--|-------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>   |              |                 |                |          |                   |  |                   |             |
| Allianz SE 5.625% MULTI 17-10-2042              | Verkauf      | 1,00%           | (5.200.000,00) | EUR      | 92.843,05         | (14.476,14)  | 78.366,91         | 20.12.2026  |
| Aviva PLC 6.125% MULTI 14-11-2036               | Kauf         | 1,00%           | 5.200.000,00   | EUR      | (63.948,77)       | 31.082,53  | (32.866,24)       | 20.12.2026  |
| Siemens Finanzierungsmaatsch 3.4% 16-03-2027    | Verkauf      | 1,00%           | (4.000.000,00) | EUR      | 152.842,29        | (3.665,09)   | 149.177,20        | 20.12.2026  |
|   |              |                 |                |          | <b>181.736,57</b> | <b>12.941,30</b>                                     | <b>194.677,87</b> |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>              |              |                 |                |          |                   |  |                   |             |
| DANSKE BANK A/S (No ref obligation)             | Verkauf      | 1,00%           | (2.000.000,00) | EUR      | 111.996,33        | (42.386,69)  | 69.609,64         | 20.12.2027  |
| GlaxoSmithKline Capital PLC 3.375% 20-12-2027   | Verkauf      | 1,00%           | (4.000.000,00) | EUR      | 150.916,49        | (1.493,05)   | 149.423,44        | 20.12.2026  |
| Iberdrola International BV 1.125% 27-01-2023    | Verkauf      | 1,00%           | (1.600.000,00) | EUR      | 41.302,50         | 1.622,62   | 42.925,12         | 20.06.2026  |
| Lloyds Banking Group PLC 1% 09-11-2023          | Kauf         | 1,00%           | 1.600.000,00   | EUR      | (44.210,88)       | 549,38   | (43.661,50)       | 20.06.2026  |
| Procter & Gamble Co/The 3.1% 15-08-2023         | Verkauf      | 1,00%           | (1.650.000,00) | USD      | 50.270,62         | 1.163,52   | 51.434,14         | 20.06.2026  |
| Siemens Finanzierungsmaatsch 3.4% 16-03-2027    | Verkauf      | 1,00%           | (1.650.000,00) | EUR      | 58.869,56         | (1.694,24)   | 57.175,32         | 20.06.2026  |
| SOCIETE GENERALE (No ref obligation)            | Verkauf      | 1,00%           | (5.550.000,00) | EUR      | 104.424,93        | 1.250,12   | 105.675,05        | 20.12.2026  |
| SOCIETE GENERALE (No ref obligation)            | Kauf         | 1,00%           | 5.550.000,00   | EUR      | 12.616,97         | 4.032,03   | 16.649,00         | 20.12.2026  |
| UBS AG (No ref obligation)                      | Verkauf      | 1,00%           | (1.600.000,00) | EUR      | 59.404,98         | (9.003,00)   | 50.401,98         | 20.06.2026  |
|   |              |                 |                |          | <b>545.591,50</b> | <b>(45.959,31)</b>                                   | <b>499.632,19</b> |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>   |              |                 |                |          |                   |  |                   |             |
| Iberdrola International BV 1.125% 27-01-2023    | Verkauf      | 1,00%           | (4.100.000,00) | EUR      | 122.082,37        | (8.692,36)   | 113.390,01        | 20.12.2026  |
|   |              |                 |                |          | <b>122.082,37</b> | <b>(8.692,36)</b>                                    | <b>113.390,01</b> |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>         |              |                 |                |          |                   |  |                   |             |
| Barclays PLC 4.375% 11-09-2024                  | Kauf         | 1,00%           | 1.750.000,00   | EUR      | 9.315,16          | (19.182,54)  | (9.867,38)        | 20.06.2026  |
| Barclays PLC 4.375% 11-09-2024                  | Kauf         | 1,00%           | 3.800.000,00   | EUR      | (7.968,83)        | 814,00   | (7.154,83)        | 20.12.2026  |
| BMW Finance NV 0.75% 12-07-2024                 | Verkauf      | 1,00%           | (4.000.000,00) | EUR      | 121.940,25        | (12.350,89)  | 109.589,36        | 20.12.2026  |
| Coooperatieve Rabobank U.A. (No ref obligation) | Verkauf      | 1,00%           | (1.750.000,00) | EUR      | 24.516,36         | (232,34)   | 24.284,02         | 20.06.2026  |
| Coooperatieve Rabobank U.A. (No ref obligation) | Verkauf      | 1,00%           | (3.800.000,00) | EUR      | 46.111,08         | 867,22   | 46.978,30         | 20.12.2026  |
| Lloyds Banking Group PLC 1% 09-11-2023          | Kauf         | 1,00%           | 3.900.000,00   | EUR      | (115.930,72)      | 4.953,49   | (110.977,23)      | 20.12.2026  |
| UBS AG (No ref obligation)                      | Verkauf      | 1,00%           | (3.900.000,00) | EUR      | 137.241,87        | (5.989,79)   | 131.252,08        | 20.12.2026  |
| Volkswagen International Fin 0.875% 16-01-2023  | Kauf         | 1,00%           | 4.000.000,00   | EUR      | (82.001,26)       | 14.022,18  | (67.979,08)       | 20.12.2026  |
|   |              |                 |                |          | <b>133.223,91</b> | <b>(17.098,67)</b>                                   | <b>116.125,24</b> |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Corporate Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert  | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal        | Wahrung | Kosten (EUR)        | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)     | Falligkeit |
|--|--------------|-----------------|----------------|----------|---------------------|---|---------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |              |                 |                |          |                     |   |                     |             |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.15% 22-01-2027      | Verkauf      | 1,00%           | (5.400.000,00) | EUR      | 124.414,29          | (7.292,34)  | 117.121,95          | 20.12.2026  |
| AT&T Inc 3.8% 15-02-2027                         | Verkauf      | 1,00%           | (5.450.000,00) | USD      | 31.241,52           | (204,40)  | 31.037,12           | 20.12.2022  |
| Carlsberg Breweries AS 2.625% 15-11-2022         | Kauf         | 1,00%           | 5.400.000,00   | EUR      | (212.030,18)        | 7.151,26  | (204.878,92)        | 20.12.2026  |
| Engie SA 1.5% 27-03-2028                         | Verkauf      | 1,00%           | (5.400.000,00) | EUR      | 172.155,20          | 7.017,72  | 179.172,92          | 20.12.2026  |
| GlaxoSmithKline Capital PLC 3.375% 20-12-2027    | Verkauf      | 1,00%           | (1.650.000,00) | EUR      | 59.336,32           | (2.008,46)  | 57.327,86           | 20.06.2026  |
|  |              |                 |                |          | <b>175.117,15</b>   | <b>4.663,78</b>                                     | <b>179.780,93</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |              |                 |                |          |                     |   |                     |             |
| BARCLAYS BANK PLC (No ref obligation)            | Verkauf      | 1,00%           | (5.200.000,00) | EUR      | 144.335,23          | (25.719,07)   | 118.616,16          | 20.12.2026  |
| Barclays PLC 1.5% 01-04-2022                     | Kauf         | 1,00%           | 5.200.000,00   | EUR      | (124.887,62)        | 14.185,65   | (110.701,97)        | 20.12.2026  |
| BMW Finance NV 0.75% 12-07-2024                  | Verkauf      | 1,00%           | (1.650.000,00) | EUR      | 49.528,40           | (5.311,11)  | 44.217,29           | 20.06.2026  |
| BNP PARIBAS (No ref obligation)                  | Verkauf      | 1,00%           | (3.800.000,00) | EUR      | 15.946,23           | 9.594,03  | 25.540,26           | 20.12.2026  |
| BNP PARIBAS (No ref obligation)                  | Kauf         | 1,00%           | 1.900.000,00   | EUR      | 51.001,28           | (3112,43)   | 47.888,85           | 20.06.2031  |
| BNP PARIBAS (No ref obligation)                  | Verkauf      | 1,00%           | (1.400.000,00) | EUR      | 5.874,93            | 3.534,64  | 9.409,57            | 20.12.2026  |
| Cooperatieve Rabobank U.A. (No ref obligation)   | Verkauf      | 1,00%           | (2.600.000,00) | EUR      | 28.164,14           | 3.978,91  | 32.143,05           | 20.12.2026  |
| CREDIT AGRICOLE SA (No ref obligation)           | Verkauf      | 1,00%           | (3.700.000,00) | EUR      | 21.370,33           | 13.428,87   | 34.799,20           | 20.12.2026  |
| CREDIT AGRICOLE SA (No ref obligation)           | Kauf         | 1,00%           | 1.850.000,00   | EUR      | 44.602,65           | (5.460,24)  | 39.142,41           | 20.06.2031  |
| CREDIT AGRICOLE SA (No ref obligation)           | Verkauf      | 1,00%           | (1.800.000,00) | EUR      | 10.396,38           | 6.532,96  | 16.929,34           | 20.12.2026  |
| CREDIT AGRICOLE SA (No ref obligation)           | Verkauf      | 1,00%           | (2.600.000,00) | EUR      | 5.369,13            | 19.084,36   | 24.453,49           | 20.12.2026  |
| EDP Finance BV 1.875% 29-09-2023                 | Verkauf      | 1,00%           | (5.300.000,00) | EUR      | 41.338,77           | (202,02)  | 41.136,75           | 20.12.2022  |
| HSBC HOLDINGS plc (No ref obligation)            | Kauf         | 1,00%           | 5.450.000,00   | EUR      | 10.695,32           | (48.390,95)   | (37.695,63)         | 20.12.2026  |
| ING Groep NV 3.000% MULTI 11-04-2028             | Kauf         | 1,00%           | 2.600.000,00   | EUR      | (21.561,06)         | (9.729,24)  | (31.290,30)         | 20.12.2026  |
| ING Groep NV 3.000% MULTI 11-04-2028             | Kauf         | 1,00%           | 2.600.000,00   | EUR      | (24.117,10)         | (7.173,20)  | (31.290,30)         | 20.12.2026  |
| JPMorgan Chase & Co 3.2% 25-01-2023              | Verkauf      | 1,00%           | (1.600.000,00) | USD      | 38.246,48           | (3.807,62)  | 34.438,86           | 20.06.2026  |
| JPMorgan Chase & Co 3.2% 25-01-2023              | Verkauf      | 1,00%           | (4.100.000,00) | USD      | 97.242,22           | (4.967,16)  | 92.275,06           | 20.12.2026  |
| Naturgy Capital Markets SA 1.125% 11-04-2024     | Verkauf      | 1,00%           | (5.350.000,00) | EUR      | 41.825,53           | (3.076,02)  | 38.749,51           | 20.12.2022  |
| Standard Chartered PLC 5.2% 26-01-2024           | Verkauf      | 1,00%           | (5.450.000,00) | EUR      | (98.128,81)         | 61.826,58   | (36.302,23)         | 20.12.2026  |
| Volkswagen International Fin 0.875% 16-01-2023   | Kauf         | 1,00%           | 1.650.000,00   | EUR      | (33.963,20)         | 3.884,18  | (30.079,02)         | 20.06.2026  |
|  |              |                 |                |          | <b>303.279,23</b>   | <b>19.101,12</b>                                    | <b>322.380,35</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |              |                 |                |          |                     |   |                     |             |
| BNP PARIBAS (No ref obligation)                  | Kauf         | 1,00%           | 700.000,00     | EUR      | 21.784,67           | (6.451,47)  | 15.333,20           | 20.12.2030  |
| CREDIT AGRICOLE SA (No ref obligation)           | Kauf         | 1,00%           | 900.000,00     | EUR      | 25.108,03           | (8.952,70)  | 16.155,33           | 20.12.2030  |
|  |              |                 |                |          | <b>46.892,70</b>    | <b>(15.404,17)</b>                                  | <b>31.488,53</b>    |             |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>     |              |                 |                |          |                     |   |                     |             |
| Procter & Gamble Co/The 3.1% 15-08-2023          | Verkauf      | 1,00%           | (3.800.000,00) | USD      | 123.766,36          | 3.802,36  | 127.568,72          | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                |          | <b>123.766,36</b>   | <b>3.802,36</b>                                     | <b>127.568,72</b>   |             |
|  |              |                 |                |          | <b>1.631.689,79</b> | <b>(46.645,95)</b>                                  | <b>1.585.043,84</b> |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Corporate Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>vom 30.12.2021 bis 31.12.2021<br>in der Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                      |                             |   |  |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (90,00)                              | (11.991.600,00)             | 0,00  | 87.893,10  |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (73,00)                              | (12.510.010,00)             | 0,00  | 223.749,75   |
| EURO-BUXL 30Y BND 3/2022               | 10.03.2022 | EUR     | 37,00                                | 7.649.380,00                | 0,00  | (393.250,44)   |
| EURO-SCHATZ FUT 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | 346,00                               | 38.766.705,00               | 4.325,00  | (54.072,68)  |
|  |            |         |                                      |                             | <b>4.325,00</b>   | <b>(135.680,27)</b>  |

BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 510.000,00 EUR gezahlt.  
 Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 360.000,00 EUR gezahlt.  
 J.P. Morgan SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 50.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 8.000.000,00  | Abanca Corp Bancaria SA 0.500% MULTI 08-09-2027 | 7.839.136,00               | 0,62                         | 460.000,00         | British Telecommunications P 0.5% 12-09-2025      | 461.522,60                 | 0,04                         |
| 2.000.000,00  | AbbVie Inc 1.25% 01-06-2024                     | 2.055.680,00               | 0,16                         | 1.915.000,00       | British Telecommunications P 1% 21-11-2024        | 1.948.478,03               | 0,15                         |
| 3.700.000,00  | AbbVie Inc 1.5% 15-11-2023                      | 3.810.193,40               | 0,30                         | 8.098.000,00       | British Telecommunications P 1.125% 10-03-2023    | 8.207.258,22               | 0,65                         |
| 3.963.000,00  | AbbVie Inc 2.125% 01-06-2029                    | 4.368.747,79               | 0,35                         | 2.187.000,00       | British Telecommunications P 1.125% 12-09-2029    | 2.210.838,30               | 0,18                         |
| 9.705.000,00  | AbbVie Inc 2.625% 15-11-2028                    | 11.017.659,48              | 0,88                         | 1.297.000,00       | British Telecommunications P 1.5% 23-06-2027      | 1.337.378,20               | 0,11                         |
| 5.900.000,00  | Abertis Infraestructuras SA 0.625% 15-07-2025   | 5.969.384,00               | 0,47                         | 6.765.000,00       | British Telecommunications P 1.75% 10-03-2026     | 7.043.650,35               | 0,56                         |
| 3.000.000,00  | Aeroporti di Roma SpA 1.625% 08-06-2027         | 3.090.210,00               | 0,25                         | 7.502.000,00       | British Telecommunications P 2.125% 26-09-2028    | 7.989.509,97               | 0,63                         |
| 5.000.000,00  | Allianz SE 1.301% MULTI 25-09-2049              | 4.978.190,00               | 0,40                         | 555.000,00         | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-05-2035 | 556.606,17                 | 0,04                         |
| 3.400.000,00  | Allianz SE 2.121% MULTI 08-07-2050              | 3.565.219,60               | 0,28                         | 1.582.000,00       | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-05-2036 | 1.578.638,57               | 0,13                         |
| 6.400.000,00  | Allianz SE 2.241% MULTI 07-07-2045              | 6.720.627,20               | 0,53                         | 2.522.000,00       | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2052 | 2.386.532,28               | 0,19                         |
| 2.700.000,00  | Allianz SE 5.625% MULTI 17-10-2042              | 2.815.003,80               | 0,22                         | 142.000,00         | Bundesrepublik Deutschland B 2.5% 15-08-2046      | 227.085,12                 | 0,02                         |
| 2.700.000,00  | APRR SA 0.000000% 20-01-2023                    | 2.708.964,00               | 0,22                         | 1.008.000,00       | Bundesrepublik Deutschland B 3.25% 04-07-2042     | 1.685.683,24               | 0,13                         |
| 11.719.000,00   | Argentum Netherlands BV 3.500% MULTI 01-10-2046 | 13.081.966,58              | 1,04                         | 11.100.000,00      | Caisse Francaise de Financem 0.01% 22-02-2028     | 11.047.630,20              | 0,88                         |
| 4.678.000,00  | ASTM SpA 1% 25-11-2026                          | 4.690.686,74               | 0,37                         | 4.200.000,00       | Caisse Francaise de Financem 0.625% 13-04-2026    | 4.318.692,00               | 0,34                         |
| 8.467.000,00  | ASTM SpA 1.5% 25-01-2030                        | 8.340.028,87               | 0,66                         | 1.300.000,00       | CaixaBank SA 2.250% MULTI 17-04-2030              | 1.349.553,40               | 0,11                         |
| 8.575.000,00  | ASTM SpA 2.375% 25-11-2033                      | 8.526.757,05               | 0,68                         | 4.100.000,00       | Cellnex Finance Co SA 2% 15-02-2033               | 3.894.631,00               | 0,31                         |
| 4.151.000,00  | AT&T Inc 1.6% 19-05-2028                        | 4.385.606,22               | 0,35                         | 10.000.000,00      | Cellnex Finance Co SA 2% 15-09-2032               | 9.606.200,00               | 0,76                         |
| 2.657.000,00  | AT&T Inc 1.8% 05-09-2026                        | 2.819.937,87               | 0,22                         | 3.100.000,00       | Cellnex Telecom SA 1.75% 23-10-2030               | 2.977.996,40               | 0,24                         |
| 2.074.000,00  | AT&T Inc 2.45% 15-03-2035                       | 2.289.372,46               | 0,18                         | 900.000,00         | Cellnex Telecom SA 2.875% 18-04-2025              | 959.302,80                 | 0,08                         |
| 5.280.000,00  | AT&T Inc 3.15% 04-09-2036                       | 6.271.034,88               | 0,50                         | 13.100.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.01% 15-07-2026     | 13.118.287,60              | 1,04                         |
| 523.000,00  | AT&T Inc 3.375% 15-03-2034                      | 637.527,59                 | 0,05                         | 9.300.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.01% 25-10-2027     | 9.275.931,60               | 0,74                         |
| 8.699.000,00  | Avinor AS 0.75% 01-10-2030                      | 8.697.416,78               | 0,69                         | 3.500.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.225% 14-09-2026    | 3.538.395,00               | 0,28                         |
| 7.936.000,00  | Avinor AS 1% 29-04-2025                         | 8.157.731,84               | 0,65                         | 2.900.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.75% 21-01-2025     | 2.980.057,40               | 0,24                         |
| 5.732.000,00  | AXA SA 3.250% MULTI 28-05-2049                  | 6.421.568,08               | 0,51                         | 6.000.000,00       | Cie Financiere et Industriel 0.375% 07-02-2025    | 6.066.936,00               | 0,48                         |
| 2.465.000,00  | AXA SA 3.375% MULTI 06-07-2047                  | 2.757.595,50               | 0,22                         | 5.846.000,00       | Cloverie PLC for Swiss 6.625% MULTI 01-09-2042    | 6.096.688,17               | 0,48                         |
| 1.300.000,00  | Banca Monte dei Paschi di Si 0.875% 08-10-2026  | 1.335.864,40               | 0,11                         | 2.670.000,00       | Cloverie PLC for Zurich Insu 1.5% 15-12-2028      | 2.846.487,00               | 0,23                         |
| 6.036.000,00  | Banca Monte dei Paschi di Si 2% 29-01-2024      | 6.297.382,94               | 0,50                         | 2.900.000,00       | Coca-Cola Europacific Partne 1.125% 12-04-2029    | 2.989.656,40               | 0,24                         |
| 500.000,00  | Banco Bilbao Vizcaya Argenta 0.625% 17-01-2022  | 500.195,00                 | 0,04                         | 700.000,00         | Coca-Cola Europacific Partne 2.75% 06-05-2026     | 769.605,20                 | 0,06                         |
| 1.900.000,00  | Banco Bilbao Vizcaya Argenta FRN 09-09-2023     | 1.927.702,00               | 0,15                         | 2.300.000,00       | Coentreprise de Transport d' 0.875% 29-09-2024    | 2.339.316,20               | 0,19                         |
| 3.109.000,00  | Bank of America Corp 0.583% MULTI 24-08-2028    | 3.101.327,21               | 0,25                         | 700.000,00         | Coentreprise de Transport d' 1.5% 29-07-2028      | 736.960,00                 | 0,06                         |
| 24.752.000,00   | Bank of America Corp 0.694% MULTI 22-03-2031    | 24.365.738,36              | 1,94                         | 2.500.000,00       | Coentreprise de Transport d' 2.125% 29-07-2032    | 2.791.285,00               | 0,22                         |
| 9.061.000,00  | Bank of America Corp 1.102% MULTI 24-05-2032    | 9.128.595,51               | 0,73                         | 2.382.000,00       | Commerzbank AG 0.1% 11-09-2025                    | 2.370.256,74               | 0,19                         |
| 10.900.000,00   | Banque Federative du Credit 0.01% 07-03-2025    | 10.871.093,20              | 0,86                         | 22.000,00          | Commerzbank AG 0.5% 04-12-2026                    | 22.190,52                  | 0,00                         |
| 10.800.000,00   | Banque Federative du Credit 0.625% 03-11-2028   | 10.769.587,20              | 0,86                         | 2.442.000,00       | Commerzbank AG 0.5% 28-08-2023                    | 2.466.590,94               | 0,20                         |
| 13.700.000,00   | Banque Federative du Credit 1.125% 19-11-2031   | 13.442.029,00              | 1,07                         | 112.000,00         | Commerzbank AG 0.625% 28-08-2024                  | 113.525,89                 | 0,01                         |
| 3.800.000,00  | Banque Federative du Credit 1.25% 26-05-2027    | 3.974.754,40               | 0,32                         | 214.000,00         | CPI Property Group SA 2.125% 04-10-2024           | 222.077,64                 | 0,02                         |
| 3.700.000,00  | Banque Federative du Credit 1.875% 18-06-2029   | 3.901.516,80               | 0,31                         | 7.600.000,00       | Credit Agricole Assurances S 1.5% 06-10-2031      | 7.472.396,00               | 0,59                         |
| 12.511.000,00   | BMW Finance NV 0.000000% 24-03-2023             | 12.556.039,60              | 1,00                         | 6.900.000,00       | Credit Agricole Assurances S 2% 17-07-2030        | 7.123.353,00               | 0,57                         |
| 3.370.000,00  | BMW Finance NV 0.25% 14-01-2022                 | 3.370.674,00               | 0,27                         |                    |   |                            |                              |
| 1.700.000,00  | BMW Finance NV 0.375% 10-07-2023                | 1.716.133,00               | 0,14                         |                    |   |                            |                              |
| 5.986.000,00  | Booking Holdings Inc 0.1% 08-03-2025            | 5.986.682,40               | 0,48                         |                    |   |                            |                              |
| 1.900.000,00  | BPCE SA 0.25% 14-01-2031                        | 1.816.400,00               | 0,14                         |                    |   |                            |                              |
| 4.000.000,00  | BPCE SA 0.625% 15-01-2030                       | 3.994.616,00               | 0,32                         |                    |   |                            |                              |
| 2.300.000,00  | BPCE SA 1.125% 18-01-2023                       | 2.334.536,80               | 0,19                         |                    |   |                            |                              |
| 600.000,00  | BPCE SA 2.875% 16-01-2024                       | 638.378,40                 | 0,05                         |                    |   |                            |                              |
| 1.800.000,00  | BPCE SFH SA 0.5% 11-10-2022                     | 1.814.216,40               | 0,14                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapiieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 3.000.000,00       | Credit Agricole Home Loan SF 0.01% 12-04-2028     | 2.986.056,00               | 0,24                         | 8.733.000,00       | H Lundbeck A/S 0.875% 14-10-2027                  | 8.800.558,49               | 0,70                         |
| 1.000.000,00       | Credit Agricole SA 2.625% 17-03-2027              | 1.092.800,00               | 0,09                         | 2.900.000,00       | Hannover Rueck SE 1.750% MULTI 08-10-2040         | 2.960.260,55               | 0,24                         |
| 2.889.000,00       | Daimler AG 0.000000% 08-02-2024                   | 2.896.950,53               | 0,23                         | 7.100.000,00       | Holding d'Infrastructures de 0.625% 14-09-2028    | 6.930.352,60               | 0,55                         |
| 5.076.000,00       | Daimler AG 1.625% 22-08-2023                      | 5.230.614,96               | 0,42                         | 10.200.000,00      | Holding d'Infrastructures de 0.625% 27-03-2023    | 10.270.216,80              | 0,82                         |
| 220.000,00         | Daimler AG 1.875% 08-07-2024                      | 231.020,68                 | 0,02                         | 10.900.000,00      | Holding d'Infrastructures de 1.625% 18-09-2029    | 11.355.532,80              | 0,90                         |
| 4.041.000,00       | Daimler International Financ 0.625% 27-02-2023    | 4.086.137,97               | 0,32                         | 2.600.000,00       | Holding d'Infrastructures de 1.625% 27-11-2027    | 2.717.057,20               | 0,22                         |
| 5.854.000,00       | Daimler International Financ 2.625% 07-04-2025    | 6.356.718,10               | 0,50                         | 1.300.000,00       | Holding d'Infrastructures de 2.25% 24-03-2025     | 1.381.952,00               | 0,11                         |
| 5.396.000,00       | Danske Bank A/S 0.625% 26-05-2025                 | 5.466.094,04               | 0,43                         | 5.500.000,00       | Holding d'Infrastructures de 2.5% 04-05-2027      | 5.999.818,00               | 0,48                         |
| 1.804.000,00       | Danske Bank A/S 1.500% MULTI 02-09-2030           | 1.832.449,08               | 0,15                         | 157.000,00         | Intesa Sanpaolo SpA 1.125% 04-03-2022             | 157.400,04                 | 0,01                         |
| 5.174.000,00       | Danske Mortgage Bank PLC 0.375% 21-11-2023        | 5.243.900,74               | 0,42                         | 4.071.000,00       | Intesa Sanpaolo SpA 2.125% 26-05-2025             | 4.308.974,38               | 0,34                         |
| 10.700.000,00      | de Volksbank NV 0.375% 03-03-2028                 | 10.503.590,80              | 0,83                         | 8.540.000,00       | JPMorgan Chase & Co 0.597% MULTI 17-02-2033       | 8.227.350,60               | 0,65                         |
| 11.900.000,00      | de Volksbank NV 1.750% MULTI 22-10-2030           | 12.323.544,80              | 0,98                         | 1.457.000,00       | JPMorgan Chase & Co 1.001% MULTI 25-07-2031       | 1.475.894,38               | 0,12                         |
| 4.300.000,00       | Deutsche Bahn Finance 0.950% MULTI Perp FC2025    | 4.278.500,00               | 0,34                         | 8.340.000,00       | JPMorgan Chase & Co 1.638% MULTI 18-05-2028       | 8.825.371,32               | 0,70                         |
| 3.301.000,00       | Deutsche Bahn Finance GMBH 0.625% 15-04-2036      | 3.165.672,20               | 0,25                         | 336.000,00         | Kraft Heinz Foods Co 1.5% 24-05-2024              | 344.767,58                 | 0,03                         |
| 5.000.000,00       | Deutsche Telekom Internation 0.625% 03-04-2023    | 5.054.780,00               | 0,40                         | 2.965.000,00       | Kraft Heinz Foods Co 2.25% 25-05-2028             | 3.175.277,80               | 0,25                         |
| 4.000.000,00       | DH Europe Finance II Sarl 0.2% 18-03-2026         | 3.994.024,00               | 0,32                         | 6.311.000,00       | LeasePlan Corp NV 0.125% 13-09-2023               | 6.327.181,40               | 0,50                         |
| 9.703.000,00       | DNB Boligkreditt AS 0.01% 08-10-2027              | 9.667.836,33               | 0,77                         | 8.705.000,00       | LeasePlan Corp NV 0.25% 07-09-2026                | 8.587.430,27               | 0,68                         |
| 10.005.000,00      | DNB Boligkreditt AS 0.01% 12-05-2028              | 9.941.968,50               | 0,79                         | 11.049.000,00      | LeasePlan Corp NV 0.25% 23-02-2026                | 10.963.458,64              | 0,87                         |
| 1.176.000,00       | DNB Boligkreditt AS 0.25% 07-09-2026              | 1.189.723,92               | 0,09                         | 2.100.000,00       | LeasePlan Corp NV 1.375% 07-03-2024               | 2.162.949,60               | 0,17                         |
| 1.789.000,00       | DNB Boligkreditt AS 0.375% 20-11-2024             | 1.817.613,27               | 0,14                         | 4.762.000,00       | LeasePlan Corp NV 3.5% 09-04-2025                 | 5.263.524,32               | 0,42                         |
| 3.073.000,00       | DXC Capital Funding DAC 0.45% 15-09-2027          | 2.977.435,85               | 0,24                         | 1.600.000,00       | London Stock Exchange Group 0.875% 19-09-2024     | 1.639.971,20               | 0,13                         |
| 2.818.000,00       | DXC Technology Co 1.75% 15-01-2026                | 2.921.939,11               | 0,23                         | 4.888.000,00       | Lseg Netherlands BV 0.000000% 06-04-2025          | 4.874.362,48               | 0,39                         |
| 6.405.000,00       | DZ HYP AG 0.01% 26-10-2026                        | 6.420.320,76               | 0,51                         | 2.800.000,00       | Medtronic Global Holdings SC 0.000000% 15-10-2025 | 2.788.788,80               | 0,22                         |
| 94.000,00          | E.ON International Finance B 3% 17-01-2024        | 99.987,80                  | 0,01                         | 1.000.000,00       | Mercedes-Benz Finance Co Ltd 0.000000% 21-08-2022 | 1.001.948,45               | 0,08                         |
| 176.000,00         | E.ON SE 1% 07-10-2025                             | 181.578,85                 | 0,01                         | 4.000.000,00       | Molnlycke Holding AB 0.875% 05-09-2029            | 3.996.760,00               | 0,32                         |
| 3.290.000,00       | Eika Boligkreditt AS 2.125% 30-01-2023            | 3.383.107,00               | 0,27                         | 2.573.000,00       | Molnlycke Holding AB 1.75% 28-02-2024             | 2.664.573,07               | 0,21                         |
| 8.400.000,00       | Electricite de France 2.625% MULTI Perp FC2027    | 8.421.000,00               | 0,67                         | 11.374.000,00      | Moody's Corp 0.95% 25-02-2030                     | 11.591.357,14              | 0,92                         |
| 2.000.000,00       | Electricite de France 4.000% MULTI Perp FC2024    | 2.115.180,00               | 0,17                         | 3.722.000,00       | Moody's Corp 1.75% 09-03-2027                     | 3.975.058,78               | 0,32                         |
| 200.000,00         | Electricite de France SA 3.875% 18-01-2022        | 200.332,00                 | 0,02                         | 5.871.000,00       | Motability Operations Group 0.875% 14-03-2025     | 6.016.013,70               | 0,48                         |
| 6.540.000,00       | Elering AS 0.875% 03-05-2023                      | 6.599.857,35               | 0,52                         | 2.240.000,00       | Motability Operations Group 1.625% 09-06-2023     | 2.299.928,96               | 0,18                         |
| 3.694.000,00       | Enel Finance International N 0.000000% 28-05-2026 | 3.642.653,40               | 0,29                         | 14.718.000,00      | MPT Operating Partnership LP 0.993% 15-10-2026    | 14.603.788,32              | 1,16                         |
| 1.300.000,00       | Essity AB 2.5% 09-06-2023                         | 1.348.984,00               | 0,11                         | 1.000.000,00       | Muenchener Rueckversich 3.250% MULTI 26-05-2049   | 1.130.192,00               | 0,09                         |
| 4.000.000,00       | Eurogrid GmbH 1.5% 18-04-2028                     | 4.249.160,00               | 0,34                         | 1.600.000,00       | Muenchener Rueckversich 6.250% MULTI 26-05-2042   | 1.637.712,00               | 0,13                         |
| 1.100.000,00       | Eurogrid GmbH 1.875% 10-06-2025                   | 1.159.994,00               | 0,09                         | 13.793.000,00      | Nasdaq Inc 0.875% 13-02-2030                      | 13.806.599,90              | 1,10                         |
| 4.300.000,00       | Eutelsat SA 1.5% 13-10-2028                       | 4.340.136,20               | 0,34                         | 7.874.000,00       | Nasdaq Inc 0.9% 30-07-2033                        | 7.663.527,98               | 0,61                         |
| 2.000.000,00       | Eutelsat SA 2.25% 13-07-2027                      | 2.077.344,00               | 0,17                         | 1.020.000,00       | National Grid Electricity Tr 0.872% 26-11-2040    | 957.951,36                 | 0,08                         |
| 12.365.000,00      | Fiat Chrysler Finance Europe 4.75% 15-07-2022     | 12.690.644,64              | 1,01                         | 6.073.000,00       | National Grid PLC 0.163% 20-01-2028               | 5.925.729,75               | 0,47                         |
| 2.936.000,00       | Fidelity National Informatio 0.75% 21-05-2023     | 2.967.579,62               | 0,24                         | 7.594.000,00       | National Grid PLC 0.553% 18-09-2029               | 7.530.073,71               | 0,60                         |
| 3.336.000,00       | Fresenius Finance Ireland PL 0.000000% 01-10-2025 | 3.295.601,04               | 0,26                         | 5.225.000,00       | National Grid PLC 0.75% 01-09-2033                | 5.079.285,20               | 0,40                         |
| 12.092.000,00      | Global Switch Finance BV 1.375% 07-10-2030        | 11.984.526,30              | 0,95                         | 5.358.000,00       | Nationwide Building Society 0.25% 14-09-2028      | 5.256.358,74               | 0,42                         |
| 1.150.000,00       | Global Switch Holdings Ltd 1.5% 31-01-2024        | 1.165.906,80               | 0,09                         |                    |   |                            |                              |
| 18.990.000,00      | Global Switch Holdings Ltd 2.25% 31-05-2027       | 19.542.001,32              | 1,55                         |                    |   |                            |                              |
| 4.000.000,00       | Goldman Sachs Group Inc/The FRN 26-09-2023        | 4.009.920,00               | 0,32                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 2.410.000,00       | Nationwide Building Society 0.625% 19-04-2023     | 2.440.534,70               | 0,19                         | 3.856.000,00       | Thermo Fisher Scientific Inc 0.5% 01-03-2028  | 3.864.768,54               | 0,31                         |
| 16.028.000,00      | Natwest Group PLC 0.670% MULTI 14-09-2029         | 15.733.341,25              | 1,25                         | 4.336.000,00       | Thermo Fisher Scientific Inc 1.375% 12-09-2028  | 4.569.259,46               | 0,36                         |
| 6.918.000,00       | Natwest Group PLC 1.043% MULTI 14-09-2032         | 6.812.140,76               | 0,54                         | 760.000,00         | Thermo Fisher Scientific Inc 1.4% 23-01-2026  | 794.744,16                 | 0,06                         |
| 4.495.000,00       | NGG Finance PLC 2.125% MULTI 05-09-2082           | 4.539.950,00               | 0,36                         | 217.000,00         | Thermo Fisher Scientific Inc 1.45% 16-03-2027   | 229.187,59                 | 0,02                         |
| 6.985.000,00       | Nykredit Realkredit 0.75% 01-20-2027              | 7.064.947,52               | 0,56                         | 2.000.000,00       | Thermo Fisher Scientific Inc 2% 15-04-2025  | 2.113.984,00               | 0,17                         |
| 4.700.000,00       | Nykredit Realkredit FRN 07-28-2031                | 4.678.662,00               | 0,37                         | 10.600.000,00      | Traton Finance Luxembourg SA 0.125% 24-03-2025  | 10.534.513,20              | 0,84                         |
| 2.000.000,00       | Orange SA 1.125% 15-07-2024                       | 2.055.152,00               | 0,16                         | 1.439.000,00       | UBS AG/London 0.01% 31-03-2026  | 1.425.968,42               | 0,11                         |
| 6.000.000,00       | PPF Telecom Group BV 2.125% 31-01-2025            | 6.129.000,00               | 0,49                         | 8.244.000,00       | UBS AG/London 0.5% 31-03-2031   | 8.107.083,65               | 0,64                         |
| 4.817.000,00       | PPF Telecom Group BV 3.125% 27-03-2026            | 5.109.632,75               | 0,41                         | 12.169.000,00      | UBS AG/London 0.625% 23-01-2023   | 12.277.109,40              | 0,98                         |
| 117.000,00         | PVH Corp 3.125% 15-12-2027                        | 130.030,99                 | 0,01                         | 4.332.000,00       | UBS AG/London 0.75% 21-04-2023  | 4.383.169,58               | 0,35                         |
| 2.014.000,00       | RCI Banque SA 0.25% 08-03-2023                    | 2.018.773,18               | 0,16                         | 6.570.000,00       | UBS Group AG 0.875% 03-11-2031  | 6.534.561,42               | 0,52                         |
| 5.751.000,00       | RCI Banque SA 1.625% 11-04-2025                   | 5.940.921,02               | 0,47                         | 7.400.000,00       | Unicaja Banco SA 1.000% MULTI 01-12-2026  | 7.366.478,00               | 0,59                         |
| 3.900.000,00       | RCI Banque SA FRN 12-03-2025                      | 3.897.028,20               | 0,31                         | 1.977.000,00       | UniCredit SpA 0.325% 19-01-2026   | 1.960.266,67               | 0,16                         |
| 3.833.000,00       | RELX Finance BV 0.000000% 18-03-2024              | 3.838.902,82               | 0,30                         | 4.871.000,00       | UniCredit SpA 0.5% 09-04-2025   | 4.895.520,61               | 0,39                         |
| 2.500.000,00       | Renault SA 1% 18-04-2024                          | 2.493.750,00               | 0,20                         | 2.849.000,00       | Upjohn Finance BV 1.023% 23-06-2024   | 2.908.829,00               | 0,23                         |
| 5.134.000,00       | Renault SA 1% 28-11-2025                          | 5.069.825,00               | 0,40                         | 8.315.000,00       | Upjohn Finance BV 1.362% 23-06-2027   | 8.568.640,76               | 0,68                         |
| 1.300.000,00       | Renault SA 1.25% 24-06-2025                       | 1.276.061,80               | 0,10                         | 1.468.000,00       | Ureco Finance NV 2.25% 05-08-2022   | 1.481.358,80               | 0,12                         |
| 100.000,00         | RTE Reseau de Transport d'El 0.000000% 09-09-2027 | 98.105,00                  | 0,01                         | 8.395.000,00       | Ureco Finance NV 2.375% 02-12-2024  | 8.907.430,80               | 0,71                         |
| 4.500.000,00       | RTE Reseau de Transport d'El 0.625% 08-07-2032    | 4.436.910,00               | 0,35                         | 10.100.000,00      | Vantage Towers AG 0.000000% 31-03-2025  | 9.991.061,40               | 0,79                         |
| 10.400.000,00      | RTE Reseau de Transport d'El 1.125% 08-07-2040    | 10.439.520,00              | 0,83                         | 3.000.000,00       | Vantage Towers AG 0.375% 31-03-2027   | 2.957.880,00               | 0,23                         |
| 100.000,00         | RTE Reseau de Transport d'El 1.125% 09-09-2049    | 96.150,00                  | 0,01                         | 1.043.000,00       | Verizon Communications Inc 0.875% 08-04-2027  | 1.069.915,66               | 0,08                         |
| 5.000.000,00       | RTE Reseau de Transport d'El 1.625% 27-11-2025    | 5.275.040,00               | 0,42                         | 1.524.000,00       | Verizon Communications Inc 1.3% 18-05-2033  | 1.558.271,71               | 0,12                         |
| 100.000,00         | RTE Reseau de Transport d'El 1.875% 23-10-2037    | 112.282,40                 | 0,01                         | 6.681.000,00       | Verizon Communications Inc 2.875% 15-01-2038  | 7.979.211,83               | 0,63                         |
| 2.800.000,00       | RTE Reseau de Transport d'El 2% 18-04-2036        | 3.174.925,60               | 0,25                         | 2.000.000,00       | Vodafone Group PLC 1.875% 11-09-2025  | 2.123.080,00               | 0,17                         |
| 6.792.000,00       | Scania CV AB 0.000000% 23-11-2022                 | 6.799.335,36               | 0,54                         | 1.600.000,00       | Vonovia Finance BV 0.625% 07-10-2027  | 1.598.448,00               | 0,13                         |
| 2.300.000,00       | Schneider Electric SE 1.5% 08-09-2023             | 2.360.191,00               | 0,19                         | 4.500.000,00       | Vonovia Finance BV 0.625% 09-07-2026  | 4.538.268,00               | 0,36                         |
| 2.600.000,00       | SCOR SE 3.625% MULTI 27-05-2048                   | 3.006.354,00               | 0,24                         | 500.000,00         | Vonovia Finance BV 0.75% 15-01-2024   | 507.477,00                 | 0,04                         |
| 6.433.000,00       | SES SA 2% 02-07-2028                              | 6.766.769,77               | 0,54                         | 3.700.000,00       | Vonovia Finance BV 1.5% 14-01-2028  | 3.883.039,00               | 0,31                         |
| 8.500.000,00       | Siemens Finanzierungsmaatsch 0.125% 05-06-2022    | 8.520.689,00               | 0,68                         | 3.500.000,00       | Vonovia Finance BV 1.625% 07-10-2039  | 3.446.926,00               | 0,27                         |
| 100.000,00         | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.01% 22-09-2027       | 99.716,40                  | 0,01                         | 6.000.000,00       | Vonovia Finance BV 2.25% 07-04-2030   | 6.643.572,00               | 0,53                         |
| 6.958.000,00       | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.125% 14-05-2026      | 7.006.511,18               | 0,56                         | 1.600.000,00       | Vonovia SE 0.000000% 01-12-2025   | 1.581.008,00               | 0,13                         |
| 5.584.000,00       | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.25% 30-08-2026       | 5.650.617,12               | 0,45                         | 100.000,00         | Vonovia SE 1% 16-06-2033  | 97.808,20                  | 0,01                         |
| 6.281.000,00       | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.375% 19-06-2023      | 6.353.017,95               | 0,50                         | 1.844.000,00       | Wells Fargo & Co 0.625% 14-08-2030  | 1.801.495,80               | 0,14                         |
| 2.541.000,00       | Sparebanken Vest Boligkredit 0.375% 14-02-2024    | 2.577.397,28               | 0,20                         | 7.960.000,00       | Wells Fargo & Co 0.625% 25-03-2030  | 7.782.030,32               | 0,62                         |
| 5.718.000,00       | Statkraft AS 1.125% 20-03-2025                    | 5.891.953,00               | 0,47                         | 1.599.000,00       | Wells Fargo & Co 1.338% MULTI 04-05-2025  | 1.644.040,63               | 0,13                         |
| 6.528.000,00       | Statkraft AS 1.5% 21-09-2023                      | 6.684.149,76               | 0,53                         | 7.689.000,00       | Wells Fargo & Co 1.5% 24-05-2027  | 8.016.013,17               | 0,64                         |
| 2.083.000,00       | Statkraft AS 1.5% 26-03-2030                      | 2.238.062,69               | 0,18                         | 19.831.000,00      | Wells Fargo & Co 1.741% MULTI 04-05-2030  | 20.955.060,74              | 1,66                         |
| 1.126.000,00       | Statkraft AS 2.5% 28-11-2022                      | 1.154.420,24               | 0,09                         |                    |   |                            |                              |
| 7.500.000,00       | Stellantis NV 2% 20-03-2025                       | 7.876.500,00               | 0,63                         |                    |   |                            |                              |
| 8.069.000,00       | Stellantis NV 3.875% 05-01-2026                   | 9.090.454,71               | 0,72                         |                    |   |                            |                              |
| 3.400.000,00       | Swiss Re Finance UK PLC 2.714% MULTI 04-06-2052   | 3.633.267,20               | 0,29                         |                    |   |                            |                              |
| 3.925.000,00       | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1% 09-07-2029        | 4.016.036,45               | 0,32                         |                    |   |                            |                              |
| 11.972.000,00      | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1.375% 09-07-2032    | 12.412.018,89              | 0,99                         |                    |   |                            |                              |
| 3.319.000,00       | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3% 21-11-2030        | 3.931.554,64               | 0,31                         |                    |   |                            |                              |
| 2.100.000,00       | Talanx Finanz Luxembour 8.367% MULTI 15-06-2042   | 2.176.566,00               | 0,17                         |                    |   |                            |                              |
| 2.223.000,00       | Telenor ASA 0.000000% 25-09-2023                  | 2.229.780,15               | 0,18                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    |   | <b>1.213.251.819,07</b>    | <b>96,37</b>                 |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>1.213.251.819,07</b>    | <b>96,37</b>                 |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>1.213.251.819,07</b>    | <b>96,37</b>                 |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 9.403.000,00       | Molnlycke Holding AB 1.875%<br>28-02-2025   | 9.869.482,83               | 0,78                         |
|                    |   | <b>9.869.482,83</b>        | <b>0,78</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>9.869.482,83</b>        | <b>0,78</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b> | <b>9.869.482,83</b>        | <b>0,78</b>                  |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 13.746.000,00      | UniCredit SpA 1.250% MULTI<br>16-06-2026  | 14.084.783,92              | 1,12                         |
|                    |   | <b>14.084.783,92</b>       | <b>1,12</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>14.084.783,92</b>       | <b>1,12</b>                  |
|                    | <b>Summe sonstige übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>14.084.783,92</b>       | <b>1,12</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>1.237.206.085,82</b>    | <b>98,28</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>7.183.470,97</b>        | <b>0,57</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>14.520.432,34</b>       | <b>1,15</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>1.258.909.989,13</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                     |              | Sektor               |              |
|--------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| Frankreich               | 19,69        | Unternehmensanleihen | 94,64        |
| USA                      | 17,98        | Hypothekenanleihen   | 2,78         |
| Niederlande              | 16,36        | Staatsanleihen       | 0,85         |
| Vereinigtes Königreich   | 8,18         |                      |              |
| Norwegen                 | 6,57         | <b>Summe</b>         | <b>98,28</b> |
| Deutschland              | 6,17         |                      |              |
| Italien                  | 4,58         |                      |              |
| Spanien                  | 3,37         |                      |              |
| Luxemburg                | 3,11         |                      |              |
| Schweiz                  | 2,60         |                      |              |
| Dänemark                 | 2,21         |                      |              |
| Schweden                 | 1,96         |                      |              |
| Japan                    | 1,70         |                      |              |
| Britische Jungferninseln | 1,64         |                      |              |
| Irland                   | 1,21         |                      |              |
| Estland                  | 0,52         |                      |              |
| Finnland                 | 0,42         |                      |              |
| <b>Summe</b>             | <b>98,28</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|---|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |   |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |   |            |
| 3.252.889,45                                      | EUR               | 32.948.451,69      | NOK                | (43.791,02)   | 28.01.2022 |
| 1.106.025,41                                      | EUR               | 11.316.707,49      | SEK                | 2.527,60  | 28.01.2022 |
| 3.095.091.888,78                                  | NOK               | 306.805.103,42     | EUR                | 2.875.854,56  | 28.01.2022 |
| 760.642.822,37                                    | SEK               | 75.046.555,64      | EUR                | (876.253,94)  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>1.958.337,20</b>   |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - European Covered Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>CHF</b>  |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 14.530.000,00   | Kommunalkredit Austria AG 2.5% 14-02-2022       | 14.114.780,44              | 0,25                         | 27.600.000,00      | BPCE SFH SA 0.01% 08-11-2026                   | 27.615.400,80              | 0,48                         |
| 22.015.000,00   | Kommunalkredit Austria AG 3.375% 22-06-2026     | 24.614.502,19              | 0,43                         | 11.800.000,00      | BPCE SFH SA 0.01% 10-11-2027                   | 11.760.470,00              | 0,21                         |
| 40.000.000,00   | Valiant Bank AG 0.000000% 20-01-2026            | 38.977.099,74              | 0,68                         | 16.500.000,00      | BPCE SFH SA 0.01% 16-10-2028                   | 16.374.798,00              | 0,29                         |
|   |   | <b>77.706.382,37</b>       | <b>1,36</b>                  | 63.400.000,00      | BPCE SFH SA 0.01% 18-03-2031                   | 61.866.227,20              | 1,08                         |
| <b>DKK</b>  |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 350.000.000,00  | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2025 SDO A E      | 48.778.571,58              | 0,85                         | 18.000.000,00      | BPCE SFH SA 0.01% 27-05-2030                   | 17.696.484,00              | 0,31                         |
| 460.000.000,00  | Nordea Kredit 1% 04-01-2026 IO A                | 64.369.212,61              | 1,13                         | 21.000.000,00      | BPCE SFH SA 0.01% 29-01-2029                   | 20.809.908,00              | 0,36                         |
| 480.000.000,00  | Nordea Kredit 1% 10-01-2025 IO SDRO A 2         | 67.052.294,62              | 1,17                         | 28.700.000,00      | BPCE SFH SA 0.625% 22-09-2027                  | 29.638.719,60              | 0,52                         |
| 550.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 01-01-2024 SDO A H       | 75.955.387,25              | 1,33                         | 21.000.000,00      | BPCE SFH SA 0.625% 29-05-2031                  | 21.657.888,00              | 0,38                         |
| 1.320.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2025 SDO A H       | 184.135.067,99             | 3,23                         | 43.500.000,00      | BPCE SFH SA 0.75% 27-11-2026                   | 45.087.228,00              | 0,79                         |
| 440.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2026 SDO A H       | 61.591.420,17              | 1,08                         | 2.500.000,00       | BPCE SFH SA 2.036% 17-04-2023                  | 2.578.474,15               | 0,05                         |
| 800.000.000,00  | Nykredit Realkredit 2% 01-01-2025 SDO A H       | 114.526.309,43             | 2,01                         | 56.000.000,00      | BPER Banca 1.125% 22-04-2026                   | 58.508.352,00              | 1,03                         |
| 750.000.000,00  | Nykredit Realkredit 2% 01-01-2026 SDO A H       | 108.855.998,54             | 1,91                         | 13.100.000,00      | Caisse de Refinancement de l 0.01% 07-02-2028  | 13.043.827,20              | 0,23                         |
| 334.771.077,18  | Nykredit Realkredit FRN 01-01-2024 IO CITA-6M A | 45.341.730,76              | 0,79                         | 22.300.000,00      | Caisse de Refinancement de l 0.01% 08-10-2029  | 22.015.362,80              | 0,39                         |
| 350.000.000,00  | Realkredit Danmark 1% 04-01-2025 SDRO A T       | 48.770.748,20              | 0,85                         | 14.800.000,00      | Caisse de Refinancement de l 0.125% 30-04-2027 | 14.872.727,20              | 0,26                         |
|   |   | <b>819.376.741,15</b>      | <b>14,36</b>                 | 25.500.000,00      | Caisse Francaise de Financem 0.01% 22-02-2028  | 25.379.691,00              | 0,44                         |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 10.500.000,00   | Achmea Bank NV 0.01% 16-06-2025                 | 10.525.326,00              | 0,18                         | 17.100.000,00      | Caisse Francaise de Financem 0.01% 27-04-2029  | 16.941.722,40              | 0,30                         |
| 10.000.000,00   | Aegon Bank NV 0.01% 16-11-2025                  | 10.006.880,00              | 0,18                         | 59.600.000,00      | Caixa Economica Montepio Ger 0.125% 14-11-2024 | 59.875.352,00              | 1,05                         |
| 16.500.000,00   | Alpha Bank Romania SA FRN 16-05-2024            | 16.582.500,00              | 0,29                         | 54.000.000,00      | Caja Rural de Navarra SCC 0.875% 08-05-2025    | 55.505.304,00              | 0,97                         |
| 70.897.000,00   | Alpha Bank SA 2.5% 05-02-2023                   | 72.625.752,45              | 1,27                         | 80.500.000,00      | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 07-10-2026  | 80.682.222,22              | 1,41                         |
| 31.000.000,00   | AMCO - Asset Management Co S 0.75% 20-04-2028   | 30.078.667,91              | 0,53                         | 32.700.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.01% 10-11-2027  | 32.592.220,80              | 0,57                         |
| 35.000.000,00   | AMCO - Asset Management Co S 2.25% 17-07-2027   | 37.143.060,50              | 0,65                         | 76.000.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.01% 16-04-2029  | 75.213.704,00              | 1,32                         |
| 16.500.000,00   | Andorra Capital Agricol Reig FRN 25-07-2022     | 16.551.695,16              | 0,29                         | 55.700.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.01% 25-09-2030  | 54.589.564,80              | 0,96                         |
| 14.500.000,00   | Argenta Spaarbank NV 0.01% 11-02-2031           | 14.181.203,00              | 0,25                         | 53.800.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.225% 14-09-2026 | 54.390.186,00              | 0,95                         |
| 15.000.000,00   | Arkea Home Loans SFH SA 0.01% 04-10-2030        | 14.685.120,00              | 0,26                         | 33.700.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.375% 09-04-2027 | 34.314.014,00              | 0,60                         |
| 46.757.000,00   | Autonomous Community of Cata 4.22% 26-04-2035   | 60.719.762,37              | 1,06                         | 31.300.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.75% 29-05-2026  | 32.376.720,00              | 0,57                         |
| 3.000.000,00  | AXA Bank Europe SCF 0.01% 22-01-2027            | 2.995.164,00               | 0,05                         | 13.500.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.875% 11-09-2028 | 14.188.176,00              | 0,25                         |
| 10.000.000,00   | AXA Home Loan SFH SA 0.01% 16-10-2029           | 9.855.280,00               | 0,17                         | 1.800.000,00       | Cie de Financement Foncier S 2.124% 06-05-2023 | 1.861.443,45               | 0,03                         |
| 27.000.000,00   | AXA Home Loan SFH SA 0.05% 05-07-2027           | 26.984.826,00              | 0,47                         | 40.500.000,00      | Clydesdale Bank PLC 0.01% 22-09-2026           | 40.289.805,00              | 0,71                         |
| 30.000.000,00   | Banca Carige SpA 0.625% 28-10-2028              | 29.951.160,00              | 0,52                         | 9.000.000,00       | Commerzbank AG 0.01% 11-03-2030                | 8.873.640,00               | 0,16                         |
| 59.000.000,00   | Banca Carige SpA FRN 25-05-2022                 | 59.100.890,00              | 1,04                         | 85.000.000,00      | Cooperatieve Rabobank UA 0.01% 02-07-2030      | 84.372.884,45              | 1,48                         |
| 20.000.000,00   | Banca Carige SpA FRN 25-05-2023                 | 20.120.000,00              | 0,35                         | 15.700.000,00      | Coventry Building Society 0.01% 07-07-2028     | 15.488.458,20              | 0,27                         |
| 122.985.000,00  | Banca Monte dei Paschi di Si 0.875% 08-10-2026  | 126.377.910,18             | 2,21                         | 15.000.000,00      | Credit Agricole Home Loan SF 0.01% 03-11-2031  | 14.565.270,00              | 0,26                         |
| 70.379.000,00   | Banca Monte dei Paschi di Si 2% 29-01-2024      | 73.426.692,22              | 1,29                         | 9.500.000,00       | Credit Agricole Home Loan SF 0.5% 19-02-2026   | 9.715.365,00               | 0,17                         |
| 38.389.000,00   | Banca Monte dei Paschi di Si 2.125% 26-11-2025  | 41.247.061,05              | 0,72                         | 11.100.000,00      | Credit Agricole Home Loan SF 1% 16-01-2029     | 11.778.520,80              | 0,21                         |
| 57.700.000,00   | Banca Monte dei Paschi di Si 2.875% 16-07-2024  | 61.886.019,60              | 1,08                         | 10.000.000,00      | Credit Agricole Italia SpA 0.25% 17-01-2028    | 10.080.760,00              | 0,18                         |
| 8.000.000,00  | Banca Popolare dell'Alto Adi 0.25% 28-10-2026   | 8.018.768,00               | 0,14                         | 12.500.000,00      | Credit Agricole Public Secto 0.125% 08-12-2031 | 12.273.425,00              | 0,22                         |
| 61.960.000,00   | Banco di Desio e della Brian 0.375% 24-07-2026  | 62.791.998,88              | 1,10                         | 13.000.000,00      | Credit Agricole Public Secto 0.625% 29-03-2029 | 13.435.526,00              | 0,24                         |
| 14.500.000,00   | Banco Santander SA 1% 07-04-2025                | 15.015.040,00              | 0,26                         | 20.000.000,00      | Credit Mutuel Home Loan SFH 0.01% 06-05-2031   | 19.490.200,00              | 0,34                         |
| 20.000.000,00   | Bank Gospodarstwa Krajowego 0.5% 08-07-2031     | 19.220.200,00              | 0,34                         | 15.500.000,00      | Credit Mutuel Home Loan SFH 0.125% 28-01-2030  | 15.411.092,00              | 0,27                         |
| 30.500.000,00   | Bank of Nova Scotia/The 0.01% 15-12-2027        | 30.298.273,00              | 0,53                         | 24.000.000,00      | Credit Mutuel Home Loan SFH 1% 30-04-2028      | 25.371.024,00              | 0,44                         |
|   |   |                            |                              | 31.000.000,00      | Danmarks Skibskredit 0.125% 03-20-2025         | 30.975.820,00              | 0,54                         |
|   |   |                            |                              | 24.600.000,00      | Danmarks Skibskredit 0.25% 06-21-2028 A        | 24.336.780,00              | 0,43                         |
|   |   |                            |                              | 31.000.000,00      | Deutsche Bank AG 0.05% 20-11-2024              | 31.034.410,00              | 0,54                         |
|   |   |                            |                              | 20.000.000,00      | Deutsche Bank AG 0.125% 21-01-2030             | 19.880.800,00              | 0,35                         |
|   |   |                            |                              | 18.000.000,00      | Deutsche Bank SA Espanola 0.875% 16-01-2025    | 18.486.000,00              | 0,32                         |
|   |   |                            |                              | 8.400.000,00       | Deutsche Bundesrepublik Infl 0.1% 15-04-2046   | 15.201.145,09              | 0,27                         |
|   |   |                            |                              | 45.000.000,00      | DNB Boligkredit AS 0.01% 08-10-2027            | 44.836.920,00              | 0,79                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Covered Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 17.600.000,00      | DNB Boligkredit AS 0.01% 12-05-2028            | 17.489.120,00              | 0,31                         | 7.500.000,00       | Nationale-Niederlanden Bank N 0.125% 24-09-2029    | 7.449.495,00               | 0,13                         |
| 25.000.000,00      | DNB Boligkredit AS 0.625% 14-01-2026           | 25.671.900,00              | 0,45                         | 11.000.000,00      | Nationale-Niederlanden Bank N 1% 25-09-2028        | 11.620.994,00              | 0,20                         |
| 12.900.000,00      | DZ HYP AG 0.01% 15-01-2027                     | 12.920.640,00              | 0,23                         | 53.500.000,00      | Nationwide Building Society 1.125% 31-05-2028      | 56.855.306,00              | 1,00                         |
| 30.000.000,00      | DZ HYP AG 0.01% 20-04-2029                     | 29.776.440,00              | 0,52                         | 22.500.000,00      | NIBC Bank NV 0.125% 21-04-2031                     | 22.035.600,00              | 0,39                         |
| 30.000.000,00      | DZ HYP AG 0.01% 23-06-2028                     | 29.875.620,00              | 0,52                         | 20.000.000,00      | NIBC Bank NV 1% 11-09-2028                         | 21.058.240,00              | 0,37                         |
| 12.000.000,00      | DZ HYP AG 0.01% 27-10-2028                     | 11.943.192,00              | 0,21                         | 13.000.000,00      | NORD/LB Luxembourg SA Cove 0.01% 10-06-2027        | 12.840.542,00              | 0,23                         |
| 21.000.000,00      | Eika Boligkredit AS 0.01% 23-03-2028           | 20.860.812,00              | 0,37                         | 3.443.724,16       | Nykredit Realkredit FRN 01-01-2023 IO EURIBOR 3M S | 3.465.953,40               | 0,06                         |
| 14.000.000,00      | Eika Boligkredit AS 0.5% 28-08-2025            | 14.292.124,00              | 0,25                         | 27.000.000,00      | PKO Bank Hipoteczny SA 0.75% 27-08-2024            | 27.551.556,00              | 0,48                         |
| 10.000.000,00      | Erste Group Bank AG 0.625% 17-04-2026          | 10.284.420,00              | 0,18                         | 35.000.000,00      | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 01-10-2026          | 34.828.220,00              | 0,61                         |
| 13.800.000,00      | Eurocaja Rural SCC 0.125% 22-09-2031           | 13.466.454,00              | 0,24                         | 10.000.000,00      | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 14-09-2027          | 9.919.285,20               | 0,17                         |
| 15.400.000,00      | Federation des Caisses Desja 0.01% 24-09-2025  | 15.435.789,60              | 0,27                         | 12.000.000,00      | Raiffeisen Landesbank Vorarl 0.5% 17-09-2025       | 12.242.160,00              | 0,21                         |
| 32.520.834,00      | French Republic Government B 0.1% 25-07-2031   | 39.890.526,49              | 0,70                         | 22.000.000,00      | Republic of Austria Governme 0.85% 30-06-2120      | 19.125.793,72              | 0,34                         |
| 18.979.166,00      | French Republic Government B 0.7% 25-07-2030   | 25.514.616,69              | 0,45                         | 10.400.000,00      | Romanian Government Internat 1.75% 13-07-2030      | 9.698.000,00               | 0,17                         |
| 7.500.000,00       | Hana Bank 0.01% 26-01-2026                     | 7.473.900,00               | 0,13                         | 21.600.000,00      | Romanian Government Internat 2% 14-04-2033         | 19.664.640,00              | 0,34                         |
| 99.600.000,00      | Hellenic Republic Government 0.75% 18-06-2031  | 94.503.089,52              | 1,66                         | 4.500.000,00       | Romanian Government Internat 3.624% 26-05-2030     | 4.877.064,00               | 0,09                         |
| 51.300.000,00      | Hellenic Republic Government 1.5% 18-06-2030   | 52.274.084,40              | 0,92                         | 22.400.000,00      | San Marino Government Bond 3.25% 24-02-2024        | 23.044.672,00              | 0,40                         |
| 76.000.000,00      | Hellenic Republic Government 1.875% 24-01-2052 | 74.596.280,00              | 1,31                         | 8.900.000,00       | Santander Consumer Bank AG 0.05% 14-02-2030        | 8.797.970,40               | 0,15                         |
| 53.000.000,00      | Hellenic Republic Government 3.875% 12-03-2029 | 63.000.040,00              | 1,10                         | 53.300.000,00      | Santander UK PLC 0.05% 12-01-2027                  | 53.242.862,40              | 0,93                         |
| 12.000.000,00      | HYPONOE Landesbank fuer Nie 0.01% 01-10-2026   | 11.995.104,00              | 0,21                         | 15.500.000,00      | Skipton Building Society 0.01% 22-09-2024          | 15.564.294,00              | 0,27                         |
| 9.000.000,00       | HYPONOE Landesbank fuer Nie 0.01% 18-06-2027   | 8.967.456,00               | 0,16                         | 13.000.000,00      | Slovenska izvozna in razvojn 0.125% 08-07-2025     | 13.012.350,00              | 0,23                         |
| 43.000.000,00      | Hypo Tirol Bank AG 0.01% 19-10-2026            | 42.941.348,00              | 0,75                         | 23.000.000,00      | Slovenska Sporitelna AS 0.125% 12-06-2026          | 23.094.024,00              | 0,40                         |
| 48.500.000,00      | ING Bank NV 0.125% 08-12-2031                  | 47.670.165,00              | 0,84                         | 21.300.000,00      | Societe Generale SFH SA 0.01% 02-12-2026           | 21.348.990,00              | 0,37                         |
| 23.000.000,00      | ING Belgium SA 0.75% 28-09-2026                | 23.839.270,00              | 0,42                         | 30.000.000,00      | Societe Generale SFH SA 0.125% 18-07-2029          | 29.935.200,00              | 0,52                         |
| 13.000.000,00      | ING-DiBa AG 0.125% 23-05-2027                  | 13.081.380,00              | 0,23                         | 9.000.000,00       | Societe Generale SFH SA 0.75% 29-01-2027           | 9.337.536,00               | 0,16                         |
| 13.800.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 0.15% 15-05-2051  | 14.462.148,52              | 0,25                         | 46.800.000,00      | Spain Government Bond 1.45% 31-10-2071             | 40.651.509,60              | 0,71                         |
| 38.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 0.4% 15-05-2030   | 43.450.568,00              | 0,76                         | 21.000.000,00      | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.01% 22-09-2027        | 20.940.444,00              | 0,37                         |
| 33.588.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 1.3% 15-05-2028   | 41.770.876,32              | 0,73                         | 16.700.000,00      | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.125% 12-05-2031       | 16.416.601,00              | 0,29                         |
| 23.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 1.7% 01-09-2051   | 21.550.726,76              | 0,38                         | 14.000.000,00      | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.125% 14-05-2026       | 14.097.608,00              | 0,25                         |
| 48.300.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 2.15% 01-03-2072  | 46.180.653,96              | 0,81                         | 20.600.000,00      | Sparebanken Soer Boligkredit 0.01% 26-10-2026      | 20.586.857,20              | 0,36                         |
| 22.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 2.45% 01-09-2050  | 24.197.448,00              | 0,42                         | 17.700.000,00      | SP-Kiinnitysluottopankki Oyj 0.05% 19-06-2026      | 17.743.506,60              | 0,31                         |
| 7.500.000,00       | Jyske Realkredit A/S 0.01% 10-01-2027 A        | 7.467.000,00               | 0,13                         | 9.500.000,00       | SR-Boligkredit AS 0.01% 08-10-2026                 | 9.494.870,00               | 0,17                         |
| 13.900.000,00      | Kookmin Bank 0.052% 15-07-2025                 | 13.904.726,00              | 0,24                         | 26.600.000,00      | SR-Boligkredit AS 0.01% 10-03-2031                 | 25.918.401,60              | 0,45                         |
| 20.000.000,00      | Korea Housing Finance Corp 0.01% 29-06-2026    | 19.886.000,00              | 0,35                         | 14.000.000,00      | SR-Boligkredit AS 0.75% 17-10-2025                 | 14.429.240,00              | 0,25                         |
| 14.500.000,00      | Korea Housing Finance Corp 0.1% 18-06-2024     | 14.569.919,00              | 0,26                         | 48.400.000,00      | State of North Rhine-Westpha 0.95% 10-01-2121      | 38.451.380,00              | 0,67                         |
| 7.200.000,00       | La Banque Postale Home Loan 0.01% 22-10-2029   | 7.105.377,60               | 0,12                         | 21.175.000,00      | State of North Rhine-Westpha 1.95% 26-09-2078      | 28.534.577,92              | 0,50                         |
| 17.000.000,00      | La Banque Postale Home Loan 0.5% 30-01-2026    | 17.383.214,00              | 0,30                         | 37.765.000,00      | Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.409% 07-11-2029     | 37.912.963,27              | 0,66                         |
| 3.000.000,00       | Latvia Government Internatio 0.25% 23-01-2030  | 2.988.840,00               | 0,05                         | 40.000.000,00      | Sumitomo Mitsui Trust Bank L 0.01% 15-10-2027      | 39.342.720,00              | 0,69                         |
| 3.500.000,00       | Latvia Government Internatio 2.25% 15-02-2047  | 4.775.330,00               | 0,08                         | 11.500.000,00      | UniCredit Bank AG 0.01% 19-11-2027                 | 11.479.208,00              | 0,20                         |
| 10.000.000,00      | Leeds Building Society 0.5% 03-07-2024         | 10.161.480,00              | 0,18                         | 22.500.000,00      | UniCredit Bank AG 0.625% 20-11-2025                | 23.118.705,00              | 0,41                         |
| 10.000.000,00      | Liberbank SA 0.25% 25-09-2029                  | 9.958.840,00               | 0,17                         | 33.000.000,00      | UniCredit Bank Austria AG 0.25% 04-06-2027         | 33.373.296,00              | 0,58                         |
| 24.800.000,00      | Lloyds Bank PLC 0.125% 23-09-2029              | 24.562.416,00              | 0,43                         | 24.000.000,00      | UniCredit Bank Austria AG 0.25% 21-06-2030         | 24.051.408,00              | 0,42                         |
| 9.000.000,00       | Luminor Bank AS/Estonia 0.01% 11-03-2025       | 9.008.208,00               | 0,16                         | 5.820.000,00       | UniCredit Bank Austria AG FRN 20-08-2033           | 5.238.000,00               | 0,09                         |
| 21.800.000,00      | mBank Hipoteczny SA 0.242% 15-09-2025          | 21.925.611,60              | 0,38                         | 3.600.000,00       | UniCredit Bank Austria AG FRN 27-12-2026           | 3.491.753,00               | 0,06                         |
| 8.400.000,00       | MFB Magyar Fejlesztési Bank 0.375% 09-06-2026  | 8.342.510,40               | 0,15                         |                    |  |                            |                              |
| 28.700.000,00      | MMB SCF SACA 0.05% 17-09-2029                  | 28.330.458,80              | 0,50                         |                    |  |                            |                              |
| 32.500.000,00      | MMB SCF SACA 0.75% 31-10-2025                  | 33.455.110,00              | 0,59                         |                    |  |                            |                              |
| 16.800.000,00      | Nationale-Niederlanden Bank N 0.01% 08-07-2030 | 16.489.939,20              | 0,29                         |                    |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Covered Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 6.300.000,00       | UniCredit Bank Austria AG FRN<br>27-12-2029   | 5.848.944,00               | 0,10                         |
| 11.500.000,00      | UniCredit Bank Austria AG FRN<br>27-12-2031   | 10.505.090,27              | 0,18                         |
| 900.000,00         | UniCredit Bank Austria AG FRN<br>31-12-2031   | 810.142,13                 | 0,01                         |
| 17.000.000,00      | Volksbank Wien AG 0.125%<br>19-11-2029  | 16.878.824,00              | 0,30                         |
| 18.000.000,00      | Volksbank Wien AG 0.375%<br>04-03-2026  | 18.290.520,00              | 0,32                         |
| 42.500.000,00      | Vseobecna Uverova Banka AS<br>0.01% 23-06-2025  | 42.514.705,00              | 0,74                         |
| 15.700.000,00      | Vseobecna Uverova Banka AS<br>0.01% 24-03-2026  | 15.667.469,60              | 0,27                         |
| 29.700.000,00      | Vseobecna Uverova Banka AS<br>0.5% 26-06-2029   | 30.269.824,20              | 0,53                         |
| 12.300.000,00      | Yorkshire Building Society 0.01%<br>13-10-2027  | 12.201.624,60              | 0,21                         |
| 9.000.000,00       | Yorkshire Building Society 0.125%<br>08-05-2024   | 9.063.810,00               | 0,16                         |
| 7.600.000,00       | Zuercher Kantonalbank<br>0.000000% 15-05-2026   | 7.561.407,20               | 0,13                         |
|                    |   | <b>4.452.910.615,65</b>    | <b>78,03</b>                 |
|                    | <b>JPY</b>  |                            |                              |
| 1.000.000,00       | Japan Government Thirty Year<br>0.6% 20-06-2050   | 7.507,84                   | 0,00                         |
|                    |   | <b>7.507,84</b>            | <b>0,00</b>                  |
|                    | <b>NOK</b>  |                            |                              |
| 185.000.000,00     | Spb 1 Boligkreditt AS 16/26 ADJ<br>C COVID  | 18.587.769,97              | 0,33                         |
| 355.000.000,00     | Spb 1 Boligkreditt AS 18/24 ADJ<br>C COVID  | 36.161.304,66              | 0,63                         |
|                    |   | <b>54.749.074,63</b>       | <b>0,96</b>                  |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 37.100.000,00      | Republic of Italy Government 4%<br>17-10-2049   | 35.959.141,87              | 0,63                         |
| 24.000.000,00      | United States Treasury Infla<br>0.125% 15-02-2051   | 26.739.497,67              | 0,47                         |
|                    |   | <b>62.698.639,54</b>       | <b>1,10</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>5.467.448.961,18</b>    | <b>95,81</b>                 |
|                    | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>5.467.448.961,18</b>    | <b>95,81</b>                 |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 15.671.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 0.65%<br>15-05-2026  | 17.582.312,93              | 0,31                         |
| 13.400.000,00      | Sumitomo Mitsui Banking Corp<br>0.01% 10-09-2025  | 13.365.305,52              | 0,23                         |
| 25.000.000,00      | Sumitomo Mitsui Banking Corp<br>0.267% 18-06-2026   | 25.125.000,00              | 0,44                         |
|                    |   | <b>56.072.618,45</b>       | <b>0,98</b>                  |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 18.000.000,00      | Republic of Italy Government<br>2.875% 17-10-2029   | 16.232.442,13              | 0,28                         |
| 22.000.000,00      | Republic of Italy Government<br>3.875% 06-05-2051   | 20.751.886,31              | 0,36                         |
|                    |   | <b>36.984.328,44</b>       | <b>0,65</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>93.056.946,89</b>       | <b>1,63</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>93.056.946,89</b>       | <b>1,63</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>5.560.505.908,07</b>    | <b>97,44</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>144.589.962,63</b>      | <b>2,53</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>1.576.061,41</b>        | <b>0,03</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>5.706.671.932,11</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Covered Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor                      |              |
|------------------------|--------------|-----------------------------|--------------|
| Frankreich             | 18,15        | Unternehmensanleihen        | 42,61        |
| Italien                | 15,79        | Hypothekenanleihen          | 37,14        |
| Dänemark               | 15,52        | Staatsanleihen              | 17,63        |
| Griechenland           | 6,26         | Kündbare Hypothekenanleihen | 0,06         |
| Norwegen               | 5,25         |                             |              |
| Deutschland            | 4,96         |                             |              |
| Österreich             | 4,60         |                             |              |
| Niederlande            | 4,34         |                             |              |
| Vereinigtes Königreich | 4,16         |                             |              |
| Spanien                | 3,75         |                             |              |
| Slowakei               | 2,74         |                             |              |
| Kanada                 | 2,22         |                             |              |
| Japan                  | 2,03         |                             |              |
| Polen                  | 1,20         |                             |              |
| Portugal               | 1,05         |                             |              |
| Republik Korea         | 0,98         |                             |              |
| Rumänien               | 0,89         |                             |              |
| Schweiz                | 0,82         |                             |              |
| Belgien                | 0,67         |                             |              |
| USA                    | 0,47         |                             |              |
| San Marino             | 0,40         |                             |              |
| Finnland               | 0,31         |                             |              |
| Luxemburg              | 0,23         |                             |              |
| Slowenien              | 0,23         |                             |              |
| Estland                | 0,16         |                             |              |
| Ungarn                 | 0,15         |                             |              |
| Lettland               | 0,14         |                             |              |
| <b>Summe</b>           | <b>97,44</b> | <b>Summe</b>                | <b>97,44</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - European Covered Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 35.440.051,41                                     | CHF                | 33.787.383,73     | EUR                  | 528.916,22  | 28.01.2022  |
| 316.943,44  | EUR                | 329.318,20        | CHF                  | (1.931,08)  | 28.01.2022  |
| 7.367,13  | EUR                | 6.209,40          | GBP                  | (20,02)   | 28.01.2022  |
| 105.525,93  | EUR                | 1.063.593,86      | NOK                  | (892,43)  | 28.01.2022  |
| 980,23  | EUR                | 4.643,94          | PLN                  | (2773)  | 28.01.2022  |
| 962.250,33  | EUR                | 9.838.986,44      | SEK                  | 2.846,16  | 28.01.2022  |
| 11.365.318,01                                     | EUR                | 12.802.437,43     | USD                  | 68.526,29   | 28.01.2022  |
| 946.209,12  | GBP                | 1.122.135,24      | EUR                  | 3.543,60  | 28.01.2022  |
| 210.787.031,59                                    | NOK                | 20.898.841,46     | EUR                  | 191.557,59  | 28.01.2022  |
| 714.937,05  | PLN                | 150.906,25        | EUR                  | 4.269,61  | 28.01.2022  |
| 1.598.628.118,04                                  | SEK                | 157.839.881,63    | EUR                  | (1.957.671,20)  | 28.01.2022  |
| 19.197.687,77                                     | USD                | 17.042.947,87     | EUR                  | (103.026,89)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.263.909,88)</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 354.266,76  | EUR                | 303.000,00        | GBP                  | (6.018,12)  | 18.02.2022  |
| 1.404.322,65                                      | EUR                | 1.593.000,00      | USD                  | (736,68)  | 18.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(6.754,80)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 716.917,42  | EUR                | 7.375.000,00      | SEK                  | (2.224,53)  | 28.01.2022  |
| 126.570.000,00                                    | SEK                | 12.604.304,82     | EUR                  | (262.520,64)  | 28.01.2022  |
| 219.000,00  | AUD                | 140.362,38        | EUR                  | (350,46)  | 18.02.2022  |
| 75.704.891,21                                     | EUR                | 79.707.000,00     | CHF                  | (1.484.417,25)  | 18.02.2022  |
| 3.677.692,73                                      | EUR                | 3.122.000,00      | GBP                  | (34.524,68)   | 18.02.2022  |
| 103.491.928,15                                    | EUR                | 117.885.000,00    | USD                  | (485.496,86)  | 18.02.2022  |
| 13.508.000,00                                     | GBP                | 16.032.323,15     | EUR                  | 29.270,13   | 18.02.2022  |
| 4.334.000,00                                      | USD                | 3.834.383,75      | EUR                  | (11.717,48)   | 18.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(2.251.981,77)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 56.229.598,69                                     | EUR                | 557.695.000,00    | NOK                  | 398.706,16  | 13.01.2022  |
| 88.675.237,54                                     | EUR                | 900.300.000,88    | SEK                  | 886.883,67  | 28.01.2022  |
| 15.153.000,00                                     | SEK                | 1.523.222,30      | EUR                  | (45.667,34)   | 28.01.2022  |
| 6.256.000,00                                      | AUD                | 3.928.423,78      | EUR                  | 71.259,33   | 18.02.2022  |
| 1.996.706,58                                      | EUR                | 3.121.000,00      | AUD                  | 1.373,72  | 18.02.2022  |
| 39.179.794,81                                     | EUR                | 33.147.000,00     | GBP                  | (233.560,59)  | 18.02.2022  |
| 10.416.000,00                                     | GBP                | 12.355.417,54     | EUR                  | 29.661,08   | 18.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>1.108.656,03</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 10.044.000,00                                     | NOK                | 1.026.482,41      | EUR                  | (20.980,03)   | 13.01.2022  |
| 822.576,96  | EUR                | 8.330.000,00      | SEK                  | 10.318,81   | 28.01.2022  |
| 780.654.000,00                                    | SEK                | 76.446.863,32     | EUR                  | (324.976,67)  | 28.01.2022  |
| 1.435.000,00                                      | AUD                | 924.301,93        | EUR                  | (6.876,41)  | 18.02.2022  |
| 4.108.455,74                                      | EUR                | 6.373.000,00      | AUD                  | 34.066,68   | 18.02.2022  |
| 15.244,08   | EUR                | 1.980.000,00      | JPY                  | 70,43   | 18.02.2022  |
| 2.648.570,64                                      | EUR                | 2.990.000,00      | USD                  | 11.339,59   | 18.02.2022  |
| 1.925.000,00                                      | GBP                | 2.269.973,82      | EUR                  | 18.947,36   | 18.02.2022  |
| 999.000,00  | JPY                | 7.740,74          | EUR                  | (84,99)   | 18.02.2022  |
| 3.556.000,00                                      | USD                | 3.136.748,75      | EUR                  | (284,11)  | 18.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(278.459,34)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                    |                   |                      |   |             |
| 1.156.975,31                                      | EUR                | 11.578.000,00     | SEK                  | 28.011,75   | 28.01.2022  |
| 1.761.000,00                                      | AUD                | 1.126.559,08      | EUR                  | (707,97)  | 18.02.2022  |
| 205.731,17  | EUR                | 323.000,00        | AUD                  | (771,58)  | 18.02.2022  |
| 4.971.027,39                                      | EUR                | 4.211.000,00      | GBP                  | (36.057,14)   | 18.02.2022  |
| 6.539.000,00                                      | GBP                | 7.690.703,48      | EUR                  | 84.512,42   | 18.02.2022  |
| 1.800.000,00                                      | USD                | 1.587.520,12      | EUR                  | 116,88  | 18.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>75.104,36</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| 1.287.175,88                                      | EUR                | 12.902.000,00     | SEK                  | 29.108,82   | 28.01.2022  |
| 7.746.000,00                                      | SEK                | 768.385,50        | EUR                  | (13.074,96)   | 28.01.2022  |
| 3.565.732,22                                      | EUR                | 4.035.000,00      | USD                  | 6.785,63  | 18.02.2022  |
| 200.000.000,00                                    | DKK                | 26.896.996,04     | EUR                  | (839,45)  | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>21.980,04</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>               |                    |                   |                      |   |             |
| 1.520.881,60                                      | EUR                | 15.616.000,00     | SEK                  | (1.845,15)  | 28.01.2022  |
| 3.409.000,00                                      | SEK                | 341.908,10        | EUR                  | (9.499,28)  | 28.01.2022  |
| 575.735.737,35                                    | EUR                | 4.282.702.400,00  | DKK                  | (197.588,71)  | 31.01.2022  |
| 329.313.412,00                                    | EUR                | 2.449.238.863,54  | DKK                  | (62.227,00)   | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(271.160,14)</b>   |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - European Covered Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                       | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 784.028,33                              | EUR                | 7.946.000,00      | SEK                  | 9.213,69  | 28.01.2022  |
| 210.232.000,00                          | DKK                | 28.270.230,28     | EUR                  | 1.936,75  | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>11.150,44</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.591.465,18)</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(2.855.375,06)</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Credit Default Swaps

| Basiswert                            | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal        | Wahrung | Kosten (EUR)          | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)       | Falligkeit |
|--------------------------------------|--------------|-----------------|----------------|----------|-----------------------|--|-----------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>   |              |                 |                |          |                       |  |                       |             |
| ITRAXX-EUROPES34V1-5Y                | Kauf         | 1,00%           | 1.000.000,00   | EUR      | (23.396,76)           | (2.320,99)   | (25.717,75)           | 20.12.2025  |
|                                      |              |                 |                |          | <b>(23.396,76)</b>    | <b>(2.320,99)</b>                                    | <b>(25.717,75)</b>    |             |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b> |              |                 |                |          |                       |  |                       |             |
| ITRAXX-EUROPES36V1-5Y                | Kauf         | 1,00%           | 295.000.000,00 | EUR      | (6.395.846,63)        | (1.239.653,25)                                       | (7.635.499,88)        | 20.12.2026  |
|                                      |              |                 |                |          | <b>(6.395.846,63)</b> | <b>(1.239.653,25)</b>                                | <b>(7.635.499,88)</b> |             |
|                                      |              |                 |                |          | <b>(6.419.243,39)</b> | <b>(1.241.974,24)</b>                                | <b>(7.661.217,63)</b> |             |

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Falligkeit | Wahrung | Erworbene/ Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) |
|--|-------------|----------|--------------------------------|---------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |             |          |                                |                           |   |  |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022  | AUD      | 60,00                          | 5.896.500,00              | (19.268,69)   | 19.445,87  |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | (2.340,00)                     | (311.781.600,00)          | 0,00  | 2.144.072,75   |
| Euro-BTP Future 3/2022                 | 10.03.2022  | EUR      | (3.369,00)                     | (495.428.295,00)          | (151.605,00)  | 8.217.546,21   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | 2.088,00                       | 357.820.560,00            | 0,00  | (6.338.816,16)   |
| EURO-BUXL 30Y BND 3/2022               | 10.03.2022  | EUR      | 61,00                          | 12.611.140,00             | 0,00  | (309.630,70)   |
| Euro-OAT Future 3/2022                 | 10.03.2022  | EUR      | (2.045,00)                     | (333.764.450,00)          | (122.700,00)  | 5.889.600,00   |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022  | GBP      | (1.270,00)                     | (158.661.100,00)          | (226.770,10)  | (146.701,14)   |
| Short Euro-BTP Fu 3/2022               | 10.03.2022  | EUR      | (2.500,00)                     | (282.312.500,00)          | (37.500,00)   | 1.246.103,59   |
| SWEDISH 10YR FUT 3/2022                | 16.03.2022  | SEK      | (151,00)                       | (161.243.536,83)          | 22.557,68   | 215.435,42   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022  | USD      | 101,00                         | 13.178.922,38             | 6.966,96  | (35.883,63)  |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022  | USD      | (2.034,00)                     | (246.161.662,72)          | (84.168,61)   | (761.293,55)   |
| US LONG BOND(CBT) 3/2022               | 31.03.2022  | USD      | (550,00)                       | (88.103.125,00)           | (151.745,91)  | 617.609,66   |
| US ULTRA BOND CBT 3/2022               | 31.03.2022  | USD      | 280,00                         | 55.352.500,00             | 139.054,43  | (961.127,37)   |
|  |             |          |                                |                           | <b>(625.179,24)</b>   | <b>9.796.360,95</b>  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Covered Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Zinsswaps

| Beschreibung                                     | Nominal          | Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>in der Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Kosten in der<br>Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|--|------------------|---------|--|--|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0350%                       | (33.000.000,00)  | EUR     | 5.250.779,78   | -  | 06.03.2070 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.0433%                     | 150.000.000,00   | EUR     | (3.108.151,84)   | -  | 13.04.2031 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.2440%                        | (10.000.000,00)  | EUR     | 287.294,32   | -  | 24.12.2071 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
|  |                  |         | <b>2.429.922,26</b>  | <b>-</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>    |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.3525%                        | (400.000.000,00) | SEK     | 1.864.775,00   | -  | 09.10.2030 |
| Receiving floating rate STIBOR 3 months          |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.7470%                        | (300.000.000,00) | SEK     | 561.869,13   | -  | 20.09.2031 |
| Receiving floating rate STIBOR 3 months          |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.2420%                     | 19.000.000,00    | EUR     | (1.288.585,95)   | -  | 03.12.2051 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.1690%                        | (100.000.000,00) | EUR     | 1.313.639,00   | -  | 03.12.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
|  |                  |         | <b>2.451.697,18</b>  | <b>-</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>    |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.3810%                       | (105.000.000,00) | EUR     | 1.245.291,81   | -  | 14.09.2025 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.3560%                        | (10.000.000,00)  | EUR     | 357.364,73   | -  | 14.09.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate -0.3455%                    | 300.000.000,00   | EUR     | (1.809.549,60)   | -  | 20.09.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.2610%                       | (100.000.000,00) | EUR     | 1.256.600,02   | -  | 20.09.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.2500%                     | 100.000.000,00   | EUR     | (432.202,70)   | -  | 15.10.2031 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.2300%                     | 100.000.000,00   | EUR     | (636.979,20)   | -  | 18.10.2031 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.2190%                     | 60.000.000,00    | EUR     | (461.015,46)   | -  | 01.11.2031 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.3025%                        | (19.000.000,00)  | EUR     | 962.873,63   | -  | 10.11.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.3065%                        | (21.000.000,00)  | EUR     | 1.040.317,31   | -  | 10.11.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.3025%                        | (19.000.000,00)  | EUR     | 1.266.873,63   | (304.000,00)   | 10.11.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
|  |                  |         | <b>2.789.574,17</b>  | <b>(304.000,00)</b>                                  |            |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.4650%                        | (1.000.000,00)   | EUR     | 2.499,89   | -  | 20.04.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate -0.3260%                    | 300.000.000,00   | EUR     | (1.021.257,90)   | -  | 24.05.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.2360%                     | 120.000.000,00   | EUR     | (693.468,24)   | -  | 18.10.2031 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.5140%                     | 100.000.000,00   | EUR     | (302.993,70)   | -  | 29.10.2031 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.2200%                        | (45.000.000,00)  | EUR     | 351.821,43   | -  | 16.11.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0690%                       | (40.000.000,00)  | EUR     | 160.058,36   | -  | 19.11.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.2455%                     | 5.000.000,00     | EUR     | (334.109,59)   | -  | 03.12.2051 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.1710%                        | (100.000.000,00) | EUR     | 1.293.706,30   | -  | 03.12.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
|  |                  |         | <b>(543.743,45)</b>  | <b>-</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.8990%                     | 1.000.000,00     | USD     | (10.373,58)  | -  | 12.04.2025 |
| Paying floating rate USDLIB 3 months             |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.0775%                        | (150.000.000,00) | EUR     | 474.587,55   | -  | 25.10.2028 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0270%                       | (150.000.000,00) | EUR     | 291.402,30   | -  | 15.11.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.1980%                        | (100.000.000,00) | EUR     | 1.000.116,80   | -  | 16.11.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0760%                       | (60.000.000,00)  | EUR     | 261.312,78   | -  | 17.11.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0700%                       | (90.000.000,00)  | EUR     | 365.415,39   | -  | 17.11.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.3350%                     | 31.000.000,00    | EUR     | (1.274.542,44)   | -  | 23.12.2051 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |         |  |  |            |
|  |                  |         | <b>1.107.918,80</b>  | <b>-</b>   |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Covered Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Zinsswaps (Fortsetzung)

| Beschreibung                                   | Nominal         | Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>in der Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Kosten in der<br>Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|--|-----------------|---------|--|--|------------|
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>               |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.2405%                      | (10.500.000,00) | EUR     | 318.656,93   | -  | 24.12.2071 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  |  |            |
|  |                 |         | <b>318.656,93</b>  | <b>-</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>   |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate -0.3625%                  | 300.000.000,00  | EUR     | (1.300.855,34)   | -  | 03.06.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months          |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 1.0780%                      | (60.000.000,00) | USD     | 1.271.152,81   | -  | 26.08.2028 |
| Receiving floating rate USDLIB 3 months        |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.5040%                      | (30.000.000,00) | EUR     | (191.191,17)   | -  | 06.10.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 1.0353%                      | (15.000.000,00) | GBP     | (983.213,68)   | -  | 22.10.2051 |
| Receiving floating rate GBP-SONIA-OIS COMPOUND |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate -0.0030%                  | 100.000.000,00  | EUR     | (17670,20)   | -  | 16.11.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months          |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate -0.0250%                  | 100.000.000,00  | EUR     | (62.162,80)  | -  | 16.11.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months          |                 |         |  |  |            |
|  |                 |         | <b>(1.283.940,38)</b>  | <b>-</b>   |            |
|  |                 |         | <b>7.270.085,51</b>  | <b>(304.000,00)</b>                                  |            |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Zinsswaps 1.310.000,00 EUR gezahlt.  
 BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Zinsswaps 3.020.000,00 EUR gezahlt.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Zinsswaps 2.700.000,00 EUR gezahlt.  
 Deutsche Bank AG hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 7.630.000,00 EUR erhalten.  
 Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Zinsswaps 690.000,00 EUR gezahlt.  
 J.P. Morgan SE hat als Sicherheit für Zinsswaps 440.000,00 EUR gezahlt.  
 Morgan Stanley Europe SE hat als Sicherheit für Zinsswaps 1.080.000,00 EUR erhalten.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>DKK</b>  |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 100.000.000,00  | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2026 SDO A E     | 13.993.307,09              | 2,02                         | 2.000.000,00       | French Republic Government B 0.5% 25-05-2072*      | 1.547.396,00               | 0,22                         |
| 60.000.000,00   | Nordea Kredit 1% 04-01-2026 IO A               | 8.395.984,25               | 1,21                         | 23.000.000,00      | Hellenic Republic Government 0.75% 18-06-2031      | 21.823.002,60              | 3,15                         |
| 140.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2026 SDO A H      | 19.597.270,05              | 2,83                         | 14.000.000,00      | Hellenic Republic Government 1.5% 18-06-2030       | 14.265.832,00              | 2,06                         |
| 125.000.000,00  | Nykredit Realkredit 2% 01-01-2026 SDO A H      | 18.142.666,42              | 2,62                         | 17.900.000,00      | Hellenic Republic Government 1.875% 24-01-2052     | 17.569.387,00              | 2,54                         |
|   |  | <b>60.129.227,81</b>       | <b>8,69</b>                  | 4.700.000,00       | HSBC Bank Canada 0.01% 14-09-2026                  | 4.691.164,00               | 0,68                         |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              | 8.200.000,00       | Iceland Government Internati 0.625% 03-06-2026     | 8.298.110,70               | 1,20                         |
| 4.000.000,00  | Alpha Bank Romania SA FRN 16-05-2024           | 4.020.000,00               | 0,58                         | 16.500.000,00      | ING Bank NV 0.125% 08-12-2031                      | 16.217.685,00              | 2,34                         |
| 7.000.000,00  | Alpha Bank SA 2.5% 05-02-2023                  | 7.170.688,00               | 1,04                         | 8.800.000,00       | ING-DiBa AG 0.01% 07-10-2028*                      | 8.764.764,80               | 1,27                         |
| 11.600.000,00   | AMCO - Asset Management Co S 0.75% 20-04-2028  | 11.255.243,48              | 1,63                         | 18.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 01-08-2026* | 17.652.780,00              | 2,55                         |
| 8.300.000,00  | AMCO - Asset Management Co S 1.5% 17-07-2023   | 8.485.819,49               | 1,23                         | 80.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 15-01-2024* | 80.128.000,00              | 11,58                        |
| 5.000.000,00  | AMCO - Asset Management Co S 2.25% 17-07-2027  | 5.306.151,50               | 0,77                         | 50.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 29-11-2022* | 50.184.272,50              | 7,25                         |
| 5.000.000,00  | Autonomous Community of Cata 4.22% 26-04-2035  | 6.493.120,00               | 0,94                         | 113.000.000,00     | Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 30-01-2024* | 113.133.294,80             | 16,35                        |
| 10.000.000,00   | AyT Cedulas Cajas X Fondo de 3.75% 30-06-2025  | 11.281.360,00              | 1,63                         | 27.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 0.1% 15-05-2023*      | 29.837.343,90              | 4,31                         |
| 13.500.000,00   | Banca Carige SpA 0.625% 28-10-2028             | 13.478.022,00              | 1,95                         | 2.300.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 0.15% 15-05-2051*     | 2.410.358,09               | 0,35                         |
| 6.500.000,00  | Banca Carige SpA FRN 25-05-2022*               | 6.511.115,00               | 0,94                         | 12.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 0.4% 15-05-2030*      | 13.721.232,00              | 1,98                         |
| 10.000.000,00   | Banca Carige SpA FRN 25-05-2023                | 10.060.000,00              | 1,45                         | 3.000.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 1.3% 15-05-2028*      | 3.730.874,98               | 0,54                         |
| 8.000.000,00  | Banca Monte dei Paschi di Si 0.875% 08-10-2026 | 8.220.704,00               | 1,19                         | 6.000.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 1.7% 01-09-2051*      | 5.621.928,72               | 0,81                         |
| 27.000.000,00   | Banca Monte dei Paschi di Si 2% 29-01-2024*    | 28.169.208,00              | 4,07                         | 10.200.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 2.15% 01-03-2072*     | 9.752.436,24               | 1,41                         |
| 15.400.000,00   | Banca Monte dei Paschi di Si 2.125% 26-11-2025 | 16.546.530,00              | 2,39                         | 5.500.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 2.45% 01-09-2050*     | 6.049.362,00               | 0,87                         |
| 17.100.000,00   | Banca Monte dei Paschi di Si 2.875% 16-07-2024 | 18.340.570,80              | 2,65                         | 45.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 2.6% 15-09-2023*      | 60.727.974,72              | 8,78                         |
| 5.000.000,00  | Bank Gospodarstwa Krajowego 0.5% 08-07-2031    | 4.805.050,00               | 0,69                         | 4.400.000,00       | Latvia Government Internatio 0.25% 23-01-2030      | 4.383.632,00               | 0,63                         |
| 5.400.000,00  | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.01% 03-09-2029  | 5.336.690,40               | 0,77                         | 17.000.000,00      | mBank Hipoteczny SA 0.242% 15-09-2025              | 17.097.954,00              | 2,47                         |
| 22.300.000,00   | BPCE SFH SA 0.01% 10-11-2027*                  | 22.225.295,00              | 3,21                         | 2.300.000,00       | MFB Magyar Fejlesztési Bank 0.375% 09-06-2026      | 2.284.258,80               | 0,33                         |
| 6.700.000,00  | BPCE SFH SA 0.01% 16-10-2028                   | 6.649.160,40               | 0,96                         | 3.000.000,00       | PKO Bank Hipoteczny SA 0.625% 24-01-2023           | 3.027.660,00               | 0,44                         |
| 7.000.000,00  | BPCE SFH SA 0.01% 18-03-2031                   | 6.830.656,00               | 0,99                         | 1.500.000,00       | PKO Bank Hipoteczny SA 0.75% 24-01-2024            | 1.526.850,00               | 0,22                         |
| 4.000.000,00  | BPCE SFH SA 0.01% 27-05-2030                   | 3.932.552,00               | 0,57                         | 17.000.000,00      | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 14-09-2027          | 16.862.784,84              | 2,44                         |
| 3.000.000,00  | BPCE SFH SA 0.01% 29-01-2029                   | 2.972.844,00               | 0,43                         | 7.000.000,00       | Republic of Austria Governme 0.000000% 20-02-2031* | 6.948.933,04               | 1,00                         |
| 4.500.000,00  | BPCE SFH SA 0.125% 03-12-2030                  | 4.450.896,00               | 0,64                         | 5.250.000,00       | Republic of Austria Governme 0.85% 30-06-2120*     | 4.564.109,87               | 0,66                         |
| 25.400.000,00   | Caisse Francaise de Financem 0.01% 22-02-2028* | 25.280.162,80              | 3,65                         | 11.254.000,00      | Romanian Government Internat 2% 14-04-2033         | 10.245.641,60              | 1,48                         |
| 4.300.000,00  | Caisse Francaise de Financem 0.01% 27-04-2029  | 4.260.199,20               | 0,62                         | 14.938.000,00      | Romanian Government Internat 3.624% 26-05-2030     | 16.189.684,90              | 2,34                         |
| 8.000.000,00  | Caixa Economica Montepio Ger 0.125% 14-11-2024 | 8.036.960,00               | 1,16                         | 8.800.000,00       | Royal Bank of Canada 0.01% 05-10-2028              | 8.708.515,20               | 1,26                         |
| 17.500.000,00   | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 07-10-2026  | 17.539.613,53              | 2,54                         | 8.400.000,00       | San Marino Government Bond 3.25% 24-02-2024        | 8.641.752,00               | 1,25                         |
| 15.600.000,00   | Cie de Financement Foncier S 0.01% 16-04-2029* | 15.438.602,40              | 2,23                         | 11.300.000,00      | Santander UK PLC 0.05% 12-01-2027                  | 11.287.886,40              | 1,63                         |
| 4.400.000,00  | Cie de Financement Foncier S 0.01% 25-09-2030  | 4.312.281,60               | 0,62                         | 21.200.000,00      | Societe Generale SFH SA 0.01% 02-12-2026*          | 21.248.760,00              | 3,07                         |
| 6.500.000,00  | Cie de Financement Foncier S 0.01% 25-10-2027  | 6.483.178,00               | 0,94                         | 10.000.000,00      | Spain Government Bond 1.45% 31-10-2071*            | 6.886.220,00               | 1,26                         |
| 500.000,00  | Clydesdale Bank PLC 0.01% 22-09-2026           | 497.405,00                 | 0,07                         | 16.500.000,00      | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.01% 22-09-2027        | 16.453.206,00              | 2,38                         |
| 20.000.000,00   | Cooperatieve Rabobank UA 0.01% 02-07-2030      | 19.852.443,40              | 2,87                         | 8.200.000,00       | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.05% 03-11-2028        | 8.147.585,60               | 1,18                         |
| 7.200.000,00  | Coventry Building Society 0.01% 07-07-2028     | 7.102.987,20               | 1,03                         | 12.000.000,00      | State of North Rhine-Westph 0.95% 10-01-2121       | 9.533.400,00               | 1,38                         |
| 30.000.000,00   | Credit Mutuel Home Loan SFH 0.01% 06-05-2031*  | 29.235.300,00              | 4,23                         |                    |  |                            |                              |
| 9.000.000,00  | Danmarks Skibskredit 0.125% 03-20-2025         | 8.992.980,00               | 1,30                         |                    |  |                            |                              |
| 5.700.000,00  | Danmarks Skibskredit 0.25% 06-21-2028 A        | 5.639.010,00               | 0,82                         |                    |  |                            |                              |
| 1.700.000,00  | Deutsche Bundesrepublik Infl 0.1% 15-04-2046*  | 3.076.422,22               | 0,44                         |                    |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 7.000.000,00       | State of North Rhine-Westphalia 1.95% 26-09-2078  | 9.432.918,32               | 1,36                         |
| 5.100.000,00       | Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.409% 07-11-2029  | 5.119.981,80               | 0,74                         |
| 9.000.000,00       | Sumitomo Mitsui Trust Bank L 0.277% 25-10-2028  | 8.942.976,72               | 1,29                         |
| 100.000,00         | UniCredit Bank Austria AG FRN 27-12-2031  | 91.348,61                  | 0,01                         |
| 10.000.000,00      | United Overseas Bank Ltd 0.1% 25-05-2029  | 9.896.080,00               | 1,43                         |
| 3.300.000,00       | Vseobecna Uverova Banka AS 0.01% 24-03-2026   | 3.293.162,40               | 0,48                         |
| 3.500.000,00       | Vseobecna Uverova Banka AS 0.5% 26-06-2029  | 3.567.151,00               | 0,52                         |
| 6.000.000,00       | Westpac Securities NZ Ltd/Lo 0.01% 08-06-2028   | 5.920.020,00               | 0,86                         |
| 4.200.000,00       | Zuercher Kantonalbank 0.000000% 15-05-2026  | 4.178.672,40               | 0,60                         |
|                    |   | <b>1.107.070.484,68</b>    | <b>160,00</b>                |
|                    | <b>JPY</b>  |                            |                              |
| 1.000.000,00       | Japan Government Thirty Year 0.6% 20-06-2050  | 7.507,84                   | 0,00                         |
|                    |   | <b>7.507,84</b>            | <b>0,00</b>                  |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 2.800.000,00       | Republic of Italy Government 4% 17-10-2049  | 2.713.897,50               | 0,39                         |
| 9.400.000,00       | United States Treasury Inflation 0.125% 15-02-2051  | 10.472.969,91              | 1,51                         |
|                    |   | <b>13.186.867,41</b>       | <b>1,91</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>1.180.394.087,74</b>    | <b>170,60</b>                |
|                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>1.180.394.087,74</b>    | <b>170,60</b>                |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 2.439.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 0.65% 15-05-2026*  | 2.736.472,54               | 0,40                         |
| 1.000.000,00       | Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.267% 18-06-2026  | 1.005.000,00               | 0,15                         |
|                    |   | <b>3.741.472,54</b>        | <b>0,54</b>                  |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 5.000.000,00       | Republic of Italy Government 3.875% 06-05-2051  | 4.716.337,80               | 0,68                         |
|                    |   | <b>4.716.337,80</b>        | <b>0,68</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>8.457.810,34</b>        | <b>1,22</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>8.457.810,34</b>        | <b>1,22</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>1.188.851.898,08</b>    | <b>171,82</b>                |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>29.112.762,66</b>       | <b>4,21</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(526.066.747,92)</b>    | <b>(76,03)</b>               |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>691.897.912,82</b>      | <b>100,00</b>                |

(\*) Die Anleihe ist im Rahmen eines Pensionsgeschäfts teilweise oder komplett verkauft.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |               | Sektor               |               |
|------------------------|---------------|----------------------|---------------|
| Italien                | 76,53         | Staatsanleihen       | 87,19         |
| Frankreich             | 23,55         | Unternehmensanleihen | 46,78         |
| Dänemark               | 10,81         | Hypothekenanleihen   | 37,85         |
| Griechenland           | 8,79          |                      |               |
| Deutschland            | 6,47          | <b>Summe</b>         | <b>171,82</b> |
| Niederlande            | 5,21          |                      |               |
| Kanada                 | 4,47          |                      |               |
| Rumänien               | 4,40          |                      |               |
| Norwegen               | 4,19          |                      |               |
| Polen                  | 3,82          |                      |               |
| Spanien                | 3,82          |                      |               |
| Slowakei               | 3,43          |                      |               |
| Vereinigtes Königreich | 2,73          |                      |               |
| Österreich             | 2,45          |                      |               |
| Japan                  | 2,18          |                      |               |
| USA                    | 1,51          |                      |               |
| Singapur               | 1,43          |                      |               |
| San Marino             | 1,25          |                      |               |
| Island                 | 1,20          |                      |               |
| Portugal               | 1,16          |                      |               |
| Neuseeland             | 0,86          |                      |               |
| Lettland               | 0,63          |                      |               |
| Schweiz                | 0,60          |                      |               |
| Ungarn                 | 0,33          |                      |               |
| <b>Summe</b>           | <b>171,82</b> |                      |               |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 7.281.966,09                                      | CHF                | 6.942.525,29      | EUR                  | 108.540,39  | 28.01.2022  |
| 71.442,62   | EUR                | 74.664,78         | CHF                  | (854,47)  | 28.01.2022  |
| 16.602,14   | EUR                | 168.318,02        | NOK                  | (239,05)  | 28.01.2022  |
| 36,50   | EUR                | 41,15             | USD                  | 0,19  | 28.01.2022  |
| 20.049.472,25                                     | NOK                | 1.987.839,28      | EUR                  | 18.220,42   | 28.01.2022  |
| 6.467,04  | USD                | 5.741,18          | EUR                  | (34,71)   | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>125.632,77</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 103.440,41  | EUR                | 1.067.000,00      | SEK                  | (600,18)  | 31.01.2022  |
| 399.652,43  | EUR                | 465.000,00        | USD                  | (10.642,99)   | 31.01.2022  |
| 1.898.000,00                                      | USD                | 1.658.406,66      | EUR                  | 16.289,10   | 31.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>5.045,93</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 981.000,00  | AUD                | 618.408,70        | EUR                  | 8.978,38  | 31.01.2022  |
| 4.843.000,00                                      | DKK                | 650.980,08        | EUR                  | 301,52  | 31.01.2022  |
| 109.609,03  | EUR                | 171.000,00        | AUD                  | 249,00  | 31.01.2022  |
| 3.076.786,81                                      | EUR                | 2.620.000,00      | GBP                  | (39.957,94)   | 31.01.2022  |
| 394.646,75  | EUR                | 4.022.000,00      | SEK                  | 2.473,96  | 31.01.2022  |
| 2.308.142,27                                      | EUR                | 2.654.000,00      | USD                  | (33.614,45)   | 31.01.2022  |
| 1.638.000,00                                      | GBP                | 1.929.442,44      | EUR                  | 19.114,50   | 31.01.2022  |
| 20.000,00   | JPY                | 150,88            | EUR                  | 2,43  | 31.01.2022  |
| 11.880.000,00                                     | SEK                | 1.164.031,84      | EUR                  | (5.648,76)  | 31.01.2022  |
| 3.180.000,00                                      | USD                | 2.788.411,89      | EUR                  | 17.447,88   | 31.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(30.653,48)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 680.000,00  | AUD                | 433.652,32        | EUR                  | 1.230,88  | 31.01.2022  |
| 14.000,00   | CAD                | 9.707,28          | EUR                  | 7,99  | 31.01.2022  |
| 1.036.318,87                                      | EUR                | 1.623.000,00      | AUD                  | (1.644,30)  | 31.01.2022  |
| 695.391,56  | EUR                | 1.007.000,00      | CAD                  | (3.415,59)  | 31.01.2022  |
| 941.484,05  | EUR                | 798.000,00        | GBP                  | (7.812,05)  | 31.01.2022  |
| 7.612,67  | EUR                | 991.000,00        | JPY                  | 16,41   | 31.01.2022  |
| 8.481.374,64                                      | EUR                | 9.695.000,00      | USD                  | (72.979,58)   | 31.01.2022  |
| 936.000,00  | GBP                | 1.102.608,59      | EUR                  | 10.852,48   | 31.01.2022  |
| 969.000,00  | SEK                | 97.948,37         | EUR                  | (3.465,81)  | 31.01.2022  |
| 1.601.000,00                                      | USD                | 1.393.253,09      | EUR                  | 19.388,64   | 31.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(57.820,93)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 904.000,00  | AUD                | 580.732,05        | EUR                  | (2.595,60)  | 31.01.2022  |
| 12.000,00   | CHF                | 11.543,09         | EUR                  | 76,58   | 31.01.2022  |
| 425.217,27  | EUR                | 672.000,00        | AUD                  | (4.551,57)  | 31.01.2022  |
| 793.992,01  | EUR                | 5.906.000,00      | DKK                  | (240,66)  | 31.01.2022  |
| 1.848.362,92                                      | EUR                | 1.585.315,00      | GBP                  | (37.531,01)   | 31.01.2022  |
| 1.480.974,37                                      | EUR                | 15.000.000,00     | NOK                  | (19.700,28)   | 31.01.2022  |
| 1.622.858,03                                      | EUR                | 16.558.400,00     | SEK                  | 8.298,49  | 31.01.2022  |
| 13.172.807,60                                     | EUR                | 15.405.000,00     | USD                  | (419.920,93)  | 31.01.2022  |
| 13.000,00   | GBP                | 15.336,81         | EUR                  | 127,92  | 31.01.2022  |
| 14.946.000,00                                     | NOK                | 1.467.079,93      | EUR                  | 28.197,16   | 31.01.2022  |
| 1.226.000,00                                      | SEK                | 120.711,97        | EUR                  | (1.168,73)  | 31.01.2022  |
| 1.140.000,00                                      | USD                | 982.416,29        | EUR                  | 23.467,77   | 31.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(425.540,86)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                    |                   |                      |   |             |
| 269.000,00  | AUD                | 171.967,63        | EUR                  | 66,82   | 31.01.2022  |
| 447.125,37  | EUR                | 710.000,00        | AUD                  | (6.947,09)  | 31.01.2022  |
| 60.731.295,51                                     | EUR                | 451.684.000,00    | DKK                  | (10.689,21)   | 31.01.2022  |
| 943.737,19  | EUR                | 800.000,00        | GBP                  | (7.938,16)  | 31.01.2022  |
| 586.818,34  | EUR                | 5.913.000,00      | SEK                  | 10.263,72   | 31.01.2022  |
| 1.156.637,22                                      | EUR                | 1.346.000,00      | USD                  | (31.013,72)   | 31.01.2022  |
| 1.788.000,00                                      | GBP                | 2.088.673,91      | EUR                  | 38.332,23   | 31.01.2022  |
| 1.000,00  | NOK                | 102,46            | EUR                  | (2,42)  | 31.01.2022  |
| 6.772.000,00                                      | SEK                | 671.755,43        | EUR                  | (11.442,76)   | 31.01.2022  |
| 4.292.000,00                                      | USD                | 3.695.183,92      | EUR                  | 91.883,32   | 31.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>72.512,73</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: HSBC Continental Europe SA</b>    |                    |                   |                      |   |             |
| 11.533,45   | EUR                | 12.000,00         | CHF                  | (86,23)   | 31.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(86,23)</b>  |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                       | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|--|-------------|
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>        |                    |                   |                      |  |             |
| 268.000,00                              | AUD                | 169.957,43        | EUR                  | 1.438,25   | 31.01.2022  |
| 46.000,00                               | CAD                | 31.752,03         | EUR                  | 169,65   | 31.01.2022  |
| 5.365.000,00                            | DKK                | 721.316,81        | EUR                  | 162,71   | 31.01.2022  |
| 282.201,57                              | EUR                | 450.000,00        | AUD                  | (5.591,50)   | 31.01.2022  |
| 54.332,93                               | EUR                | 46.000,00         | GBP                  | (388,37)   | 31.01.2022  |
| 933.977,46                              | EUR                | 9.452.000,00      | SEK                  | 12.345,83  | 31.01.2022  |
| 2.675.280,17                            | EUR                | 3.085.000,00      | USD                  | (46.773,76)  | 31.01.2022  |
| 621.000,00                              | GBP                | 726.894,33        | EUR                  | 11.846,92  | 31.01.2022  |
| 6.715.000,00                            | SEK                | 662.965,51        | EUR                  | (8.208,92)   | 31.01.2022  |
| 259.000,00                              | USD                | 221.980,61        | EUR                  | 6.549,88   | 31.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(28.449,31)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>     |                    |                   |                      |  |             |
| 967.987,29                              | EUR                | 9.805.000,00      | SEK                  | 11.935,35  | 31.01.2022  |
| 1.813.000,00                            | SEK                | 181.693,38        | EUR                  | (4.915,51)   | 31.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>7.019,84</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b> |                    |                   |                      |  |             |
| 43.000,00                               | AUD                | 27.638,00         | EUR                  | (138,15)   | 31.01.2022  |
| 785.382,47                              | EUR                | 668.000,00        | GBP                  | (9.267,95)   | 31.01.2022  |
| 403.185,78                              | EUR                | 4.029.000,00      | SEK                  | 10.334,90  | 31.01.2022  |
| 632.715,37                              | EUR                | 715.000,00        | USD                  | 1.841,36   | 31.01.2022  |
| 222.000,00                              | GBP                | 261.929,25        | EUR                  | 2.160,63   | 31.01.2022  |
| 6.191.000,00                            | SEK                | 617.546,93        | EUR                  | (13.887,40)  | 31.01.2022  |
| 781.000,00                              | USD                | 685.104,96        | EUR                  | 4.006,98   | 31.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(4.949,63)</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(462.921,94)</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(337.289,17)</b>  |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

## Credit Default Swaps

| Basiswert                            | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal       | Wahrung | Kosten (EUR)          | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)       | Falligkeit |
|--------------------------------------|--------------|-----------------|---------------|----------|-----------------------|---|-----------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b> |              |                 |               |          |                       |   |                       |             |
| ITRAXX-EUROPE36V1-5Y                 | Kauf         | 1,00%           | 67.000.000,00 | EUR      | (1.452.616,02)        | (281.548,36)  | (1.734.164,38)        | 20.12.2026  |
|                                      |              |                 |               |          | <b>(1.452.616,02)</b> | <b>(281.548,36)</b>                                 | <b>(1.734.164,38)</b> |             |

## Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Falligkeit | Wahrung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) |
|--|-------------|----------|-------------------------------|---------------------------|--|---|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |             |          |                               |                           |  |   |
| 90DAY EURO\$ FUTR 12/2023              | 18.12.2023  | USD      | 1,00                          | 246.000,00                | 11,04  | (1108,95)   |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022  | AUD      | 105,00                        | 10.318.875,00             | (33.720,22)  | 34.030,24   |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022  | CAD      | 156,00                        | 22.191.000,00             | (12.999,03)  | 432.341,67  |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | (1.991,00)                    | (265.280.840,00)          | 0,00   | 1.903.777,79  |
| Euro-BTP Future 3/2022                 | 10.03.2022  | EUR      | (799,00)                      | (117.496.945,00)          | (35.955,00)  | 2.000.623,89  |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | 103,00                        | 17.651.110,00             | 0,00   | (302.085,92)  |
| EURO-BUXL 30Y BND 3/2022               | 10.03.2022  | EUR      | (13,00)                       | (2.687.620,00)            | 0,00   | 126.453,58  |
| Euro-OAT Future 3/2022                 | 10.03.2022  | EUR      | (496,00)                      | (80.952.160,00)           | (29.760,00)  | 1.419.555,78  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

| Beschreibung              | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in<br>der Basiswährung des Teilfonds<br>(EUR) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (EUR) |
|---------------------------|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| EURO-SCHATZ FUT 3/2022    | 10.03.2022 | EUR     | (1.449,00)                           | (162.349.582,50)            | (18.112,50)   | 233.653,04   |
| LONG GILT FUTURE 3/2022   | 31.03.2022 | GBP     | (328,00)                             | (40.977.040,00)             | (58.567,40)   | (37.888,15)  |
| Short Euro-BTP Fu 3/2022  | 10.03.2022 | EUR     | (2.761,00)                           | (311.785.925,00)            | (41.415,00)   | 1.262.861,79   |
| SWEDISH 10YR FUT 3/2022   | 16.03.2022 | SEK     | (308,00)                             | (328.894.101,62)            | 46.011,70   | 439.431,24   |
| US 10YR NOTE (CBT) 3/2022 | 31.03.2022 | USD     | (835,00)                             | (108.954.457,30)            | (57.598,15)   | (834.055,50)   |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022  | 05.04.2022 | USD     | (387,00)                             | (46.836.068,57)             | (16.014,38)   | (144.847,90)   |
| US LONG BOND(CBT) 3/2022  | 31.03.2022 | USD     | (31,00)                              | (4.965.812,50)              | (8.552,95)  | 41.374,38  |
| US ULTRA BOND CBT 3/2022  | 31.03.2022 | USD     | 237,00                               | 46.851.937,50               | 117.699,64  | (165.786,73)   |
|                           |            |         |                                      |                             | <b>(148.972,25)</b>   | <b>6.408.330,25</b>  |

### Zinsswaps

| Beschreibung                                   | Nominal         | Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>in der Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Kosten in der<br>Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|--|-----------------|---------|--|--|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>             |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.6920%                      | (1.000.000,00)  | EUR     | (39.681,57)  | -  | 04.03.2029 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 0.0745%                      | (9.000.000,00)  | EUR     | 162.331,09   | -  | 26.04.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 2.0420%                      | (8.000.000,00)  | USD     | (500.450,28)   | -  | 20.05.2051 |
| Receiving floating rate USDLIB 3 months        |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 0.1080%                      | (10.500.000,00) | EUR     | 169.154,80   | -  | 04.07.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
| Receiving fixed rate -0.0410%                  | 100.000.000,00  | EUR     | (94.521,00)  | -  | 16.11.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months          |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 0.2440%                      | (2.500.000,00)  | EUR     | 71.823,58  | -  | 24.12.2071 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
|  |                 |         | <b>(231.343,38)</b>  | -  |            |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>  |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.3525%                      | (50.000.000,00) | SEK     | 233.096,88   | -  | 09.10.2030 |
| Receiving floating rate STIBOR 3 months        |                 |         |  | -  |            |
| Receiving fixed rate -0.1010%                  | 80.000.000,00   | EUR     | (179.369,68)   | -  | 22.11.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months          |                 |         |  | -  |            |
| Receiving fixed rate 0.2420%                   | 5.000.000,00    | EUR     | (339.101,57)   | -  | 03.12.2051 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months          |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 0.1200%                      | (15.000.000,00) | EUR     | 275.164,80   | -  | 20.12.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
|  |                 |         | <b>(10.209,57)</b>   | -  |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>  |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.0480%                      | (6.000.000,00)  | EUR     | (39.115,39)  | -  | 03.05.2024 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 1.6660%                      | (20.000.000,00) | USD     | 330.895,72   | -  | 27.07.2051 |
| Receiving floating rate USDLIB 3 months        |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 0.3560%                      | (5.000.000,00)  | EUR     | 178.682,37   | -  | 14.09.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate -0.2610%                     | (40.000.000,00) | EUR     | 502.640,01   | -  | 20.09.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
| Receiving fixed rate -0.3380%                  | 80.000.000,00   | EUR     | (470.448,00)   | -  | 20.09.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months          |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 0.4770%                      | (10.000.000,00) | EUR     | 12.989,79  | -  | 05.10.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate -0.3700%                     | (70.000.000,00) | EUR     | 75.009,83  | -  | 09.11.2023 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate -0.3690%                     | (80.000.000,00) | EUR     | 84.230,72  | -  | 09.11.2023 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 0.3025%                      | (5.000.000,00)  | EUR     | 253.387,80   | -  | 10.11.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 0.3065%                      | (3.000.000,00)  | EUR     | 148.616,76   | -  | 10.11.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 0.6350%                      | (1.800.000,00)  | GBP     | 105.521,51   | -  | 01.02.2051 |
| Receiving floating rate GBP-SONIA-OIS COMPOUND |                 |         |  | -  |            |
| Paying fixed rate 0.3025%                      | (5.000.000,00)  | EUR     | 333.387,80   | (80.000,00)  | 10.11.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  | -  |            |
|  |                 |         | <b>1.515.798,92</b>  | <b>(80.000,00)</b>                                   |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Zinsswaps (Fortsetzung)

| Beschreibung                                     | Nominal         | Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>in der Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Kosten in der<br>Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|--|-----------------|---------|--|--|------------|
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.0080%                        | (11.000.000,00) | EUR     | 1.465.969,33   | -  | 08.01.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.3020%                       | (5.000.000,00)  | EUR     | 64.305,70  | -  | 11.06.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.5140%                     | 18.000.000,00   | EUR     | (54.538,87)  | -  | 29.10.2031 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.2610%                     | 3.000.000,00    | EUR     | (187.546,46)   | -  | 15.11.2051 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.2200%                        | (10.000.000,00) | EUR     | 78.182,54  | -  | 16.11.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0690%                       | (25.000.000,00) | EUR     | 100.036,48   | -  | 19.11.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.2455%                     | 2.000.000,00    | EUR     | (133.643,83)   | -  | 03.12.2051 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.1280%                        | (15.000.000,00) | EUR     | 263.142,64   | -  | 20.12.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.1190%                        | (10.000.000,00) | EUR     | 184.445,05   | -  | 20.12.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
|  |                 |         | <b>1.780.352,58</b>  | <b>-</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 1.6025%                        | (4.000.000,00)  | USD     | 120.985,83   | -  | 19.01.2051 |
| Receiving floating rate USDLIB 3 months          |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 1.6475%                     | 5.000.000,00    | USD     | 37.056,06  | -  | 12.04.2031 |
| Paying floating rate USDLIB 3 months             |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.4675%                        | (6.000.000,00)  | EUR     | (429.110,65)   | -  | 20.05.2071 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.0450%                        | (10.000.000,00) | EUR     | 240.079,33   | -  | 24.09.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.0775%                        | (50.000.000,00) | EUR     | 158.195,85   | -  | 25.10.2028 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0270%                       | (30.000.000,00) | EUR     | 58.280,46  | -  | 15.11.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.1980%                        | (20.000.000,00) | EUR     | 200.023,36   | -  | 16.11.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0675%                       | (50.000.000,00) | EUR     | 195.421,05   | -  | 16.11.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0760%                       | (70.000.000,00) | EUR     | 304.864,91   | -  | 17.11.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate -0.0725%                    | 150.000.000,00  | EUR     | (238.633,50)   | -  | 17.11.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0700%                       | (30.000.000,00) | EUR     | 121.805,13   | -  | 17.11.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.3195%                     | 4.000.000,00    | EUR     | (183.208,24)   | -  | 22.11.2051 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0860%                       | (50.000.000,00) | EUR     | 245.562,20   | -  | 23.11.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.1670%                        | (20.000.000,00) | EUR     | 266.714,32   | -  | 03.12.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.0300%                       | (40.000.000,00) | EUR     | 448.799,84   | -  | 09.12.2028 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
|  |                 |         | <b>1.546.835,95</b>  | <b>-</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 0.2405%                        | (2.300.000,00)  | EUR     | 69.801,04  | -  | 24.12.2071 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
|  |                 |         | <b>69.801,04</b>   | <b>-</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>     |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 0.8580%                     | 80.000.000,00   | USD     | (1.006.510,81)   | -  | 20.05.2025 |
| Paying floating rate USDLIB 3 months             |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate 1.6045%                     | 30.000.000,00   | USD     | 116.513,12   | -  | 20.05.2031 |
| Paying floating rate USDLIB 3 months             |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 1.0780%                        | (18.000.000,00) | USD     | 381.345,84   | -  | 26.08.2028 |
| Receiving floating rate USDLIB 3 months          |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate -0.3455%                    | 140.000.000,00  | EUR     | (844.456,48)   | -  | 20.09.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate -0.2550%                       | (35.000.000,00) | EUR     | 429.859,52   | -  | 22.09.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                 |         |  |  |            |
| Paying fixed rate 1.0353%                        | (1.500.000,00)  | GBP     | (98.321,37)  | -  | 22.10.2051 |
| Receiving floating rate GBP-SONIA-OIS COMPOUND   |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate -0.0030%                    | 100.000.000,00  | EUR     | (17670,20)   | -  | 16.11.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                 |         |  |  |            |
| Receiving fixed rate -0.0250%                    | 50.000.000,00   | EUR     | (31.081,40)  | -  | 16.11.2024 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                 |         |  |  |            |
|  |                 |         | <b>(1.070.321,78)</b>  | <b>-</b>   |            |
|  |                 |         | <b>3.600.913,76</b>  | <b>(80.000,00)</b>                                   |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Pensionsgeschäfte

| Basiswert  | Kauf/<br>Verkauf | Wahrung | Nominal (in<br>Wahrung) | Verpflichtung in der<br>Basiswahrung des<br>Teilfonds (EUR) | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>in der Basiswahrung des<br>Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|--|------------------|----------|--------------------------|--|---|-------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                     |                  |          |                          |  |   |             |
| Italy Buoni Poliennali Del T 2.6% 15-09-2023           | Verkauf          | EUR      | (15.000.000,00)          | (20.287.499,91)  | (32.555,82)   | 12.01.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.1% 15-05-2023           | Verkauf          | EUR      | (7.000.000,00)           | (7.679.700,04)   | (12.308,89)   | 12.01.2022  |
|  |                  |          |                          | <b>(27.967.199,95)</b>                                       | <b>(44.864,71)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Credit Agricole Corporate &amp; In</b> |                  |          |                          |  |   |             |
| DZ HYP AG 0.01% 20-04-2029                             | Verkauf          | EUR      | (5.000.000,00)           | (4.733.427,46)   | (777,74)  | 04.02.2022  |
| ING-DiBa AG 0.01% 07-10-2028                           | Verkauf          | EUR      | (8.800.000,00)           | (8.354.603,37)   | (1.372,74)  | 04.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 30-01-2024      | Verkauf          | EUR      | (15.000.000,00)          | (15.024.450,00)  | (1.821,45)  | 04.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 15-01-2024      | Verkauf          | EUR      | (20.000.000,00)          | (20.039.800,00)  | (2.429,40)  | 04.02.2022  |
|  |                  |          |                          | <b>(48.152.280,83)</b>                                       | <b>(6.401,33)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>                   |                  |          |                          |  |   |             |
| Caisse Francaise de Financem 0.01% 22-02-2028          | Verkauf          | EUR      | (15.300.000,00)          | (14.926.680,00)  | (431,61)  | 12.01.2022  |
| Spain Government Bond 1.45% 31-10-2071                 | Verkauf          | EUR      | (6.000.000,00)           | (5.594.400,00)   | 174,12  | 12.01.2022  |
| Republic of Austria Governme 0.85% 30-06-2120          | Verkauf          | EUR      | (3.750.000,00)           | (3.742.875,00)   | 16,61   | 12.01.2022  |
| Credit Mutuel Home Loan SFH 0.01% 06-05-2031           | Verkauf          | EUR      | (30.000.000,00)          | (28.860.000,00)  | (834,30)  | 12.01.2022  |
| Banca Carige SpA FRN 25-05-2022                        | Verkauf          | EUR      | (6.500.000,00)           | (6.337.500,07)   | (310,05)  | 12.01.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 30-01-2024      | Verkauf          | EUR      | (68.000.000,00)          | (66.966.400,00)  | 2.530,96  | 12.01.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.65% 15-05-2026          | Verkauf          | EUR      | (2.439.000,00)           | (2.690.217,00)   | (4.278,00)  | 12.01.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 2.15% 01-03-2072          | Verkauf          | EUR      | (7.200.000,00)           | (7.003.440,00)   | 217,94  | 12.01.2022  |
| French Republic Government B 0.5% 25-05-2072           | Verkauf          | EUR      | (2.000.000,00)           | (1.699.600,00)   | 188,92  | 12.01.2022  |
| French Republic Government B 0.1% 25-07-2031           | Verkauf          | EUR      | (3.583.333,00)           | (4.344.791,26)   | (6.554,79)  | 12.01.2022  |
| Banca Monte dei Paschi di Si 2% 29-01-2024             | Verkauf          | EUR      | (12.000.000,00)          | (12.393.600,00)  | (565,08)  | 12.01.2022  |
| BPCE SFH SA 0.01% 10-11-2027                           | Verkauf          | EUR      | (4.500.000,00)           | (4.392.450,00)   | (156,38)  | 12.01.2022  |
| DZ HYP AG 0.01% 23-06-2028                             | Verkauf          | EUR      | (9.000.000,00)           | (8.701.200,00)   | (1.305,00)  | 02.02.2022  |
| Cie de Financement Foncier S 0.01% 16-04-2029          | Verkauf          | EUR      | (9.000.000,00)           | (8.649.000,00)   | (1.297,17)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 2.45% 01-09-2050          | Verkauf          | EUR      | (5.500.000,00)           | (6.003.250,00)   | (416,52)  | 02.02.2022  |
| Societe Generale SFH SA 0.01% 02-12-2026               | Verkauf          | EUR      | (13.000.000,00)          | (12.643.800,00)  | (1.896,31)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 2.15% 01-03-2072          | Verkauf          | EUR      | (2.000.000,00)           | (1.898.600,00)   | (192,94)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.4% 15-05-2030           | Verkauf          | EUR      | (2.000.000,00)           | (2.245.400,00)   | (228,19)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.15% 15-05-2051          | Verkauf          | EUR      | (2.300.000,00)           | (2.372.680,00)   | (241,10)  | 02.02.2022  |
| Caisse Francaise de Financem 0.01% 22-02-2028          | Verkauf          | EUR      | (3.000.000,00)           | (2.899.500,00)   | (434,85)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 1.7% 01-09-2051           | Verkauf          | EUR      | (6.000.000,00)           | (5.575.800,00)   | (296,94)  | 02.02.2022  |
|  |                  |          |                          | <b>(209.941.183,33)</b>                                      | <b>(16.310,68)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                       |                  |          |                          |  |   |             |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 29-11-2022      | Verkauf          | EUR      | (50.000.000,00)          | (49.970.813,88)  | 92,88   | 05.01.2022  |
| Republic of Austria Governme 0.000000% 20-02-2031      | Verkauf          | EUR      | (7.000.000,00)           | (6.863.317,27)   | (365,57)  | 02.02.2022  |
| Deutsche Bundesrepublik Infl 0.1% 15-04-2046           | Verkauf          | EUR      | (1.700.000,00)           | (3.040.314,90)   | (161,93)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 2.6% 15-09-2023           | Verkauf          | EUR      | (30.000.000,00)          | (40.449.033,36)  | (3.458,48)  | 02.02.2022  |
| French Republic Government B 0.1% 25-07-2031           | Verkauf          | EUR      | (3.000.000,00)           | (3.649.534,06)   | (194,37)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 1.3% 15-05-2028           | Verkauf          | EUR      | (3.000.000,00)           | (3.694.735,16)   | (315,88)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.1% 15-05-2023           | Verkauf          | EUR      | (20.000.000,00)          | (22.075.114,52)  | (1.887,38)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.4% 15-05-2030           | Verkauf          | EUR      | (10.000.000,00)          | (11.279.572,12)  | (964,37)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 15-01-2024      | Verkauf          | EUR      | (60.000.000,00)          | (59.726.943,49)  | (5.106,71)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 01-08-2026      | Verkauf          | EUR      | (18.000.000,00)          | (17.557.920,57)  | (1.501,17)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 30-01-2024      | Verkauf          | EUR      | (30.000.000,00)          | (29.863.471,74)  | (2.553,36)  | 02.02.2022  |
| Italy Buoni Poliennali Del T 2.15% 01-03-2072          | Verkauf          | EUR      | (1.000.000,00)           | (928.092,61)   | (79,35)   | 02.02.2022  |
|  |                  |          |                          | <b>(249.098.863,68)</b>                                      | <b>(16.495,69)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: UBS Europe SE</b>                      |                  |          |                          |  |   |             |
| Spain Government Bond 1.45% 31-10-2071                 | Verkauf          | EUR      | (2.000.000,00)           | (1.756.935,56)   | (263,50)  | 02.02.2022  |
|  |                  |          |                          | <b>(1.756.935,56)</b>  | <b>(263,50)</b>   |             |
|  |                  |          |                          | <b>(536.916.463,35)</b>                                      | <b>(84.335,91)</b>  |             |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit fur Zinsswaps 250.000,00 EUR gezahlt.  
 BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit fur Zinsswaps 140.000,00 EUR erhalten.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit fur Zinsswaps 1.380.000,00 EUR gezahlt.  
 Deutsche Bank AG hat als Sicherheit fur Credit Default Swaps und Zinsswaps 20.000,00 EUR erhalten.  
 Goldman Sachs International hat als Sicherheit fur Zinsswaps 1.440.000,00 EUR gezahlt.  
 Morgan Stanley Europe SE hat als Sicherheit fur Zinsswaps 943.000,00 EUR erhalten.

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Cross Credit Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |              |                            |                              | 5.592.000,00       | Netflix Inc 3% 15-06-2025                       | 6.057.053,09               | 0,63                         |
|   |              |                            |                              | 3.700.000,00       | Netflix Inc 3.625% 15-06-2030                   | 4.403.392,20               | 0,46                         |
|   |              |                            |                              | 5.100.000,00       | Netflix Inc 3.875% 15-11-2029                   | 6.150.294,00               | 0,64                         |
|   |              |                            |                              | 16.747.000,00      | NGG Finance PLC 2.125% MULTI 05-09-2082         | 16.914.470,00              | 1,76                         |
|   |              |                            |                              | 16.940.000,00      | Nidda Healthcare Holding Gmb 3.5% 30-09-2024    | 16.895.617,20              | 1,76                         |
|   |              |                            |                              | 17.005.000,00      | Nobel Bidco BV 3.125% 15-06-2028                | 16.601.131,25              | 1,73                         |
|   |              |                            |                              | 16.467.000,00      | Novelis Sheet Ingot GmbH 3.375% 15-04-2029      | 16.914.902,40              | 1,76                         |
|   |              |                            |                              | 6.036.000,00       | OI European Group BV 3.125% 15-11-2024          | 6.193.575,82               | 0,64                         |
|   |              |                            |                              | 16.821.000,00      | Organon & Co / Organon Forei 2.875% 30-04-2028  | 16.931.177,55              | 1,76                         |
|   |              |                            |                              | 15.601.000,00      | PPF Telecom Group BV 3.25% 29-09-2027           | 16.722.711,90              | 1,74                         |
|   |              |                            |                              | 16.645.000,00      | ProGroup AG 3% 31-03-2026                       | 16.832.256,25              | 1,75                         |
|   |              |                            |                              | 13.563.000,00      | PVH Corp 3.125% 15-12-2027                      | 15.073.592,69              | 1,57                         |
|   |              |                            |                              | 7.655.000,00       | Q-Park Holding I BV 2% 01-03-2027               | 7.218.052,60               | 0,75                         |
|   |              |                            |                              | 10.000.000,00      | Q-Park Holding I BV FRN 01-03-2026              | 9.662.492,30               | 1,01                         |
|   |              |                            |                              | 10.800.000,00      | RCI Banque SA 2.625% MULTI 18-02-2030           | 10.821.988,80              | 1,13                         |
|   |              |                            |                              | 5.800.000,00       | Renault SA 2.375% 25-05-2026                    | 5.837.584,00               | 0,61                         |
|   |              |                            |                              | 16.927.000,00      | Rexel SA 2.125% 15-12-2028                      | 17.012.989,16              | 1,77                         |
|   |              |                            |                              | 400.000,00         | SoftBank Group Corp 3.375% 06-07-2029           | 372.080,00                 | 0,04                         |
|   |              |                            |                              | 15.856.000,00      | SoftBank Group Corp 5% 15-04-2028               | 16.292.040,00              | 1,70                         |
|   |              |                            |                              | 16.200.000,00      | SPIE SA 2.625% 18-06-2026                       | 16.787.250,00              | 1,75                         |
|   |              |                            |                              | 16.980.000,00      | Techem Verwaltungsgesellscha 2% 15-07-2025      | 16.788.975,00              | 1,75                         |
|   |              |                            |                              | 5.976.000,00       | Telecom Italia SpA/Milano 2.375% 12-10-2027     | 5.886.360,00               | 0,61                         |
|   |              |                            |                              | 1.432.000,00       | Telecom Italia SpA/Milano 2.5% 19-07-2023       | 1.464.220,00               | 0,15                         |
|   |              |                            |                              | 6.540.000,00       | Telecom Italia SpA/Milano 2.875% 28-01-2026     | 6.678.059,40               | 0,70                         |
|   |              |                            |                              | 2.735.000,00       | Telecom Italia SpA/Milano 4% 11-04-2024         | 2.864.912,50               | 0,30                         |
|   |              |                            |                              | 1.400.000,00       | Telecom Italia SpA/Milano 5.25% 17-03-2055      | 1.470.660,80               | 0,15                         |
|   |              |                            |                              | 15.200.000,00      | Telefonica Europe BV 4.375% MULTI Perp FC2024   | 16.322.520,00              | 1,70                         |
|   |              |                            |                              | 200.000,00         | Telefonica Europe BV 5.875% MULTI Perp FC2024   | 219.250,00                 | 0,02                         |
|   |              |                            |                              | 6.212.000,00       | Teollisuuden Voima Oyj 1.125% 09-03-2026        | 6.181.374,84               | 0,64                         |
|   |              |                            |                              | 9.681.000,00       | Teollisuuden Voima Oyj 2.125% 04-02-2025        | 10.062.276,50              | 1,05                         |
|   |              |                            |                              | 4.785.000,00       | Teva Pharmaceutical Finance 1.25% 31-03-2023    | 4.759.888,32               | 0,50                         |
|   |              |                            |                              | 2.968.000,00       | Teva Pharmaceutical Finance 1.625% 15-10-2028   | 2.582.160,00               | 0,27                         |
|   |              |                            |                              | 2.775.000,00       | Teva Pharmaceutical Finance 6% 31-01-2025       | 2.982.325,80               | 0,31                         |
|   |              |                            |                              | 8.110.000,00       | Verisure Holding AB 3.25% 15-02-2027            | 8.079.587,50               | 0,84                         |
|   |              |                            |                              | 6.450.000,00       | Verisure Holding AB 3.875% 15-07-2026           | 6.562.875,00               | 0,68                         |
|   |              |                            |                              | 1.858.000,00       | Verisure Holding AB FRN 15-04-2025              | 1.883.547,50               | 0,20                         |
|   |              |                            |                              | 5.867.000,00       | Vodafone Group PLC 2.625% MULTI 27-08-2080      | 5.969.672,50               | 0,62                         |
|   |              |                            |                              | 7.007.000,00       | Vodafone Group PLC 3.000% MULTI 27-08-2080      | 7.059.832,78               | 0,73                         |
|   |              |                            |                              | 16.800.000,00      | Volkswagen Internation 2.500% MULTI Perp FC2022 | 16.859.808,00              | 1,75                         |
|   |              |                            |                              | 16.310.000,00      | WVG Acquisition Corp 2.75% 15-07-2028           | 16.728.481,98              | 1,74                         |
|   |              |                            |                              | 4.000.000,00       | ZF Finance GmbH 3% 21-09-2025                   | 4.180.000,00               | 0,44                         |
|   |              |                            |                              | 11.900.000,00      | ZF Finance GmbH 3.75% 21-09-2028                | 12.822.250,00              | 1,33                         |
|   |              |                            |                              |                    |   | <b>847.083.406,72</b>      | <b>88,18</b>                 |
|   |              |                            |                              | <b>GBP</b>         |   |                            |                              |
|   |              |                            |                              | 13.958.000,00      | B&M European Value Retail SA 4% 15-11-2028      | 16.657.061,19              | 1,73                         |
|   |              |                            |                              | 15.011.000,00      | Bellis Acquisition Co PLC 3.25% 16-02-2026      | 17.176.583,45              | 1,79                         |
|   |              |                            |                              | 4.157.000,00       | FCE Bank PLC 2.727% 03-06-2022                  | 4.985.582,25               | 0,52                         |
|   |              |                            |                              | 14.344.000,00      | Pinewood Finance Co Ltd 3.25% 30-09-2025        | 17.063.813,34              | 1,78                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Cross Credit Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 13.760.000,00      | Tesco Property Finance 2 PLC<br>6.0517% 13-10-2039  | 16.691.505,84              | 1,74                         |
| 5.215.000,00       | Virgin Media Secured Finance<br>4.25% 15-01-2030  | 6.138.253,10               | 0,64                         |
| 8.752.000,00       | Virgin Media Secured Finance 5%<br>15-04-2027   | 10.717.961,30              | 1,12                         |
|                    | <b>USD</b>  | <b>89.430.760,47</b>       | <b>9,31</b>                  |
| 3.800.000,00       | Vodafone Group PLC 6.250%<br>MULTI 03-10-2078   | 3.586.087,50               | 0,37                         |
|                    |   | <b>3.586.087,50</b>        | <b>0,37</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>940.100.254,69</b>      | <b>97,86</b>                 |
|                    | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>940.100.254,69</b>      | <b>97,86</b>                 |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 14.945.000,00      | Elior Group SA 3.75% 15-07-2026   | 15.277.526,25              | 1,59                         |
|                    |   | <b>15.277.526,25</b>       | <b>1,59</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>15.277.526,25</b>       | <b>1,59</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>15.277.526,25</b>       | <b>1,59</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>955.377.780,94</b>      | <b>99,45</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>158.590,68</b>          | <b>0,02</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>5.141.880,52</b>        | <b>0,54</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>960.678.252,14</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Cross Credit Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| USA                    | 18,96        | Unternehmensanleihen | 99,45        |
| Frankreich             | 16,89        |                      |              |
| Niederlande            | 13,93        |                      |              |
| Vereinigtes Königreich | 12,81        |                      |              |
| Deutschland            | 12,35        |                      |              |
| Italien                | 8,87         |                      |              |
| Spanien                | 5,26         |                      |              |
| Länderübergreifend     | 1,76         |                      |              |
| Portugal               | 1,74         |                      |              |
| Japan                  | 1,73         |                      |              |
| Luxemburg              | 1,73         |                      |              |
| Schweden               | 1,72         |                      |              |
| Finnland               | 1,69         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>99,45</b> |                      |              |
|                        |              | <b>Summe</b>         | <b>99,45</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - European Cross Credit Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 832.296,35  | EUR               | 8.490.076,23       | NOK                | (17.187,20)  | 28.01.2022 |
| 796.249,79  | EUR               | 8.180.482,02       | SEK                | (1.434,81)   | 28.01.2022 |
| 514.629.172,41                                    | NOK               | 51.023.784,40      | EUR                | 467.687,92   | 28.01.2022 |
| 407.783.216,53                                    | SEK               | 40.259.033,17      | EUR                | (496.094,50)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(47.028,59)</b>   |            |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                   |                    |                    |  |            |
| 466.000,00  | USD               | 410.806,25         | EUR                | 215,50   | 18.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>215,50</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                   |                    |                    |  |            |
| 17.574.411,66                                     | EUR               | 20.020.000,00      | USD                | (83.714,34)  | 18.02.2022 |
| 433.000,00  | GBP               | 513.569,56         | EUR                | 1.286,38   | 18.02.2022 |
| 7.250.000,00                                      | USD               | 6.453.198,42       | EUR                | (58.602,72)  | 18.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(141.030,68)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                   |                    |                    |  |            |
| 88.780.204,64                                     | EUR               | 75.030.000,00      | GBP                | (433.939,06)   | 18.02.2022 |
| 8.147.000,00                                      | USD               | 7.214.825,44       | EUR                | (29.030,65)  | 18.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(462.969,71)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                   |                    |                    |  |            |
| 159.292,79  | EUR               | 135.000,00         | GBP                | (1.228,87)   | 18.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(1.228,87)</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(605.013,76)</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(652.042,35)</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.







# Nordea 1 - European Financial Debt Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>       |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 9.750.000,00       | Banca Popolare di Sondr 3.875% MULTI 25-02-2032                         | 9.750.000,00               | 0,75                         |
|                    |   | <b>9.750.000,00</b>        | <b>0,75</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>9.750.000,00</b>        | <b>0,75</b>                  |
|                    | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>9.750.000,00</b>        | <b>0,75</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>1.230.433.796,16</b>    | <b>94,49</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>73.482.863,32</b>       | <b>5,64</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>                                  | <b>(1.792.440,66)</b>      | <b>(0,14)</b>                |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>1.302.124.218,82</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Financial Debt Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| Italien                | 22,12        | Unternehmensanleihen | 94,49        |
| Spanien                | 16,26        |                      |              |
| Niederlande            | 16,16        | <b>Summe</b>         | <b>94,49</b> |
| Irland                 | 12,96        |                      |              |
| Vereinigtes Königreich | 9,59         |                      |              |
| Frankreich             | 9,28         |                      |              |
| Österreich             | 3,99         |                      |              |
| Japan                  | 2,08         |                      |              |
| Deutschland            | 1,44         |                      |              |
| Belgien                | 0,50         |                      |              |
| Dänemark               | 0,08         |                      |              |
| USA                    | 0,04         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>94,49</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - European Financial Debt Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|---|------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                   |                    |                    |   |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |   |            |
| 18.102.689,15                                     | CHF               | 17.263.047,13      | EUR                | 265.630,28  | 28.01.2022 |
| 477.437,70  | EUR               | 498.665,67         | CHF                | (5.414,94)  | 28.01.2022 |
| 35.359,98   | EUR               | 54.888,66          | SGD                | (521,82)  | 28.01.2022 |
| 11.121.461,72                                     | EUR               | 12.582.814,08      | USD                | 18.439,23   | 28.01.2022 |
| 4.726.811,18                                      | SGD               | 3.067.915,57       | EUR                | 22.081,76   | 28.01.2022 |
| 164.286.698,42                                    | USD               | 145.841.000,35     | EUR                | (875.430,29)  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(575.215,78)</b>   |            |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                   |                    |                    |   |            |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                   |                    |                    |   |            |
| 18.417.180,02                                     | EUR               | 15.500.000,00      | GBP                | (22.723,58)   | 28.01.2022 |
| 265.078.339,19                                    | EUR               | 311.788.000,00     | USD                | (10.047.474,88)   | 28.01.2022 |
| 1.575.000,00                                      | GBP               | 1.857.004,52       | EUR                | 16.735,02   | 28.01.2022 |
| 23.234.000,00                                     | USD               | 20.476.506,58      | EUR                | 25.108,18   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(10.028.355,26)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                   |                    |                    |   |            |
| 134.565.912,94                                    | EUR               | 115.452.000,00     | GBP                | (2.785.348,19)  | 28.01.2022 |
| 5.717.000,00                                      | USD               | 4.913.973,66       | EUR                | 130.754,57  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(2.654.593,62)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                  |                   |                    |                    |   |            |
| 28.844.000,00                                     | USD               | 24.934.359,72      | EUR                | 517.752,43  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>517.752,43</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>           |                   |                    |                    |   |            |
| 4.102.866,05                                      | EUR               | 3.512.000,00       | GBP                | (75.295,19)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(75.295,19)</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(12.240.491,64)</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(12.815.707,42)</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Credit Default Swaps

| Basiswert   | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal         | Währung | Kosten (EUR)        | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)     | Fälligkeit |
|---|--------------|-----------------|-----------------|---------|---------------------|---|---------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>                         |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| Lloyds Banking Group PLC 4.5% 04-11-2024                              | Kauf         | 1,00%           | 5.000.000,00    | EUR     | 81.709,46           | (143.550,16)  | (61.840,70)         | 20.12.2025 |
| NatWest Group plc (No ref obligation)                                 | Kauf         | 1,00%           | 15.000.000,00   | EUR     | 245.427,30          | (401.257,80)  | (155.830,50)        | 20.12.2025 |
|   |              |                 |                 |         | <b>327.136,76</b>   | <b>(544.807,96)</b>                                 | <b>(217.671,20)</b> |            |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                                    |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, SOCIEDAD ANONIMA (No ref obligation) | Verkauf      | 1,00%           | (27.000.000,00) | EUR     | (433.438,67)        | 133.027,22  | (300.411,45)        | 20.06.2026 |
| Barclays PLC 4.375% 11-09-2024  | Kauf         | 1,00%           | 15.300.000,00   | EUR     | 1.450.148,67        | (1.625.114,27)                                      | (174.965,60)        | 20.12.2023 |
| Barclays PLC 4.375% 11-09-2024  | Kauf         | 1,00%           | 10.500.000,00   | EUR     | 626.241,82          | (746.316,25)  | (120.074,43)        | 20.12.2023 |
| Barclays PLC 4.375% 11-09-2024  | Kauf         | 1,00%           | 10.000.000,00   | EUR     | 186.353,50          | (279.554,00)  | (93.200,50)         | 20.12.2025 |
| Barclays PLC 4.375% 11-09-2024  | Kauf         | 1,00%           | 10.000.000,00   | EUR     | 202.319,26          | (295.519,76)  | (93.200,50)         | 20.12.2025 |
| DANSKE BANK A/S (No ref obligation)                                   | Verkauf      | 1,00%           | (8.300.000,00)  | EUR     | 464.784,77          | (175.904,76)  | 288.880,01          | 20.12.2027 |
| Lloyds Banking Group PLC 4.5% 04-11-2024                              | Kauf         | 1,00%           | 11.200.000,00   | EUR     | 204.331,51          | (356.559,11)  | (152.227,60)        | 20.06.2024 |
| Lloyds Banking Group PLC 4.5% 04-11-2024                              | Kauf         | 1,00%           | 8.800.000,00    | EUR     | 280.244,86          | (399.852,26)  | (119.607,40)        | 20.06.2024 |
| NatWest Group plc (No ref obligation)                                 | Kauf         | 1,00%           | 5.000.000,00    | EUR     | 88.607,94           | (140.551,44)  | (51.943,50)         | 20.12.2025 |
| UBS AG (No ref obligation)  | Verkauf      | 1,00%           | (2.500.000,00)  | EUR     | 73.841,11           | 21.856,67   | 95.697,78           | 20.06.2028 |
|   |              |                 |                 |         | <b>3.143.434,77</b> | <b>(3.864.487,96)</b>                               | <b>(721.053,19)</b> |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Financial Debt Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert  | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal         | Währung | Kosten (EUR)          | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)       | Fälligkeit |
|--|--------------|-----------------|-----------------|---------|-----------------------|---|-----------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>    |              |                 |                 |         |                       |   |                       |            |
| Lloyds Banking Group PLC 4.5% 04-11-2024         | Kauf         | 1,00%           | 15.000.000,00   | EUR     | 253.014,42            | (438.536,52)  | (185.522,10)          | 20.12.2025 |
| Lloyds Banking Group PLC 4.5% 04-11-2024         | Kauf         | 1,00%           | 10.000.000,00   | EUR     | 172.304,98            | (295.986,38)  | (123.681,40)          | 20.12.2025 |
|  |              |                 |                 |         | <b>425.319,40</b>     | <b>(734.522,90)</b>                                 | <b>(309.203,50)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |              |                 |                 |         |                       |   |                       |            |
| ITRAXX-FINSUBS34V1-5Y                            | Verkauf      | 1,00%           | (45.000.000,00) | EUR     | (832.914,40)          | 1.109.425,23  | 276.510,83            | 20.12.2025 |
| ITRAXX-FINSUBS34V1-5Y                            | Verkauf      | 1,00%           | (20.000.000,00) | EUR     | (435.810,83)          | 558.704,53  | 122.893,70            | 20.12.2025 |
| ITRAXX-FINSUBS34V1-5Y                            | Verkauf      | 1,00%           | (5.000.000,00)  | EUR     | (108.891,67)          | 139.615,10  | 30.723,43             | 20.12.2025 |
|  |              |                 |                 |         | <b>(1.377.616,90)</b> | <b>1.807.744,86</b>                                 | <b>430.127,96</b>     |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |              |                 |                 |         |                       |   |                       |            |
| Barclays PLC 4.375% 11-09-2024                   | Kauf         | 1,00%           | 5.300.000,00    | EUR     | 194.421,19            | (257.224,55)  | (62.803,36)           | 20.06.2024 |
| DANSKE BANK A/S (No ref obligation)              | Verkauf      | 1,00%           | (2.500.000,00)  | EUR     | 62.053,91             | 27.841,62   | 89.895,53             | 20.06.2028 |
| HSBC HOLDINGS plc (No ref obligation)            | Kauf         | 1,00%           | 27.050.000,00   | EUR     | 53.084,09             | (240.178,93)  | (187.094,84)          | 20.12.2026 |
| Standard Chartered PLC 5.2% 26-01-2024           | Verkauf      | 1,00%           | (27.050.000,00) | EUR     | (487.042,98)          | 306.864,01  | (180.178,97)          | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>(177.483,79)</b>   | <b>(162.697,85)</b>                                 | <b>(340.181,64)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |              |                 |                 |         |                       |   |                       |            |
| Lloyds Banking Group PLC 4.5% 04-11-2024         | Kauf         | 1,00%           | 11.200.000,00   | EUR     | 65.800,91             | (218.028,44)  | (152.227,53)          | 20.06.2024 |
| UBS AG (No ref obligation)                       | Verkauf      | 1,00%           | (8.300.000,00)  | EUR     | 490.398,59            | (185.252,74)  | 305.145,85            | 20.12.2027 |
|  |              |                 |                 |         | <b>556.199,50</b>     | <b>(403.281,18)</b>                                 | <b>152.918,32</b>     |            |
|  |              |                 |                 |         | <b>2.896.989,74</b>   | <b>(3.902.052,99)</b>                               | <b>(1.005.063,25)</b> |            |

## Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|-------------------------------|--------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                               |                          |   |  |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | 739,00                        | 98.464.360,00            | 0,00  | (772.105,93)   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (624,00)                      | (106.934.880,00)         | 0,00  | 1.912.600,56   |
| EURO-SCHATZ FUT 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | 3.964,00                      | 444.136.470,00           | 49.550,00   | (624.332,16)   |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022 | GBP     | (1.204,00)                    | (150.415.720,00)         | (214.985,19)  | 699.074,41   |
| US 2YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | 129,00                        | 28.150.219,52            | 5.339,27  | (36.220,10)  |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (1.766,00)                    | (213.727.382,68)         | (73.078,55)   | (660.985,45)   |
| US LONG BOND(CBT) 3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (228,00)                      | (36.522.750,00)          | (62.905,58)   | (351.716,10)   |
|  |            |         |                               |                          | <b>(296.080,05)</b>   | <b>166.315,23</b>  |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 260.000,00 EUR erhalten.  
 BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 740.000,00 EUR erhalten.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 310.000,00 EUR erhalten.  
 Deutsche Bank AG hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 310.000,00 EUR gezahlt.  
 Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 390.000,00 EUR erhalten.  
 J.P. Morgan SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 160.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapiieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>CHF</b>  |  |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 7.425.000,00  | Dufry One BV 3.625% 15-04-2026                 | 7.146.665,57               | 0,16                         | 31.288.000,00      | CRC Breeze Finance SA 5.29% 08-05-2026         | 8.470.287,36               | 0,19                         |
| 11.955.000,00   | Teva Pharmaceutical Finance 1% 28-07-2025      | 10.700.146,87              | 0,24                         | 13.100.000,00      | DEMIRE Deutsche Mittelstand 1.875% 15-10-2024  | 12.867.868,00              | 0,29                         |
|   |  | <b>17.846.812,44</b>       | <b>0,41</b>                  | 74.265.000,00      | DKT Finance ApS 7% 17-06-2023                  | 75.111.621,00              | 1,72                         |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              | 58.090.000,00      | Dufry One BV 2% 15-02-2027                     | 53.805.862,50              | 1,23                         |
| 24.700.000,00   | ABN AMRO Bank NV 4.375% MULTI Perp FC2025      | 26.429.000,00              | 0,61                         | 14.075.000,00      | Dufry One BV 3.375% 15-04-2028                 | 13.582.375,00              | 0,31                         |
| 43.800.000,00   | ABN AMRO Bank NV 4.750% MULTI Perp FC2027      | 47.423.223,60              | 1,09                         | 15.355.000,00      | eircom Finance DAC 2.625% 15-02-2027           | 15.064.022,75              | 0,34                         |
| 16.900.000,00   | ADLER Group SA 1.875% 14-01-2026               | 14.153.750,00              | 0,32                         | 26.007.000,00      | eircom Finance DAC 3.5% 15-05-2026             | 26.397.105,00              | 0,60                         |
| 10.700.000,00   | ADLER Group SA 2.25% 14-01-2029                | 8.854.250,00               | 0,20                         | 28.314.000,00      | Energia Group NI FinanceCo P 4% 15-09-2025     | 28.420.177,50              | 0,65                         |
| 9.700.000,00  | ADLER Real Estate AG 3% 27-04-2026             | 8.899.750,00               | 0,20                         | 24.600.000,00      | Energizer Gamma Acquisition 3.5% 30-06-2029    | 23.739.000,00              | 0,54                         |
| 38.814.000,00   | Aegon NV 5.625% MULTI Perp FC2029              | 45.878.148,00              | 1,05                         | 18.375.000,00      | Fastighets AB Balder 2.873% MULTI 02-06-2081   | 17.507.700,00              | 0,40                         |
| 19.156.000,00   | Ahlstrom-Munksjo Holding 3 O 3.625% 04-02-2028 | 19.161.746,80              | 0,44                         | 11.522.000,00      | Faurecia SE 2.375% 15-06-2027                  | 11.550.805,00              | 0,26                         |
| 12.800.000,00   | Allianz SE 2.625% MULTI Perp FC2030            | 12.699.699,20              | 0,29                         | 8.300.000,00       | Flamingo Lux II SCA 5% 31-03-2029              | 8.082.125,00               | 0,19                         |
| 29.625.000,00   | Allied Universal Holdco LLC/ 3.625% 01-06-2028 | 28.928.812,50              | 0,66                         | 39.550.000,00      | Foncia Management SASU 3.375% 31-03-2028       | 38.836.438,90              | 0,89                         |
| 6.122.000,00  | Altice Financing SA 3% 15-01-2028              | 5.796.125,94               | 0,13                         | 12.500.000,00      | Gestamp Automocion SA 3.25% 30-04-2026         | 12.567.250,00              | 0,29                         |
| 16.925.000,00   | Altice Financing SA 4.25% 15-08-2029           | 16.535.725,00              | 0,38                         | 33.125.000,00      | Grifols Escrow Issuer SA 3.875% 15-10-2028     | 33.239.082,50              | 0,76                         |
| 14.110.000,00   | Altice France SA/France 2.125% 15-02-2025      | 13.721.579,92              | 0,31                         | 52.395.000,00      | Grifols SA 3.2% 01-05-2025                     | 52.367.859,39              | 1,20                         |
| 5.949.000,00  | Altice France SA/France 2.5% 15-01-2025        | 5.859.765,00               | 0,13                         | 22.045.000,00      | Grupo Antolin-Irausa SA 3.375% 30-04-2026      | 21.383.650,00              | 0,49                         |
| 85.791.000,00   | Altice France SA/France 3.375% 15-01-2028      | 83.418.878,85              | 1,91                         | 26.700.000,00      | Grupo Antolin-Irausa SA 3.5% 30-04-2028        | 25.098.000,00              | 0,57                         |
| 3.350.000,00  | Altice France SA/France 4.125% 15-01-2029      | 3.324.875,00               | 0,08                         | 45.700.000,00      | Guala Closures SpA 3.25% 15-06-2028            | 44.786.000,00              | 1,03                         |
| 25.550.000,00   | APCOA Parking Holdings GmbH 4.625% 15-01-2027  | 25.294.500,00              | 0,58                         | 35.725.000,00      | Heimstaden Bostad AB 3.000% MULTI Perp FC2027  | 34.153.100,00              | 0,78                         |
| 7.825.000,00  | APCOA Parking Holdings GmbH FRN 15-01-2027     | 7.856.300,00               | 0,18                         | 5.667.850,00       | HELIX HOLDCO SA                                | 136.391,82                 | 0,00                         |
| 23.115.000,00   | Arena Luxembourg Finance Sar 1.875% 01-02-2028 | 21.785.887,50              | 0,50                         | 26.459.000,00      | House of Finance NV/The 4.375% 15-07-2026      | 26.763.278,50              | 0,61                         |
| 12.452.000,00   | Axalta Coating Systems Dutch 3.75% 15-01-2025  | 12.524.595,16              | 0,29                         | 2.775.000,00       | House of HR 7.5% 15-01-2027                    | 2.913.750,00               | 0,07                         |
| 18.450.000,00   | Bach Bidco SpA FRN 15-10-2028                  | 18.579.519,00              | 0,43                         | 18.840.641,00      | IHO Verwaltungs GmbH 3.75% P-I-K 15-09-2026    | 19.128.902,81              | 0,44                         |
| 30.000.000,00   | Banjay Entertainment SASU 3.5% 01-03-2025      | 30.112.500,00              | 0,69                         | 45.299.949,00      | IHO Verwaltungs GmbH 3.875% P-I-K 15-05-2027   | 46.205.947,98              | 1,06                         |
| 40.253.000,00   | Belden Inc 3.375% 15-07-2027                   | 40.715.506,97              | 0,93                         | 8.375.000,00       | IMA Industria Macchine Autom FRN 15-01-2028    | 8.375.000,00               | 0,19                         |
| 9.275.000,00  | Belden Inc 3.375% 15-07-2031                   | 9.517.541,25               | 0,22                         | 16.277.000,00      | International Design Group S 6.5% 15-11-2025   | 16.815.703,59              | 0,39                         |
| 26.431.000,00   | Belden Inc 3.875% 15-03-2028                   | 27.197.499,00              | 0,62                         | 24.335.000,00      | Intrum AB 3.125% 15-07-2024                    | 24.365.418,75              | 0,56                         |
| 17.814.000,00   | Belden Inc 4.125% 15-10-2026                   | 18.132.478,69              | 0,42                         | 27.925.000,00      | Intrum AB 3.5% 15-07-2026                      | 28.235.414,30              | 0,65                         |
| 8.250.000,00  | Brunello Bidco SpA 3.5% 15-02-2028             | 8.166.576,00               | 0,19                         | 17.975.000,00      | IQVIA Inc 2.25% 15-01-2028                     | 18.065.594,00              | 0,41                         |
| 20.975.000,00   | Burger King France SAS FRN 01-11-2026          | 21.237.187,50              | 0,49                         | 4.250.000,00       | IQVIA Inc 2.25% 15-03-2029                     | 4.232.787,50               | 0,10                         |
| 10.975.000,00   | CAB SELAS 3.375% 01-02-2028                    | 10.952.896,35              | 0,25                         | 5.575.000,00       | IQVIA Inc 2.875% 15-06-2028                    | 5.713.929,00               | 0,13                         |
| 8.800.000,00  | Castellum AB 3.125% MULTI Perp FC2026          | 8.404.000,00               | 0,19                         | 16.025.000,00      | Jaguar Land Rover Automotive 4.5% 15-07-2028   | 16.308.898,90              | 0,37                         |
| 9.750.000,00  | Catalent Pharma Solutions In 2.375% 01-03-2028 | 9.725.625,00               | 0,22                         | 3.875.000,00       | Jaguar Land Rover Automotive 6.875% 15-11-2026 | 4.388.530,50               | 0,10                         |
| 12.636.000,00   | CeramTec BondCo GmbH 5.25% 15-12-2025          | 12.779.418,60              | 0,29                         | 2.950.000,00       | Jyske Bank A/S 3.625% MULTI Perp FC2028        | 2.962.537,50               | 0,07                         |
| 28.950.000,00   | Chrome Bidco SASU 3.5% 31-05-2028              | 29.167.125,00              | 0,67                         | 11.135.000,00      | Kaefer Isoliertechnik GmbH & 5.5% 10-01-2024   | 11.220.739,50              | 0,26                         |
| 17.325.000,00   | Chrome Holdco SASU 5% 31-05-2029               | 17.325.000,00              | 0,40                         | 12.800.000,00      | Kaico Bondco Telecom SA 5.125% 30-09-2029      | 12.870.169,60              | 0,29                         |
| 40.200.000,00   | Cooperatieve Rabobank 3.250% MULTI Perp FC2026 | 41.180.397,60              | 0,94                         | 16.236.000,00      | Kronos International Inc 3.75% 15-09-2025      | 16.432.228,30              | 0,38                         |
| 18.800.000,00   | Cooperatieve Rabobank 4.375% MULTI Perp FC2027 | 20.680.000,00              | 0,47                         | 11.750.000,00      | Laboratoire Eimer Selas 5% 01-02-2029          | 11.884.537,50              | 0,27                         |
| 27.875.000,00   | Coty Inc 3.875% 15-04-2026                     | 28.418.228,00              | 0,65                         | 29.066.000,00      | Lincoln Financing SARL 3.625% 01-04-2024       | 29.240.396,00              | 0,67                         |
| 27.694.000,00   | Coty Inc 4.75% 15-04-2026                      | 27.832.470,00              | 0,64                         | 8.675.000,00       | Lion/Polaris Lux 4 SA FRN 01-07-2026           | 8.729.218,75               | 0,20                         |
| 11.950.000,00   | CRC Breeze Finance SA 08-05-2026               | 1.360.107,61               | 0,03                         | 68.475.000,00      | Lorca Telecom Bondco SA 4% 18-09-2027          | 69.587.718,75              | 1,59                         |
|   |  |                            |                              | 16.085.512,00      | Mangrove Luxco III Sarl 09-10-2025             | 15.362.166,66              | 0,35                         |
|   |  |                            |                              | 13.934.000,00      | Matterhorn Telecom SA 3.125% 15-09-2026        | 13.877.567,30              | 0,32                         |
|   |  |                            |                              | 16.857.000,00      | Matterhorn Telecom SA 4% 15-11-2027            | 17.194.140,00              | 0,39                         |
|   |  |                            |                              | 7.950.000,00       | Max Two Ltd 5.7% 02-04-2024                    | 315.747,02                 | 0,01                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 18.450.000,00      | Maxeda DIY Holding BV 5.875% 01-10-2026        | 18.789.332,40              | 0,43                         | 5.801.000,00       | Trivium Packaging Finance BV FRN 15-08-2026     | 5.779.408,68               | 0,13                         |
| 10.125.000,00      | Monitchem HoldCo 3 SA 5.25% 15-03-2025         | 10.327.500,00              | 0,24                         | 20.000.000,00      | UPCB Finance VII Ltd 3.625% 15-06-2029          | 20.400.000,00              | 0,47                         |
| 3.824.000,00       | Motion Bondco DAC 4.5% 15-11-2027              | 3.646.520,51               | 0,08                         | 21.000.000,00      | Verde Bidco SpA 4.625% 01-10-2026               | 21.451.500,00              | 0,49                         |
| 38.595.000,00      | Motion Finco Sarl 7% 15-05-2025                | 40.331.775,00              | 0,92                         | 5.000.000,00       | Verisure Holding AB 3.25% 15-02-2027            | 4.981.250,00               | 0,11                         |
| 39.950.000,00      | NH Hotel Group SA 4% 02-07-2026                | 39.650.375,00              | 0,91                         | 16.025.000,00      | Verisure Holding AB 3.5% 15-05-2023             | 16.119.675,70              | 0,37                         |
| 80.922.000,00      | Nidda Healthcare Holding Gmb 3.5% 30-09-2024   | 80.709.984,36              | 1,85                         | 10.550.000,00      | Verisure Holding AB 3.875% 15-07-2026           | 10.734.625,00              | 0,25                         |
| 20.675.000,00      | Novelis Sheet Ingot GmbH 3.375% 15-04-2029     | 21.237.360,00              | 0,49                         | 3.700.000,00       | Verisure Holding AB FRN 15-04-2025              | 3.750.875,00               | 0,09                         |
| 28.325.000,00      | Olympus Water US Holding Cor 3.875% 01-10-2028 | 28.395.812,50              | 0,65                         | 82.425.000,00      | Verisure Midholding AB 5.25% 15-02-2029         | 83.489.766,15              | 1,91                         |
| 47.600.000,00      | Ontex Group NV 3.5% 15-07-2026                 | 45.229.520,00              | 1,04                         | 775.000,00         | Virgin Media Finance PLC 3.75% 15-07-2030       | 773.724,35                 | 0,02                         |
| 36.925.000,00      | Paganini Bidco SpA FRN 30-10-2028              | 37.083.777,50              | 0,85                         | 8.050.000,00       | Vmed O2 UK Financing I PLC 3.25% 31-01-2031     | 7.977.566,10               | 0,18                         |
| 21.950.000,00      | PCF GmbH 4.75% 15-04-2026                      | 22.635.937,50              | 0,52                         | 18.175.000,00      | Vodafone Group PLC 3.000% MULTI 27-08-2080      | 18.312.039,50              | 0,42                         |
| 12.380.000,00      | PCF GmbH FRN 15-04-2026                        | 12.559.980,44              | 0,29                         | 50.485.000,00      | VZ Vendor Financing II BV 2.875% 15-01-2029     | 48.781.131,25              | 1,12                         |
| 4.400.000,00       | Picard Bondco SA 5.375% 01-07-2027             | 4.422.000,00               | 0,10                         | 33.663.000,00      | WEPA Hygieneprodukte GmbH 2.875% 15-12-2027     | 31.910.840,85              | 0,73                         |
| 15.525.000,00      | Picard Groupe SAS 3.875% 01-07-2026            | 15.701.208,75              | 0,36                         | 11.746.000,00      | WEPA Hygieneprodukte GmbH FRN 15-12-2026        | 11.300.826,60              | 0,26                         |
| 5.925.000,00       | PrestigeBidCo GmbH 6.25% 15-12-2023            | 5.933.887,50               | 0,14                         | 9.575.000,00       | WMG Acquisition Corp 2.25% 15-08-2031           | 9.455.369,95               | 0,22                         |
| 48.975.000,00      | Primo Water Holdings Inc 3.875% 31-10-2028     | 49.954.500,00              | 1,14                         | 12.400.000,00      | Wp/ap Telecom Holdings III B 5.5% 15-01-2030    | 12.601.500,00              | 0,29                         |
| 49.117.000,00      | ProGroup AG 3% 31-03-2026                      | 49.669.566,25              | 1,14                         | 12.896.000,00      | Ziggo BV 2.875% 15-01-2030                      | 12.831.520,00              | 0,29                         |
| 20.050.000,00      | Q-Park Holding I BV 1.5% 01-03-2025            | 19.298.325,50              | 0,44                         |                    |   | <b>3.082.724.280,90</b>    | <b>70,58</b>                 |
| 16.325.000,00      | Q-Park Holding I BV 2% 01-03-2027              | 15.393.169,00              | 0,35                         |                    | <b>GBP</b>                                      |                            |                              |
| 7.725.000,00       | Q-Park Holding I BV FRN 01-03-2026             | 7.464.275,30               | 0,17                         | 22.025.000,00      | Allied Universal Holdco LLC/ 4.875% 01-06-2028  | 25.399.106,46              | 0,58                         |
| 20.775.000,00      | Renk AG/Frankfurt am Main 5.75% 15-07-2025     | 21.574.837,50              | 0,49                         | 16.812.000,00      | Arqiva Broadcast Finance PLC 6.75% 30-09-2023   | 20.263.068,80              | 0,46                         |
| 6.245.000,00       | SCIL IV LLC / SCIL USA Holdi 4.375% 01-11-2026 | 6.346.481,25               | 0,15                         | 13.400.000,00      | B&M European Value Retail SA 4% 15-11-2028      | 15.991.160,62              | 0,37                         |
| 25.954.199,00      | Selecta Group BV 01-04-2026                    | 26.298.092,14              | 0,60                         | 5.928.000,00       | Barclays PLC 6.375% MULTI Perp FC2025           | 7.638.831,07               | 0,17                         |
| 8.177.559,00       | Selecta Group BV 01-07-2026                    | 8.054.895,62               | 0,18                         | 6.700.000,00       | Barclays PLC 7.250% MULTI Perp FC2023           | 8.334.545,06               | 0,19                         |
| 2.564.800,00       | Selecta Group FinCo S.A. 01-10-2026            | 2.228.495,87               | 0,05                         | 27.375.000,00      | Constellation Automotive Fin 4.875% 15-07-2027  | 32.055.872,72              | 0,73                         |
| 5.129.599,00       | Selecta Group FinCo S.A. 01-10-2026            | 4.456.990,88               | 0,10                         | 20.100.000,00      | CPUK Finance Ltd 4.875% 28-08-2025              | 23.926.923,62              | 0,55                         |
| 15.150.000,00      | SoftBank Group Corp 2.875% 06-01-2027          | 14.354.625,00              | 0,33                         | 2.100.000,00       | CPUK Finance Ltd 6.5% 28-08-2026                | 2.601.070,87               | 0,06                         |
| 19.328.000,00      | SoftBank Group Corp 3.125% 19-09-2025          | 19.328.000,00              | 0,44                         | 11.535.000,00      | Galaxy Bidco Ltd 6.5% 31-07-2026                | 14.129.154,77              | 0,32                         |
| 59.275.000,00      | SoftBank Group Corp 3.375% 06-07-2029          | 55.137.605,00              | 1,26                         | 28.332.000,00      | Heathrow Finance PLC 5.25% 01-03-2024           | 34.443.066,45              | 0,79                         |
| 13.065.000,00      | SoftBank Group Corp 4% 19-09-2029              | 12.637.251,90              | 0,29                         | 19.901.000,00      | Heathrow Finance PLC 6.25% 03-03-2025           | 25.078.271,23              | 0,57                         |
| 17.952.000,00      | SoftBank Group Corp 4.5% 20-04-2025            | 18.670.080,00              | 0,43                         | 7.003.000,00       | Heathrow Finance PLC MULTI 01-03-2027           | 8.220.489,00               | 0,19                         |
| 12.800.000,00      | SoftBank Group Corp 5% 15-04-2028              | 13.152.000,00              | 0,30                         | 19.691.000,00      | Heathrow Finance PLC MULTI 01-09-2029           | 23.053.291,52              | 0,53                         |
| 39.722.000,00      | Spectrum Brands Inc 4% 01-10-2026              | 40.514.136,12              | 0,93                         | 28.900.000,00      | Legal & General Group 5.625% MULTI Perp FC2031  | 37.885.634,93              | 0,87                         |
| 20.619.000,00      | Sunshine Mid BV 6.5% 15-05-2026                | 21.134.887,38              | 0,48                         | 4.022.000,00       | Lloyds Banking Group P 5.125% MULTI Perp FC2024 | 4.967.306,72               | 0,11                         |
| 20.303.000,00      | Techem Verwaltungsgesellscha 2% 15-07-2025     | 20.074.591,25              | 0,46                         | 9.582.000,00       | Moto Finance PLC 4.5% 01-10-2022                | 11.206.746,07              | 0,26                         |
| 8.675.000,00       | Teva Pharmaceutical Finance 1.625% 15-10-2028  | 7.547.250,00               | 0,17                         | 8.750.000,00       | Nationwide Building So 5.750% MULTI Perp FC2027 | 11.249.225,28              | 0,26                         |
| 9.859.000,00       | Teva Pharmaceutical Finance 1.875% 31-03-2027  | 9.045.632,50               | 0,21                         | 12.200.000,00      | Natwest Group PLC 4.500% MULTI Perp FC2028      | 14.450.195,32              | 0,33                         |
| 4.475.000,00       | Teva Pharmaceutical Finance 4.5% 01-03-2025    | 4.637.218,75               | 0,11                         | 14.385.000,00      | Natwest Group PLC 5.125% MULTI Perp FC2027      | 17.958.606,97              | 0,41                         |
| 7.538.000,00       | Teva Pharmaceutical Finance 6% 31-01-2025      | 8.101.179,06               | 0,19                         | 6.000.000,00       | Pinewood Finance Co Ltd 3.625% 15-11-2027       | 7.111.295,97               | 0,16                         |
| 41.425.000,00      | TI Automotive Finance PLC 3.75% 15-04-2029     | 41.787.468,75              | 0,96                         | 33.907.000,00      | Pinnacle Bidco PLC 6.375% 15-02-2025            | 40.734.033,29              | 0,93                         |
| 10.425.000,00      | TK Elevator Holdco GmbH 6.625% 15-07-2028      | 9.883.206,50               | 0,23                         | 41.025.000,00      | TalkTalk Telecom Group Ltd 3.875% 20-02-2025    | 46.448.334,22              | 1,06                         |
| 42.500.000,00      | TK Elevator Midco GmbH 4.375% 15-07-2027       | 43.876.490,00              | 1,00                         | 16.474.000,00      | TVL Finance PLC FRN 15-07-2025                  | 18.703.566,08              | 0,43                         |
| 13.200.000,00      | TK Elevator Midco GmbH FRN 15-07-2027          | 13.325.400,00              | 0,31                         |                    |   |                            |                              |
| 32.702.000,00      | Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15-08-2026  | 33.083.305,32              | 0,76                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - European High Yield Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |       |
|------------------------|--------------|----------------------|-------|
| Vereinigtes Königreich | 14,09        | Unternehmensanleihen | 95,20 |
| Niederlande            | 12,87        |                      |       |
| Deutschland            | 12,38        |                      |       |
| USA                    | 8,99         |                      |       |
| Frankreich             | 7,52         |                      |       |
| Spanien                | 6,11         |                      |       |
| Luxemburg              | 5,75         |                      |       |
| Schweden               | 5,64         |                      |       |
| Italien                | 5,62         |                      |       |
| Japan                  | 3,05         |                      |       |
| Schweiz                | 2,82         |                      |       |
| Irland                 | 2,61         |                      |       |
| Dänemark               | 2,40         |                      |       |
| Belgien                | 1,72         |                      |       |
| Jersey                 | 1,37         |                      |       |
| Länderübergreifend     | 1,24         |                      |       |
| Kaimaninseln           | 0,47         |                      |       |
| Finnland               | 0,44         |                      |       |
| Norwegen               | 0,13         |                      |       |
| <b>Summe</b>           | <b>95,20</b> |                      |       |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - European High Yield Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|---|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |   |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |   |            |
| 58.213.666,58                                     | CHF               | 55.506.493,59      | EUR                | 861.300,15  | 28.01.2022 |
| 8.776.797,82                                      | EUR               | 9.147.318,01       | CHF                | (80.443,54)   | 28.01.2022 |
| 1.471.960,04                                      | EUR               | 1.248.536,01       | GBP                | (13.393,26)   | 28.01.2022 |
| 5.482.397,21                                      | EUR               | 55.005.395,99      | NOK                | (21.179,69)   | 28.01.2022 |
| 9.124.960,51                                      | EUR               | 93.583.613,35      | SEK                | (435,62)  | 28.01.2022 |
| 20.866.011,71                                     | EUR               | 23.592.308,98      | USD                | 48.263,99   | 28.01.2022 |
| 87.909.193,18                                     | GBP               | 104.246.747,36     | EUR                | 336.394,46  | 28.01.2022 |
| 247.792.116,05                                    | NOK               | 24.567.800,90      | EUR                | 225.159,87  | 28.01.2022 |
| 2.650.372.968,83                                  | SEK               | 261.650.825,91     | EUR                | (3.212.969,77)  | 28.01.2022 |
| 466.094.653,28                                    | USD               | 413.764.965,30     | EUR                | (2.485.917,32)  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(4.343.220,73)</b>   |            |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                   |                    |                    |   |            |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                   |                    |                    |   |            |
| 28.426.000,00                                     | GBP               | 33.355.261,11      | EUR                | 428.203,85  | 08.03.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>428.203,85</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                   |                    |                    |   |            |
| 17.655.959,37                                     | EUR               | 18.383.000,00      | CHF                | (147.905,02)  | 08.03.2022 |
| 682.309.264,35                                    | EUR               | 582.600.000,00     | GBP                | (10.095.335,98)   | 08.03.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(10.243.241,00)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                   |                    |                    |   |            |
| 254.554.450,20                                    | EUR               | 288.120.000,00     | USD                | 523.439,14  | 08.03.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>523.439,14</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>           |                   |                    |                    |   |            |
| 3.450.000,00                                      | GBP               | 4.096.170,97       | EUR                | 3.993,06  | 08.03.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>3.993,06</b>   |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(9.287.604,95)</b>   |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(13.630.825,68)</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Credit Default Swaps

| Basiswert  | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal         | Währung | Kosten (EUR)         | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)      | Fälligkeit |
|--|--------------|-----------------|-----------------|---------|----------------------|---|----------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |              |                 |                 |         |                      |   |                      |            |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (50.000.000,00) | EUR     | 5.446.406,06         | 490.535,34  | 5.936.941,40         | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>5.446.406,06</b>  | <b>490.535,34</b>                                   | <b>5.936.941,40</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |              |                 |                 |         |                      |   |                      |            |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (80.000.000,00) | EUR     | 9.457.629,48         | 41.476,68   | 9.499.106,16         | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>9.457.629,48</b>  | <b>41.476,68</b>                                    | <b>9.499.106,16</b>  |            |
|  |              |                 |                 |         | <b>14.904.035,54</b> | <b>532.012,02</b>                                   | <b>15.436.047,56</b> |            |

BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 6.020.000,00 EUR gezahlt.  
Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 9.610.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European High Yield Credit Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 500.000,00  | Abanca Corp Bancaria SA 4.625% MULTI 07-04-2030 | 531.875,00                 | 0,19                         | 1.100.000,00       | Credit Agricole Assurances S 2% 17-07-2030      | 1.135.607,00               | 0,41                         |
| 1.800.000,00  | Abanca Corp Bancaria SA 6.125% MULTI 18-01-2029 | 1.946.250,00               | 0,70                         | 500.000,00         | Crown European Holdings SA 2.875% 01-02-2026    | 527.585,00                 | 0,19                         |
| 1.569.000,00  | Adient Global Holdings Ltd 3.5% 15-08-2024      | 1.586.801,87               | 0,57                         | 502.000,00         | Cullinan Holdco Scsp 4.625% 15-10-2026          | 507.747,90                 | 0,18                         |
| 2.100.000,00  | ADLER Group SA 1.875% 14-01-2026                | 1.758.750,00               | 0,63                         | 1.652.000,00       | Goodyear Europe BV 2.75% 15-08-2028             | 1.678.180,90               | 0,60                         |
| 500.000,00  | ADLER Group SA 2.25% 14-01-2029                 | 413.750,00                 | 0,15                         | 1.580.000,00       | Graphic Packaging Internatio 2.625% 01-02-2029  | 1.609.230,00               | 0,58                         |
| 2.000.000,00  | ADLER Group SA 2.75% 13-11-2026                 | 1.680.000,00               | 0,60                         | 6.461.000,00       | Grifols Escrow Issuer SA 3.875% 15-10-2028      | 6.483.251,68               | 2,32                         |
| 2.125.000,00  | AIB Group PLC 6.250% MULTI Perp FC2025          | 2.350.781,25               | 0,84                         | 3.315.000,00       | Gruenthal GmbH 4.125% 15-05-2028                | 3.414.907,47               | 1,22                         |
| 6.232.000,00  | Altice France SA/France 3.375% 15-01-2028       | 6.059.685,20               | 2,17                         | 2.001.000,00       | Grupo Antolin-Irausa SA 3.5% 30-04-2028         | 1.880.940,00               | 0,67                         |
| 1.680.000,00  | Altice France SA/France 4% 15-07-2029           | 1.655.512,32               | 0,59                         | 1.707.000,00       | Guala Closures SpA 3.25% 15-06-2028             | 1.672.860,00               | 0,60                         |
| 1.538.000,00  | APCOA Parking Holdings GmbH FRN 15-01-2027      | 1.544.152,00               | 0,55                         | 1.200.000,00       | Heimstaden AB 6.750% MULTI Perp FC2026          | 1.224.000,00               | 0,44                         |
| 1.742.744,00  | ARD Finance SA 5% P-I-K 30-06-2027              | 1.786.312,60               | 0,64                         | 1.329.000,00       | Heimstaden Bostad AB 2.625% MULTI Perp FC2027   | 1.254.066,45               | 0,45                         |
| 393.000,00  | Ardagh Packaging Finance PLC 2.125% 15-08-2026  | 384.473,47                 | 0,14                         | 1.873.000,00       | Heimstaden Bostad AB 3.000% MULTI Perp FC2027   | 1.790.588,00               | 0,64                         |
| 771.000,00  | Ardagh Packaging Finance PLC 2.125% 15-08-2026  | 755.001,75                 | 0,27                         | 650.000,00         | Heimstaden Bostad AB 3.248% MULTI Perp FC2024   | 650.812,50                 | 0,23                         |
| 1.758.000,00  | ASR Nederland NV 4.625% MULTI Perp FC2027       | 1.911.825,00               | 0,69                         | 426.415,00         | HELIX HOLDCO SA                                 | 10.261,30                  | 0,00                         |
| 3.435.000,00  | Athora Netherlands NV 2.250% MULTI 15-07-2031   | 3.432.423,75               | 1,23                         | 1.229.000,00       | House of Finance NV/The 4.375% 15-07-2026       | 1.243.133,50               | 0,45                         |
| 1.331.000,00  | Avis Budget Finance Plc 4.75% 30-01-2026        | 1.354.292,50               | 0,49                         | 1.242.000,00       | House of HR 7.5% 15-01-2027                     | 1.304.100,00               | 0,47                         |
| 1.372.000,00  | Banca Monte dei Paschi di Si 10.5% 23-07-2029   | 1.296.540,00               | 0,46                         | 2.900.000,00       | Ibercaja Banco SA 2.750% MULTI 23-07-2030       | 2.885.500,00               | 1,03                         |
| 641.000,00  | Banca Monte dei Paschi di Si 3.625% 24-09-2024  | 651.581,63                 | 0,23                         | 1.270.000,00       | Iccrea Banca SpA 4.750% MULTI 18-01-2032        | 1.276.413,50               | 0,46                         |
| 1.800.000,00  | Banco de Credito Social 1.750% MULTI 09-03-2028 | 1.728.882,00               | 0,62                         | 2.558.000,00       | Iliad Holding SASU 5.625% 15-10-2028            | 2.692.985,66               | 0,97                         |
| 3.200.000,00  | Banco de Credito Social 5.250% MULTI 27-11-2031 | 3.320.000,00               | 1,19                         | 1.586.000,00       | International Design Group S 6.5% 15-11-2025    | 1.638.490,26               | 0,59                         |
| 1.403.000,00  | Banff Merger Sub Inc 8.375% 01-09-2026          | 1.460.172,25               | 0,52                         | 1.577.000,00       | International Game Technolog 3.5% 15-06-2026    | 1.607.357,25               | 0,58                         |
| 600.000,00  | Bankinter SA 6.250% MULTI Perp FC2026           | 671.782,80                 | 0,24                         | 400.000,00         | Intesa Sanpaolo SpA 7.750% MULTI Perp FC2027    | 484.500,00                 | 0,17                         |
| 400.000,00  | BAWAG Group AG 5.000% MULTI Perp FC2025         | 417.000,00                 | 0,15                         | 254.000,00         | IQVIA Inc 2.25% 15-01-2028                      | 255.280,16                 | 0,09                         |
| 400.000,00  | BAWAG Group AG 5.125% MULTI Perp FC2025         | 420.600,00                 | 0,15                         | 1.902.000,00       | IQVIA Inc 2.25% 15-03-2029                      | 1.894.296,90               | 0,68                         |
| 2.953.000,00  | Belden Inc 3.375% 15-07-2027                    | 2.986.929,97               | 1,07                         | 1.047.000,00       | IQVIA Inc 2.875% 15-06-2028                     | 1.073.091,24               | 0,38                         |
| 884.000,00  | BPER Banca 1.875% 07-07-2025                    | 900.327,48                 | 0,32                         | 531.000,00         | Jaguar Land Rover Automotive 4.5% 15-07-2028    | 540.407,20                 | 0,19                         |
| 2.394.000,00  | CAB SELAS 3.375% 01-02-2028                     | 2.389.178,48               | 0,86                         | 1.864.000,00       | Jaguar Land Rover Automotive 6.875% 15-11-2026  | 2.111.024,74               | 0,76                         |
| 900.000,00  | Casino Guichard Perrac 4.870% MULTI Perp FC2019 | 587.250,00                 | 0,21                         | 2.148.000,00       | KME SE 6.75% 01-02-2023                         | 2.055.636,00               | 0,74                         |
| 2.160.000,00  | Centurion Bidco SpA 5.875% 30-09-2026           | 2.219.335,20               | 0,80                         | 1.389.000,00       | Kongsberg Actuation Systems 5% 15-07-2025       | 1.402.945,56               | 0,50                         |
| 2.200.000,00  | CeramTec BondCo GmbH 5.25% 15-12-2025           | 2.224.970,00               | 0,80                         | 1.445.000,00       | La Financiere Atalian SASU 4% 15-05-2024        | 1.418.992,89               | 0,51                         |
| 2.293.000,00  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.5% 11-02-2027   | 2.330.073,22               | 0,84                         | 2.668.637,00       | LHMC Finco 2 Sarl 7.25% P-I-K 02-10-2025        | 2.533.259,27               | 0,91                         |
| 775.000,00  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.375% 15-01-2028 | 807.336,10                 | 0,29                         | 2.861.000,00       | Lorca Telecom Bondco SA 4% 18-09-2027           | 2.907.491,25               | 1,04                         |
| 2.677.000,00  | Chrome Bidco SASU 3.5% 31-05-2028               | 2.697.077,50               | 0,97                         | 3.186.000,00       | Loxam SAS 3.75% 15-07-2026                      | 3.233.790,00               | 1,16                         |
| 1.331.000,00  | Chrome Holdco SASU 5% 31-05-2029                | 1.331.000,00               | 0,48                         | 1.354.000,00       | Lune Holdings Sarl 5.625% 15-11-2028            | 1.354.000,00               | 0,49                         |
| 1.964.000,00  | Cirsa Finance International 4.75% 22-05-2025    | 1.946.822,86               | 0,70                         | 1.616.000,00       | Midco GB SASU 7.75% P-I-K 01-11-2027            | 1.656.400,00               | 0,59                         |
| 1.331.000,00  | Compact Bidco BV 5.75% 01-05-2026               | 1.247.934,95               | 0,45                         | 1.966.000,00       | Nidda BondCo GmbH 5% 30-09-2025                 | 1.951.255,00               | 0,70                         |
| 1.472.000,00  | Coty Inc 3.875% 15-04-2026                      | 1.500.686,34               | 0,54                         | 1.071.000,00       | Nidda BondCo GmbH 7.25% 30-09-2025              | 1.087.107,84               | 0,39                         |
| 2.672.000,00  | Coty Inc 4% 15-04-2023                          | 2.677.344,00               | 0,96                         | 1.299.000,00       | Nidda Healthcare Holding GmbH 3.5% 30-09-2024   | 1.295.596,62               | 0,46                         |
| 2.043.000,00  | CPI Property Group SA 3.750% MULTI Perp FC2028  | 1.918.291,19               | 0,69                         | 3.159.000,00       | Nobel Bidco BV 3.125% 15-06-2028                | 3.083.973,75               | 1,11                         |
|   |   |                            |                              | 1.112.000,00       | Nobian Finance BV 3.625% 15-07-2026             | 1.099.490,00               | 0,39                         |
|   |   |                            |                              | 2.954.000,00       | Novafives SAS 5% 15-06-2025                     | 2.773.067,50               | 0,99                         |
|   |   |                            |                              | 591.000,00         | Novelis Sheet Ingot GmbH 3.375% 15-04-2029      | 607.075,20                 | 0,22                         |
|   |   |                            |                              | 1.000.000,00       | Nykredit Realkredit AS 4.125% MULTI Perp FC2026 | 1.057.500,00               | 0,38                         |
|   |   |                            |                              | 1.587.000,00       | OI European Group BV 2.875% 15-02-2025          | 1.598.902,50               | 0,57                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European High Yield Credit Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 410.000,00         | Olympus Water US Holding Cor 3.875% 01-10-2028  | 411.025,00                 | 0,15                         | 3.106.000,00       | Bellis Acquisition Co PLC 3.25% 16-02-2026  | 3.554.091,55               | 1,27                         |
| 1.813.000,00       | Olympus Water US Holding Cor 5.375% 01-10-2029  | 1.749.545,00               | 0,63                         | 1.386.000,00       | Bellis Acquisition Co PLC 4.5% 16-02-2026   | 1.646.586,60               | 0,59                         |
| 3.362.000,00       | Parts Europe SA FRN 20-07-2027                  | 3.374.607,50               | 1,21                         | 2.022.000,00       | Iceland Bondco PLC 4.625% 15-03-2025  | 2.250.523,58               | 0,81                         |
| 1.182.000,00       | Peach Property Finance GmbH 4.375% 15-11-2025   | 1.211.550,00               | 0,43                         | 1.219.000,00       | Intesa Sanpaolo SpA 5.148% 10-06-2030   | 1.620.206,44               | 0,58                         |
| 2.086.000,00       | Permanent TSB Group Ho 7.875% MULTI Perp FC2025 | 2.343.621,00               | 0,84                         | 1.293.000,00       | La Financiere Atalian SASU 6.625% 15-05-2025  | 1.521.479,15               | 0,55                         |
| 2.743.000,00       | Permanent TSB Group Hol 3.000% MULTI 19-08-2031 | 2.784.145,00               | 1,00                         | 2.557.000,00       | Nationwide Building So 5.750% MULTI Perp FC2027   | 3.287.345,03               | 1,18                         |
| 2.493.000,00       | ProGroup AG 3% 31-03-2026                       | 2.521.046,25               | 0,90                         | 4.844,00           | Nationwide Building Society MULTI Perpetual   | 1.097.753,57               | 0,39                         |
| 2.294.000,00       | Q-Park Holding I BV 2% 01-03-2027               | 2.163.058,48               | 0,78                         | 2.005.000,00       | Pinewood Finance Co Ltd 3.25% 30-09-2025  | 2.385.174,69               | 0,86                         |
| 943.000,00         | Q-Park Holding I BV FRN 01-03-2026              | 911.173,02                 | 0,33                         | 1.820.000,00       | Pinewood Finance Co Ltd 3.625% 15-11-2027   | 2.157.093,11               | 0,77                         |
| 2.007.000,00       | Rexel SA 2.125% 15-12-2028                      | 2.017.195,56               | 0,72                         | 2.000.000,00       | Very Group Funding Plc/The 6.5% 01-08-2026  | 2.371.503,35               | 0,85                         |
| 1.376.000,00       | Rossini Sarl 6.75% 30-10-2025                   | 1.425.880,00               | 0,51                         | 1.488.000,00       | Virgin Media Secured Finance 5.25% 15-05-2029   | 1.846.388,72               | 0,66                         |
| 756.000,00         | Schoeller Packaging BV 6.375% 01-11-2024        | 766.395,00                 | 0,27                         | 1.711.000,00       | Virgin Media Vendor Financin 4.875% 15-07-2028  | 2.036.764,49               | 0,73                         |
| 313.000,00         | SCIL IV LLC / SCIL USA Holdi 4.375% 01-11-2026  | 318.086,25                 | 0,11                         | 2.732.000,00       | Vmed O2 UK Financing I PLC 4% 31-01-2029  | 3.185.487,76               | 1,14                         |
| 1.308.000,00       | SoftBank Group Corp 3.375% 06-07-2029           | 1.216.701,60               | 0,44                         | 871.000,00         | Voyage Care BondCo PLC 10% 01-11-2023   | 994.718,51                 | 0,36                         |
| 1.489.000,00       | SoftBank Group Corp 4% 19-09-2029               | 1.440.250,14               | 0,52                         | 1.798.000,00       | Voyage Care BondCo PLC 5.875% 01-05-2023  | 2.124.221,66               | 0,76                         |
| 5.448.000,00       | SoftBank Group Corp 5% 15-04-2028               | 5.597.820,00               | 2,01                         |                    |   | <b>38.009.517,26</b>       | <b>13,63</b>                 |
| 950.000,00         | Stichting AK Rabobank Certif MULTI Perpetual    | 1.306.250,00               | 0,47                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 343.000,00         | Summer BC Holdco A Sarl 9.25% 31-10-2027        | 332.987,32                 | 0,12                         | 2.052.000,00       | Argentum Netherlands BV 5.625% MULTI 15-08-2052   | 2.035.876,05               | 0,73                         |
| 1.314.000,00       | Summer BC Holdco B SARL 5.75% 31-10-2026        | 1.366.560,00               | 0,49                         | 1.362.000,00       | Jaguar Land Rover Automotive 5.875% 15-01-2028  | 1.223.533,31               | 0,44                         |
| 2.650.000,00       | Techem Verwaltungsgesellscha 2% 15-07-2025      | 2.620.187,50               | 0,94                         | 3.200.000,00       | SCOR SE 5.250% MULTI Perp FC2029  | 2.940.417,61               | 1,05                         |
| 100.000,00         | Telecom Italia SpA/Milano 5.25% 17-03-2055      | 105.047,20                 | 0,04                         | 926.000,00         | Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-11-2033   | 880.339,74                 | 0,32                         |
| 900.000,00         | Telefonica Europe BV 3.000% MULTI Perp FC2023   | 927.000,00                 | 0,33                         | 3.000.000,00       | Telenet Finance Luxembourg N 5.5% 01-03-2028  | 2.728.115,48               | 0,98                         |
| 2.400.000,00       | Telefonica Europe BV 3.875% MULTI Perp FC2026   | 2.539.310,40               | 0,91                         |                    |   | <b>9.808.282,19</b>        | <b>3,52</b>                  |
| 1.300.000,00       | Telefonica Europe BV 4.375% MULTI Perp FC2024   | 1.396.005,00               | 0,50                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>257.823.551,72</b>      | <b>92,45</b>                 |
| 5.804.000,00       | Teva Pharmaceutical Finance 1.625% 15-10-2028   | 5.049.480,00               | 1,81                         |                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>257.823.551,72</b>      | <b>92,45</b>                 |
| 788.000,00         | Teva Pharmaceutical Finance 3.75% 09-05-2027    | 783.075,00                 | 0,28                         |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
| 500.000,00         | Unicaja Banco SA 2.875% MULTI 13-11-2029        | 505.000,00                 | 0,18                         |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
| 2.600.000,00       | Unicaja Banco SA 4.875% MULTI Perp FC2026       | 2.575.300,00               | 0,92                         |                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 800.000,00         | UniCredit SpA 7.500% MULTI Perp FC2026          | 938.888,00                 | 0,34                         | 2.123.000,00       | Elior Group SA 3.75% 15-07-2026   | 2.170.236,75               | 0,78                         |
| 2.647.000,00       | United Group BV 4% 15-11-2027                   | 2.620.530,00               | 0,94                         |                    |   | <b>2.170.236,75</b>        | <b>0,78</b>                  |
| 1.796.000,00       | Verde Bidco SpA 4.625% 01-10-2026               | 1.834.614,00               | 0,66                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 570.000,00         | Verisure Holding AB 3.25% 15-02-2027            | 567.862,50                 | 0,20                         | 439.000,00         | Intesa Sanpaolo SpA 4% 23-09-2029   | 415.948,23                 | 0,15                         |
| 2.634.000,00       | Verisure Holding AB 3.875% 15-07-2026           | 2.680.095,00               | 0,96                         |                    |   | <b>415.948,23</b>          | <b>0,15</b>                  |
| 117.000,00         | Verisure Holding AB FRN 15-04-2025              | 118.608,75                 | 0,04                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>2.586.184,98</b>        | <b>0,93</b>                  |
| 3.813.000,00       | Verisure Midholding AB 5.25% 15-02-2029         | 3.862.256,33               | 1,38                         |                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>2.586.184,98</b>        | <b>0,93</b>                  |
| 1.182.000,00       | VZ Vendor Financing II BV 2.875% 15-01-2029     | 1.142.107,50               | 0,41                         |                    |   |                            |                              |
| 2.888.000,00       | WMG Acquisition Corp 2.75% 15-07-2028           | 2.962.100,30               | 1,06                         |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>260.409.736,70</b>      | <b>93,38</b>                 |
| 2.100.000,00       | Wuestenrot & Wuerttembe 2.125% MULTI 10-09-2041 | 2.016.588,00               | 0,72                         |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>8.561.447,35</b>        | <b>3,07</b>                  |
| 661.000,00         | Ziggo BV 2.875% 15-01-2030                      | 657.695,00                 | 0,24                         |                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>9.893.153,66</b>        | <b>3,55</b>                  |
|                    |   | <b>210.005.752,27</b>      | <b>75,31</b>                 |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>278.864.337,71</b>      | <b>100,00</b>                |
|                    | <b>GBP</b>                                      |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 242.000,00         | Ardagh Packaging Finance PLC 4.75% 15-07-2027   | 287.842,06                 | 0,10                         |                    |   |                            |                              |
| 1.786.000,00       | Aviva PLC 6.875% MULTI 20-05-2058               | 3.243.662,90               | 1,16                         |                    |   |                            |                              |
| 2.010.000,00       | B&M European Value Retail SA 4% 15-11-2028      | 2.398.674,09               | 0,86                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European High Yield Credit Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |       |
|------------------------|--------------|----------------------|-------|
| Frankreich             | 14,41        | Unternehmensanleihen | 93,38 |
| Niederlande            | 13,54        |                      |       |
| Vereinigtes Königreich | 12,78        |                      |       |
| Deutschland            | 9,21         |                      |       |
| Spanien                | 9,12         |                      |       |
| Luxemburg              | 8,26         |                      |       |
| USA                    | 6,78         |                      |       |
| Italien                | 5,40         |                      |       |
| Schweden               | 4,36         |                      |       |
| Irland                 | 3,41         |                      |       |
| Japan                  | 2,96         |                      |       |
| Jersey                 | 1,05         |                      |       |
| Belgien                | 0,91         |                      |       |
| Länderübergreifend     | 0,51         |                      |       |
| Dänemark               | 0,38         |                      |       |
| Österreich             | 0,30         |                      |       |
| <b>Summe</b>           | <b>93,38</b> |                      |       |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - European High Yield Credit Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 235.336.095,67                                    | DKK                | 31.647.301,27     | EUR                  | 279,93  | 28.01.2022  |
| 155.914,69  | EUR                | 1.159.549,16      | DKK                  | (19,43)   | 28.01.2022  |
| 209.697,56  | EUR                | 2.159.283,99      | NOK                  | (6.352,91)  | 28.01.2022  |
| 50,47   | EUR                | 239,14            | PLN                  | (1,43)  | 28.01.2022  |
| 336.767,82  | EUR                | 3.465.725,79      | SEK                  | (1.177,85)  | 28.01.2022  |
| 237.369.963,80                                    | NOK                | 23.535.130,45     | EUR                  | 215.036,47  | 28.01.2022  |
| 37.596,95   | PLN                | 7939,26           | EUR                  | 221,09  | 28.01.2022  |
| 227.536.595,20                                    | SEK                | 22.458.122,77     | EUR                  | (271.027,95)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(63.042,08)</b>  |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 5.335.443,58                                      | EUR                | 4.493.000,00      | GBP                  | (5.466,99)  | 28.02.2022  |
| 14.497.146,61                                     | EUR                | 16.363.700,00     | USD                  | 67.026,66   | 28.02.2022  |
| 5.108.000,00                                      | GBP                | 6.055.519,04      | EUR                  | 16.464,33   | 28.02.2022  |
| 1.978.700,00                                      | USD                | 1.744.358,22      | EUR                  | 542,53  | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>78.566,53</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 35.324.578,73                                     | EUR                | 29.847.000,00     | GBP                  | (155.220,71)  | 28.02.2022  |
| 800.000,00  | USD                | 709.452,57        | EUR                  | (3.983,55)  | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(159.204,26)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 201.864,33  | EUR                | 229.000,00        | USD                  | (77,50)   | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(77,50)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                    |                   |                      |   |             |
| 3.180.070,62                                      | EUR                | 2.687.000,00      | GBP                  | (14.026,70)   | 28.02.2022  |
| 639.318,53  | EUR                | 725.000,00        | USD                  | (16,72)   | 28.02.2022  |
| 49.000,00   | USD                | 43.260,26         | EUR                  | (50,07)   | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(14.093,49)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| 2.706.000,00                                      | USD                | 2.374.134,67      | EUR                  | 12.142,21   | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>12.142,21</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(82.666,51)</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(145.708,59)</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Credit Default Swaps

| Basiswert  | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal       | Wahrung | Kosten (EUR)          | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)       | Falligkeit |
|--|--------------|-----------------|---------------|----------|-----------------------|--|-----------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>    |              |                 |               |          |                       |  |                       |             |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Kauf         | 5,00%           | 6.600.000,00  | EUR      | (758.222,37)          | (25.453,89)  | (783.676,26)          | 20.12.2026  |
|  |              |                 |               |          | <b>(758.222,37)</b>   | <b>(25.453,89)</b>                                   | <b>(783.676,26)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |              |                 |               |          |                       |  |                       |             |
| ITRAXX-XOVERS32V1-5Y                             | Kauf         | 5,00%           | 20.164.071,00 | EUR      | (2.631.785,90)        | 650.336,45   | (1.981.449,45)        | 20.12.2024  |
| Lloyds Banking Group PLC 4.5% 04-11-2024         | Kauf         | 1,00%           | 2.400.000,00  | EUR      | 43.785,32             | (76.405,52)  | (32.620,20)           | 20.06.2024  |
|  |              |                 |               |          | <b>(2.588.000,58)</b> | <b>573.930,93</b>                                    | <b>(2.014.069,65)</b> |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |              |                 |               |          |                       |  |                       |             |
| Novafives SAS 4.5% 20-06-2022                    | Kauf         | 5,00%           | 471.000,00    | EUR      | (57.259,52)           | 56.000,21  | (1.259,31)            | 20.06.2022  |
|  |              |                 |               |          | <b>(57.259,52)</b>    | <b>56.000,21</b>                                     | <b>(1.259,31)</b>     |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European High Yield Credit Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert                                    | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal        | Währung | Kosten (EUR)          | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)       | Fälligkeit |
|--|--------------|-----------------|----------------|---------|-----------------------|---|-----------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>             |              |                 |                |         |                       |   |                       |            |
| Iceland Bondco PLC 6.75% 15-07-2024          | Verkauf      | 5,00%           | (3.300.000,00) | EUR     | (511.500,00)          | 564.710,52  | 53.210,52             | 20.12.2023 |
|  |              |                 |                |         | <b>(511.500,00)</b>   | <b>564.710,52</b>                                   | <b>53.210,52</b>      |            |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b> |              |                 |                |         |                       |   |                       |            |
| Ol European Group BV 3.125% 15-11-2024       | Verkauf      | 5,00%           | (1.900.000,00) | EUR     | 184.276,73            | 5.312,09  | 189.588,82            | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                |         | <b>184.276,73</b>     | <b>5.312,09</b>                                     | <b>189.588,82</b>     |            |
|  |              |                 |                |         | <b>(3.730.705,74)</b> | <b>1.174.499,86</b>                                 | <b>(2.556.205,88)</b> |            |

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|-------------------------------|--------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                               |                          |   |  |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (27,00)                       | (4.626.990,00)           | 0,00  | 86.274,96  |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022 | GBP     | (32,00)                       | (3.997.760,00)           | (5.713,89)  | 81.643,17  |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (88,00)                       | (11.482.625,44)          | (6.070,22)  | (105.833,80)   |
|  |            |         |                               |                          | <b>(11.784,11)</b>  | <b>62.084,33</b>   |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 760.000,00 EUR erhalten.  
 BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 2.150.000,00 EUR erhalten.  
 J.P. Morgan SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 50.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapiieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.700.000,00  | Abanca Corp Bancaria SA 4.625% MULTI 07-04-2030 | 1.808.375,00               | 0,29                         | 15.769.000,00      | Grifols Escrow Issuer SA 3.875% 15-10-2028      | 15.823.308,44              | 2,51                         |
| 5.200.000,00  | Abanca Corp Bancaria SA 6.125% MULTI 18-01-2029 | 5.622.500,00               | 0,89                         | 9.096.000,00       | Gruenenthal GmbH 4.125% 15-05-2028              | 9.370.135,25               | 1,49                         |
| 3.000.000,00  | ADLER Group SA 1.875% 14-01-2026                | 2.512.500,00               | 0,40                         | 2.200.000,00       | Heimstaden AB 6.750% MULTI Perp FC2026          | 2.244.000,00               | 0,36                         |
| 900.000,00  | ADLER Group SA 2.25% 14-01-2029                 | 744.750,00                 | 0,12                         | 1.568.000,00       | Heimstaden Bostad AB 2.625% MULTI Perp FC2027   | 1.479.590,81               | 0,23                         |
| 5.200.000,00  | ADLER Group SA 2.75% 13-11-2026                 | 4.368.000,00               | 0,69                         | 3.954.000,00       | Heimstaden Bostad AB 3.000% MULTI Perp FC2027   | 3.780.024,00               | 0,60                         |
| 4.418.000,00  | AIB Group PLC 6.250% MULTI Perp FC2025          | 4.887.412,50               | 0,78                         | 2.745.000,00       | Heimstaden Bostad AB 3.248% MULTI Perp FC2024   | 2.748.431,25               | 0,44                         |
| 1.576.000,00  | Almirall SA 2.125% 30-09-2026                   | 1.585.850,00               | 0,25                         | 5.190.000,00       | Heimstaden Bostad AB 3.375% MULTI Perp FC2026   | 5.131.612,50               | 0,81                         |
| 4.505.000,00  | APCOA Parking Holdings GmbH FRN 15-01-2027      | 4.523.020,00               | 0,72                         | 2.712.000,00       | House of Finance NV/The 4.375% 15-07-2026       | 2.743.188,00               | 0,44                         |
| 7.053.000,00  | ASR Nederland NV 4.625% MULTI Perp FC2027       | 7.670.137,50               | 1,22                         | 3.026.000,00       | House of HR 7.5% 15-01-2027                     | 3.177.300,00               | 0,50                         |
| 7.307.000,00  | Athora Netherlands NV 2.250% MULTI 15-07-2031   | 7.301.519,75               | 1,16                         | 4.900.000,00       | Ibercaja Banco SA 2.750% MULTI 23-07-2030       | 4.875.500,00               | 0,77                         |
| 4.155.000,00  | Avantor Funding Inc 3.875% 15-07-2028           | 4.321.200,00               | 0,69                         | 2.254.000,00       | Iccrea Banca SpA 4.750% MULTI 18-01-2032        | 2.265.382,70               | 0,36                         |
| 3.051.000,00  | Avis Budget Finance Plc 4.75% 30-01-2026        | 3.104.392,50               | 0,49                         | 8.206.000,00       | Iliad Holding SASU 5.625% 15-10-2028            | 8.639.030,62               | 1,37                         |
| 1.094.000,00  | Banca IFIS SpA 1.75% 25-06-2024                 | 1.094.415,72               | 0,17                         | 3.892.000,00       | International Design Group S 6.5% 15-11-2025    | 4.020.809,63               | 0,64                         |
| 654.000,00  | Banca IFIS SpA 2% 24-04-2023                    | 658.643,40                 | 0,10                         | 1.079.000,00       | Intesa Sanpaolo SpA 7.750% MULTI Perp FC2027    | 1.306.938,75               | 0,21                         |
| 2.840.000,00  | Banca Monte dei Paschi di Si 10.5% 23-07-2029   | 2.683.800,00               | 0,43                         | 822.000,00         | IQVIA Inc 2.25% 15-01-2028                      | 826.142,88                 | 0,13                         |
| 3.056.000,00  | Banca Monte dei Paschi di Si 3.625% 24-09-2024  | 3.106.448,45               | 0,49                         | 4.145.000,00       | IQVIA Inc 2.25% 15-03-2029                      | 4.128.212,75               | 0,66                         |
| 3.900.000,00  | Banco de Credito Social 1.750% MULTI 09-03-2028 | 3.745.911,00               | 0,59                         | 2.875.000,00       | IQVIA Inc 2.875% 15-06-2028                     | 2.946.645,00               | 0,47                         |
| 7.900.000,00  | Banco de Credito Social 5.250% MULTI 27-11-2031 | 8.196.250,00               | 1,30                         | 2.030.000,00       | James Hardie International F 3.625% 01-10-2026  | 2.063.641,16               | 0,33                         |
| 3.669.000,00  | Banf Merger Sub Inc 8.375% 01-09-2026           | 3.818.511,75               | 0,61                         | 2.963.000,00       | Kongsberg Actuation Systems 5% 15-07-2025       | 2.992.748,52               | 0,48                         |
| 2.400.000,00  | Bankinter SA 6.250% MULTI Perp FC2026           | 2.687.131,20               | 0,43                         | 6.465.000,00       | La Financiere Atalian SASU 4% 15-05-2024        | 6.348.642,93               | 1,01                         |
| 600.000,00  | BAWAG Group AG 5.000% MULTI Perp FC2025         | 625.500,00                 | 0,10                         | 2.700.000,00       | La Mondiale SAM 2.125% 23-06-2031               | 2.797.259,40               | 0,44                         |
| 2.400.000,00  | BAWAG Group AG 5.125% MULTI Perp FC2025         | 2.523.600,00               | 0,40                         | 7.713.000,00       | Lorca Telecom Bondco SA 4% 18-09-2027           | 7.838.336,25               | 1,24                         |
| 6.739.000,00  | Belden Inc 3.375% 15-07-2027                    | 6.816.431,11               | 1,08                         | 4.000.000,00       | Loxam SAS 3.75% 15-07-2026                      | 4.060.000,00               | 0,64                         |
| 2.145.000,00  | BPER Banca 1.375% MULTI 31-03-2027              | 2.100.461,22               | 0,33                         | 3.519.000,00       | Lune Holdings Sarl 5.625% 15-11-2028            | 3.519.000,00               | 0,56                         |
| 2.038.000,00  | British Telecommunicati 1.874% MULTI 18-08-2080 | 1.992.145,00               | 0,32                         | 4.414.000,00       | Midco GB SASU 7.75% P-I-K 01-11-2027            | 4.524.350,00               | 0,72                         |
| 6.474.000,00  | CAB SELAS 3.375% 01-02-2028                     | 6.460.961,36               | 1,03                         | 2.500.000,00       | Nidda BondCo GmbH 5% 30-09-2025                 | 2.481.250,00               | 0,39                         |
| 5.115.000,00  | CeramTec BondCo GmbH 5.25% 15-12-2025           | 5.173.055,25               | 0,82                         | 2.175.000,00       | Nidda BondCo GmbH 7.25% 30-09-2025              | 2.207.712,00               | 0,35                         |
| 7.160.000,00  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.5% 11-02-2027   | 7.275.762,88               | 1,16                         | 4.597.000,00       | Nidda Healthcare Holding GmbH 3.5% 30-09-2024   | 4.584.955,86               | 0,73                         |
| 3.712.000,00  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.375% 15-01-2028 | 3.866.879,49               | 0,61                         | 7.255.000,00       | Nobel Bidco BV 3.125% 15-06-2028                | 7.082.693,75               | 1,12                         |
| 6.755.000,00  | Chrome Bidco SASU 3.5% 31-05-2028               | 6.805.662,50               | 1,08                         | 5.863.000,00       | Novafives SAS 5% 15-06-2025                     | 5.503.891,25               | 0,87                         |
| 6.606.000,00  | Chrome Holdco SASU 5% 31-05-2029                | 6.606.000,00               | 1,05                         | 4.200.000,00       | Nykredit Realkredit AS 4.125% MULTI Perp FC2026 | 4.441.500,00               | 0,71                         |
| 3.696.000,00  | Compact Bidco BV 5.75% 01-05-2026               | 3.465.340,03               | 0,55                         | 5.655.000,00       | Olympus Water US Holding Cor 3.875% 01-10-2028  | 5.669.137,50               | 0,90                         |
| 4.815.000,00  | CPI Property Group SA 3.750% MULTI Perp FC2028  | 4.521.082,77               | 0,72                         | 5.216.000,00       | Olympus Water US Holding Cor 5.375% 01-10-2029  | 5.033.440,00               | 0,80                         |
| 800.000,00  | Credit Agricole Assuran 4.750% MULTI 27-09-2048 | 961.640,00                 | 0,15                         | 1.474.000,00       | Ontex Group NV 3.5% 15-07-2026                  | 1.400.594,80               | 0,22                         |
| 2.200.000,00  | Credit Agricole Assurances S 2% 17-07-2030      | 2.271.214,00               | 0,36                         | 9.807.000,00       | Parts Europe SA FRN 20-07-2027                  | 9.843.776,25               | 1,56                         |
| 3.083.000,00  | Cullinan Holdco Scsp 4.625% 15-10-2026          | 3.118.300,35               | 0,50                         | 5.336.000,00       | Permanent TSB Group Ho 7.875% MULTI Perp FC2025 | 5.994.996,00               | 0,95                         |
| 4.140.000,00  | Energizer Gamma Acquisition 3.5% 30-06-2029     | 3.995.100,00               | 0,63                         | 6.002.000,00       | Permanent TSB Group Hol 3.000% MULTI 19-08-2031 | 6.092.030,00               | 0,97                         |
| 6.682.000,00  | Eurofins Scientific SE 3.250% MULTI Perp FC2025 | 6.976.956,84               | 1,11                         | 10.147.000,00      | ProGroup AG 3% 31-03-2026                       | 10.261.153,75              | 1,63                         |
| 4.653.000,00  | Goodyear Europe BV 2.75% 15-08-2028             | 4.726.740,74               | 0,75                         | 6.501.000,00       | Q-Park Holding I BV 2% 01-03-2027               | 6.129.922,92               | 0,97                         |
| 6.959.000,00  | Graphic Packaging Internatio 2.625% 01-02-2029  | 7.087.741,50               | 1,13                         | 1.834.000,00       | Q-Park Holding I BV FRN 01-03-2026              | 1.772.101,09               | 0,28                         |
|   |   |                            |                              | 4.840.000,00       | Rexel SA 2.125% 15-12-2028                      | 4.864.587,20               | 0,77                         |
|   |   |                            |                              | 3.514.000,00       | Rossini Sarl 6.75% 30-10-2025                   | 3.641.382,50               | 0,58                         |
|   |   |                            |                              | 1.393.000,00       | Samsonite Finco Sarl 3.5% 15-05-2026            | 1.351.210,00               | 0,21                         |
|   |   |                            |                              | 3.599.000,00       | SCIL IV LLC / SCIL USA Holdi 4.375% 01-11-2026  | 3.657.483,75               | 0,58                         |
|   |   |                            |                              | 4.503.000,00       | SoftBank Group Corp 3.375% 06-07-2029           | 4.188.690,60               | 0,67                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 2.355.000,00       | SoftBank Group Corp 4% 19-09-2029               | 2.277.897,30               | 0,36                         | 5.357.000,00       | Very Group Funding Plc/The 6.5% 01-08-2026  | 6.352.071,71               | 1,01                         |
| 17.705.000,00      | SoftBank Group Corp 5% 15-04-2028               | 18.191.887,50              | 2,89                         | 7.780.000,00       | Virgin Media Secured Finance 5% 15-04-2027  | 9.527.620,99               | 1,51                         |
| 3.800.000,00       | SPIE SA 2.625% 18-06-2026                       | 3.937.750,00               | 0,63                         | 3.039.000,00       | Virgin Media Secured Finance 5.25% 15-05-2029   | 3.770.951,17               | 0,60                         |
| 1.680.000,00       | Stichting AK Rabobank Certif MULTI Perpetual    | 2.310.000,00               | 0,37                         | 6.297.000,00       | Virgin Media Vendor Financin 4.875% 15-07-2028  | 7.495.912,34               | 1,19                         |
| 1.399.000,00       | Summer BC Holdco A Sarl 9.25% 31-10-2027        | 1.358.161,12               | 0,22                         | 513.000,00         | Voyage Care BondCo PLC 10% 01-11-2023   | 585.867,50                 | 0,09                         |
| 3.972.000,00       | Summer BC Holdco B SARL 5.75% 31-10-2026        | 4.130.880,00               | 0,66                         | 4.355.000,00       | Voyage Care BondCo PLC 5.875% 01-05-2023  | 5.145.153,13               | 0,82                         |
| 6.645.000,00       | Techem Verwaltungsgesellscha 2% 15-07-2025      | 6.570.243,75               | 1,04                         |                    |   | <b>84.206.600,97</b>       | <b>13,37</b>                 |
| 2.129.000,00       | Techem Verwaltungsgesellscha 6% 30-07-2026      | 1.923.931,01               | 0,31                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 5.082.000,00       | Telecom Italia Spa/Milano 2.375% 12-10-2027     | 5.005.770,00               | 0,79                         | 4.572.000,00       | Argentum Netherlands BV 5.625% MULTI 15-08-2052   | 4.536.074,70               | 0,72                         |
| 100.000,00         | Telecom Italia Spa/Milano 5.25% 17-03-2055      | 105.047,20                 | 0,02                         | 2.000.000,00       | Cloverie PLC for Zurich 5.625% MULTI 24-06-2046   | 1.968.834,15               | 0,31                         |
| 400.000,00         | Telefonica Europe BV 2.376% MULTI Perp FC2029   | 381.080,00                 | 0,06                         | 8.800.000,00       | SCOR SE 5.250% MULTI Perp FC2029  | 8.086.148,42               | 1,28                         |
| 2.600.000,00       | Telefonica Europe BV 3.000% MULTI Perp FC2023   | 2.678.000,00               | 0,43                         | 1.264.000,00       | Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-11-2033   | 1.201.673,25               | 0,19                         |
| 6.700.000,00       | Telefonica Europe BV 3.875% MULTI Perp FC2026   | 7.088.908,20               | 1,13                         | 7.800.000,00       | Telenet Finance Luxembourg N 5.5% 01-03-2028  | 7.093.100,26               | 1,13                         |
| 1.400.000,00       | Telefonica Europe BV 4.375% MULTI Perp FC2024   | 1.503.390,00               | 0,24                         |                    |   | <b>22.885.830,78</b>       | <b>3,63</b>                  |
| 1.000.000,00       | Telefonica Europe BV 5.875% MULTI Perp FC2024   | 1.096.250,00               | 0,17                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>588.738.121,65</b>      | <b>93,47</b>                 |
| 2.400.000,00       | Unicaja Banco SA 2.875% MULTI 13-11-2029        | 2.424.000,00               | 0,38                         |                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>588.738.121,65</b>      | <b>93,47</b>                 |
| 5.800.000,00       | Unicaja Banco SA 4.875% MULTI Perp FC2026       | 5.744.900,00               | 0,91                         |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
| 3.225.000,00       | UniCredit SpA 7.500% MULTI Perp FC2026          | 3.784.892,25               | 0,60                         |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
| 3.634.000,00       | Unilabs Subholding AB 5.75% 15-05-2025          | 3.670.340,00               | 0,58                         |                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 885.000,00         | UPC Holding BV 3.875% 15-06-2029                | 901.593,75                 | 0,14                         | 419.000,00         | Adevinta ASA 3% 15-11-2027  | 428.888,40                 | 0,07                         |
| 1.550.000,00       | UPCB Finance VII Ltd 3.625% 15-06-2029          | 1.581.000,00               | 0,25                         | 5.788.000,00       | Elior Group SA 3.75% 15-07-2026   | 5.916.783,00               | 0,94                         |
| 4.547.000,00       | Verde Bidco SpA 4.625% 01-10-2026               | 4.644.760,50               | 0,74                         |                    |   | <b>6.345.671,40</b>        | <b>1,01</b>                  |
| 744.000,00         | Verisure Holding AB 3.25% 15-02-2027            | 741.210,00                 | 0,12                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 5.531.000,00       | Verisure Holding AB 3.875% 15-07-2026           | 5.627.792,50               | 0,89                         | 3.231.000,00       | Intesa Sanpaolo SpA 4% 23-09-2029   | 3.061.341,05               | 0,49                         |
| 200.000,00         | Verisure Holding AB FRN 15-04-2025              | 202.750,00                 | 0,03                         | 11.111.000,00      | Ziggo BV 5.5% 15-01-2027  | 10.079.506,04              | 1,60                         |
| 8.943.000,00       | Verisure Midholding AB 5.25% 15-02-2029         | 9.058.525,67               | 1,44                         |                    |   | <b>13.140.847,09</b>       | <b>2,09</b>                  |
| 1.573.000,00       | Vodafone Group PLC 2.625% MULTI 27-08-2080      | 1.600.527,50               | 0,25                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>19.486.518,49</b>       | <b>3,09</b>                  |
| 2.536.000,00       | VZ Vendor Financin II BV 2.875% 15-01-2029      | 2.450.410,00               | 0,39                         |                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>19.486.518,49</b>       | <b>3,09</b>                  |
| 7.141.000,00       | WMG Acquisition Corp 2.75% 15-07-2028           | 7.324.223,78               | 1,16                         |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>608.224.640,14</b>      | <b>96,56</b>                 |
| 4.300.000,00       | Wuestenrot & Wuerttembe 2.125% MULTI 10-09-2041 | 4.129.204,00               | 0,66                         |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>16.713.590,25</b>       | <b>2,65</b>                  |
| 1.544.000,00       | Ziggo BV 2.875% 15-01-2030                      | 1.536.280,00               | 0,24                         |                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>4.932.340,60</b>        | <b>0,78</b>                  |
|                    |   | <b>481.645.689,90</b>      | <b>76,47</b>                 |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>629.870.570,99</b>      | <b>100,00</b>                |
|                    | <b>GBP</b>                                      |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 3.573.000,00       | Aviva PLC 6.875% MULTI 20-05-2058               | 6.489.141,96               | 1,03                         |                    |   |                            |                              |
| 4.662.000,00       | B&M European Value Retail SA 4% 15-11-2028      | 5.563.491,85               | 0,88                         |                    |   |                            |                              |
| 8.172.000,00       | Iceland Bondco PLC 4.625% 15-03-2025            | 9.095.587,89               | 1,44                         |                    |   |                            |                              |
| 2.657.000,00       | Intesa Sanpaolo SpA 5.148% 10-06-2030           | 3.531.491,80               | 0,56                         |                    |   |                            |                              |
| 1.500.000,00       | La Financiere Atalian SASU 6.625% 15-05-2025    | 1.765.057,01               | 0,28                         |                    |   |                            |                              |
| 7.642.000,00       | Nationwide Building So 5.750% MULTI Perp FC2027 | 9.824.751,96               | 1,56                         |                    |   |                            |                              |
| 8.582,00           | Nationwide Building Society MULTI Perpetual     | 1.944.863,98               | 0,31                         |                    |   |                            |                              |
| 7.328.000,00       | Pinewood Finance Co Ltd 3.25% 30-09-2025        | 8.717.486,34               | 1,38                         |                    |   |                            |                              |
| 3.710.000,00       | Pinewood Finance Co Ltd 3.625% 15-11-2027       | 4.397.151,34               | 0,70                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |       |
|------------------------|--------------|----------------------|-------|
| Frankreich             | 14,19        | Unternehmensanleihen | 96,56 |
| Niederlande            | 12,65        |                      |       |
| Vereinigtes Königreich | 11,03        |                      |       |
| Deutschland            | 9,90         |                      |       |
| Spanien                | 9,58         |                      |       |
| USA                    | 8,20         |                      |       |
| Luxemburg              | 7,95         |                      |       |
| Italien                | 5,93         |                      |       |
| Schweden               | 5,51         |                      |       |
| Irland                 | 4,53         |                      |       |
| Japan                  | 3,91         |                      |       |
| Belgien                | 1,16         |                      |       |
| Dänemark               | 0,71         |                      |       |
| Österreich             | 0,50         |                      |       |
| Jersey                 | 0,49         |                      |       |
| Kaimaninseln           | 0,25         |                      |       |
| Norwegen               | 0,07         |                      |       |
| <b>Summe</b>           | <b>96,56</b> |                      |       |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|--|-------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                    |                   |                      |  |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |  |             |
| 15.362.933,53                                     | CHF                | 14.647.583,52     | EUR                  | 228.213,65   | 28.01.2022  |
| 263.445,04  | EUR                | 275.338,50        | CHF                  | (3162,39)  | 28.01.2022  |
| 1.124.744,70                                      | EUR                | 11.468.835,25     | NOK                  | (22.781,52)  | 28.01.2022  |
| 2.079.161,37                                      | EUR                | 21.390.201,22     | SEK                  | (6.613,74)   | 28.01.2022  |
| 804.303.930,96                                    | NOK                | 79.721.781,31     | EUR                  | 753.251,47   | 28.01.2022  |
| 1.726.628.889,61                                  | SEK                | 170.454.494,05    | EUR                  | (2.090.917,69)   | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.142.010,22)</b>  |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |  |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |  |             |
| 865.046,04  | EUR                | 740.000,00        | GBP                  | (14.857,78)  | 18.02.2022  |
| 32.181.061,68                                     | EUR                | 36.656.124,00     | USD                  | (150.527,05)   | 18.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(165.384,83)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |  |             |
| 73.048.125,87                                     | EUR                | 61.761.000,00     | GBP                  | (388.590,87)   | 18.02.2022  |
| 978.805,33  | EUR                | 1.110.000,00      | USD                  | (237,64)   | 18.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(388.828,51)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |  |             |
| 3.128.000,00                                      | USD                | 2.771.243,67      | EUR                  | (12.294,65)  | 18.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(12.294,65)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                    |                   |                      |  |             |
| 10.378.999,13                                     | EUR                | 8.772.000,00      | GBP                  | (51.315,47)  | 18.02.2022  |
| 5.503.823,71                                      | EUR                | 6.233.000,00      | USD                  | 6.195,53   | 18.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(45.119,94)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                  |                    |                   |                      |  |             |
| 783.858,21  | EUR                | 887.000,00        | USD                  | 1.507,39   | 18.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>1.507,39</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(610.120,54)</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.752.130,76)</b>  |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Credit Default Swaps

| Basiswert                                     | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal       | Wahrung | Kosten (EUR)          | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)       | Falligkeit |
|---|--------------|-----------------|---------------|----------|-----------------------|---|-----------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b> |              |                 |               |          |                       |   |                       |             |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Kauf         | 5,00%           | 15.000.000,00 | EUR      | (1.723.232,66)        | (57.849,75)   | (1.781.082,41)        | 20.12.2026  |
|   |              |                 |               |          | <b>(1.723.232,66)</b> | <b>(57.849,75)</b>                                  | <b>(1.781.082,41)</b> |             |

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Falligkeit | Wahrung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) |
|--|-------------|----------|-------------------------------|---------------------------|--|---|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |             |          |                               |                           |  |   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | (68,00)                       | (11.653.160,00)           | 0,00   | 217.285,09  |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022  | GBP      | (79,00)                       | (9.869.470,00)            | (14.106,17)  | 201.556,62  |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022  | USD      | (120,00)                      | (15.658.125,60)           | (8.277,58)   | (60.090,87)   |
|  |             |          |                               |                           | <b>(22.383,75)</b>   | <b>358.750,84</b>   |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit fur Credit Default Swaps 1.800.000,00 EUR erhalten.

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - European Inflation Linked Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land         |              | Sektor         |              |
|--------------|--------------|----------------|--------------|
| Frankreich   | 40,30        | Staatsanleihen | 99,49        |
| Italien      | 29,60        |                |              |
| Deutschland  | 15,98        | <b>Summe</b>   | <b>99,49</b> |
| Spanien      | 13,61        |                |              |
| <b>Summe</b> | <b>99,49</b> |                |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - European Small and Mid Cap Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal   | Marktwert<br>(Anmerkung 2)                            | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal                                 | Marktwert<br>(Anmerkung 2)  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|------------------------------|---|---|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>                       |   |                              | <b>Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW)</b> |   |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                              | <b>EUR</b>  |   |                              |
| <b>CHF</b>  |   |                              | 165.131,00  | iShares STOXX Europe 600<br>Telecommunications DE                             | 3.518.115,96<br>0,66         |
| 441.912,00  | Clariant  | 8.128.728,88                 | 1,52  | <b>3.518.115,96</b>   | <b>0,66</b>                  |
| 147.400,00  | DKSH Holding  | 10.745.477,09                | 2,00  | <b>GBP</b>  |                              |
| 92.498,00   | Helvetia Holding                                      | 9.617.669,89                 | 1,79  | 921.176,00  | iShares FTSE 250 UCITS ETF   |
| 572.016,00  | SIG Combibloc Group                                   | 14.099.373,62                | 2,63  | 24.190.170,44   | 4,51                         |
| 15.573,00   | Tecan Group   | 8.375.092,06                 | 1,56  | <b>24.190.170,44</b>  | <b>4,51</b>                  |
| 33.415,00   | Temenos   | 4.077.721,48                 | 0,76  | <b>Summe Organismen für<br/>gemeinsame Anlagen in<br/>Wertpapieren (OGAW)</b> | <b>27.708.286,40</b>         |
|   |   | <b>55.044.063,02</b>         | <b>10,27</b>  |   | <b>5,17</b>                  |
| <b>DKK</b>  |   |                              | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>                                  |   |                              |
| 60.351,00   | DSV A/S   | 12.396.776,18                | 2,31  | <b>527.525.547,77</b>   | <b>98,43</b>                 |
|   |   | <b>12.396.776,18</b>         | <b>2,31</b>   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>10.664.109,09</b>         |
| <b>EUR</b>  |   |                              | <b>1,99</b>   |   |                              |
| 520.827,00  | Allfunds Group  | 9.008.223,79                 | 1,68  | <b>Sonstige</b>   |                              |
| 171.362,00  | Alstom  | 5.349.921,64                 | 1,00  | <b>Nettverbindlichkeiten</b>  | <b>(2.231.893,08)</b>        |
| 200.265,00  | Amplifon  | 9.502.574,25                 | 1,77  |   | <b>(0,42)</b>                |
| 478.965,00  | Ariston Holding                                       | 4.856.705,10                 | 0,91  | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>535.957.763,78</b>        |
| 2.031.446,00  | Bankinter   | 9.159.790,01                 | 1,71  |   | <b>100,00</b>                |
| 164.366,00  | CTS Eventim   | 10.578.595,76                | 1,97  |   |                              |
| 25.011,00   | DiaSorin  | 4.188.091,95                 | 0,78  |   |                              |
| 181.640,00  | Edenred   | 7.369.134,80                 | 1,37  |   |                              |
| 757.193,00  | FinecoBank Banca Fineco                               | 11.687.273,96                | 2,18  |   |                              |
| 340.389,00  | Grand City Properties                                 | 7.107.322,32                 | 1,33  |   |                              |
| 64.927,00   | IMCD  | 12.641.286,90                | 2,36  |   |                              |
| 242.499,00  | Konecranes  | 8.526.264,84                 | 1,59  |   |                              |
| 4.167.549,00  | Linea Directa Aseguradora SA Cia<br>de Seguros y Reas | 6.703.502,57                 | 1,25  |   |                              |
| 1.430.814,00  | Mediobanca Banca di Credito<br>Finanziario            | 14.465.529,54                | 2,70  |   |                              |
| 943.035,00  | Metso Outotec Oyj                                     | 8.815.491,18                 | 1,64  |   |                              |
| 2.006.205,00  | NOS SGPS  | 6.841.159,05                 | 1,28  |   |                              |
| 162.623,00  | Orpea   | 14.327.086,30                | 2,67  |   |                              |
| 2.806.380,00  | Pirelli & C   | 17.141.369,04                | 3,20  |   |                              |
| 196.019,00  | QIAGEN  | 9.602.970,81                 | 1,79  |   |                              |
| 85.925,00   | Reply   | 15.354.797,50                | 2,86  |   |                              |
| 432.938,00  | SPIE  | 9.836.351,36                 | 1,84  |   |                              |
| 142.287,00  | Stabilus  | 9.184.625,85                 | 1,71  |   |                              |
| 138.861,00  | Stroer  | 9.623.067,30                 | 1,80  |   |                              |
| 58.116,00   | Symrise   | 7.572.514,80                 | 1,41  |   |                              |
| 64.520,00   | Teleperformance                                       | 25.291.840,00                | 4,72  |   |                              |
| 206.513,00  | Viscofan  | 11.750.589,70                | 2,19  |   |                              |
| 223.691,00  | Aalberts  | 13.032.237,66                | 2,43  |   |                              |
|   |   | <b>279.518.317,98</b>        | <b>52,15</b>  |   |                              |
| <b>GBP</b>  |   |                              | <b>0,49</b>   |   |                              |
| 469.999,00  | Alpha Financial Markets<br>Consulting                 | 2.629.575,22                 | 0,49  |   |                              |
| 988.014,00  | Bridgepoint Group                                     | 5.798.301,89                 | 1,08  |   |                              |
| 96.755,00   | Croda International                                   | 11.628.641,54                | 2,17  |   |                              |
| 184.026,00  | Diploma   | 7.391.201,98                 | 1,38  |   |                              |
| 2.483.986,00  | DS Smith  | 11.348.668,76                | 2,12  |   |                              |
| 486.001,00  | IMI   | 10.043.329,00                | 1,87  |   |                              |
| 2.134.365,00  | Informa   | 13.125.440,82                | 2,45  |   |                              |
| 1.768.900,00  | Phoenix Group Holdings                                | 13.754.356,09                | 2,57  |   |                              |
| 3.162.987,00  | Rotork  | 13.449.299,44                | 2,51  |   |                              |
| 1.051.840,00  | St James's Place                                      | 21.076.430,37                | 3,93  |   |                              |
| 585.561,00  | Watches of Switzerland Group                          | 9.898.087,62                 | 1,85  |   |                              |
|   |   | <b>120.143.332,73</b>        | <b>22,42</b>  |   |                              |
| <b>NOK</b>  |   |                              | <b>1,05</b>   |   |                              |
| 96.497,00   | Bakkafrost  | 5.640.574,86                 | 1,05  |   |                              |
| 107.458,00  | Tomra Systems   | 6.791.448,08                 | 1,27  |   |                              |
|   |   | <b>12.432.022,94</b>         | <b>2,32</b>   |   |                              |
| <b>SEK</b>  |   |                              | <b>0,95</b>   |   |                              |
| 832.395,00  | Electrolux Professional B                             | 5.094.994,38                 | 0,95  |   |                              |
| 311.621,00  | Hemnet Group  | 5.085.377,23                 | 0,95  |   |                              |
| 530.299,00  | AAK   | 10.102.376,91                | 1,88  |   |                              |
|   |   | <b>20.282.748,52</b>         | <b>3,78</b>   |   |                              |
| <b>Summe Aktien</b>   |   |                              | <b>499.817.261,37</b>   |   |                              |
|   |   | <b>93,26</b>                 |   |   |                              |
| <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> |   |                              | <b>499.817.261,37</b>   |   |                              |
|   |   | <b>93,26</b>                 |   |   |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Small and Mid Cap Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| Vereinigtes Königreich | 24,10        | Industriemaschinen                                  | 11,07        |
| Italien                | 13,50        | Forschungs- und Beratungsleistungen                 | 7,21         |
| Frankreich             | 11,60        | Vermögensverwaltung und Depotbanken                 | 6,70         |
| Schweiz                | 10,27        | Verschiedene Banken                                 | 6,59         |
| Niederlande            | 7,49         | Offene Aktienfonds                                  | 5,17         |
| Deutschland            | 5,84         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 5,13         |
| Spanien                | 5,15         | Spezialchemikalien                                  | 5,10         |
| Irland                 | 4,51         | Papierverpackungen                                  | 4,75         |
| Schweden               | 3,78         | Werbung   | 4,24         |
| Finnland               | 3,24         | Handelsgesellschaften und Großhändler               | 3,74         |
| Luxemburg              | 3,04         | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen      | 3,35         |
| Dänemark               | 2,31         | Reifen und Gummi                                    | 3,20         |
| Portugal               | 1,28         | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen           | 2,86         |
| Norwegen               | 1,27         | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 2,67         |
| Färöer                 | 1,05         | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 2,64         |
|                        |              | Lebens- und Krankenversicherung                     | 2,57         |
| <b>Summe</b>           | <b>98,43</b> | Luftfracht und Logistik                             | 2,31         |
|                        |              | Filme und Entertainment                             | 1,97         |
|                        |              | Spezialgeschäfte                                    | 1,85         |
|                        |              | Verschiedene Support-Leistungen                     | 1,84         |
|                        |              | Mehrsparversicherungen                              | 1,79         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Vertrieb                          | 1,77         |
|                        |              | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 1,37         |
|                        |              | Immobilien: REOC                                    | 1,33         |
|                        |              | Integrierte Telekommunikationsdienste               | 1,28         |
|                        |              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 1,27         |
|                        |              | Sach- und Unfallversicherung                        | 1,25         |
|                        |              | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 0,95         |
|                        |              | Haushaltsgeräte                                     | 0,91         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 0,78         |
|                        |              | Anwendungssoftware                                  | 0,76         |
|                        |              | <b>Summe</b>  | <b>98,43</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - European Stars Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |
| <b>CHF</b>  |   |                            |                              |
| 20.644,00   | Lonza Group   | 15.221.380,02              | 1,97                         |
| 412.291,00  | Nestle  | 50.867.788,90              | 6,59                         |
| 33.341,00   | Zur Rose Group  | 7.601.560,84               | 0,98                         |
|   |   | <b>73.690.729,76</b>       | <b>9,54</b>                  |
| <b>DKK</b>  |   |                            |                              |
| 67.666,00   | DSV A/S   | 13.899.359,70              | 1,80                         |
| 677.755,00  | ISS   | 11.392.677,77              | 1,48                         |
| 247.377,00  | Novo Nordisk B  | 24.450.611,68              | 3,17                         |
| 547.676,00  | Vestas Wind Systems   | 14.729.797,50              | 1,91                         |
|   |   | <b>64.472.446,65</b>       | <b>8,35</b>                  |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |
| 125.083,00  | Air Liquide   | 19.177.725,56              | 2,48                         |
| 479.461,00  | Alstom  | 14.968.772,42              | 1,94                         |
| 52.039,00   | ASML Holding  | 36.775.961,30              | 4,76                         |
| 1.235.377,00  | AXA   | 32.348.346,75              | 4,19                         |
| 365.730,00  | BNP Paribas   | 22.225.412,10              | 2,88                         |
| 1.129.092,00  | Deutsche Telekom  | 18.404.199,60              | 2,38                         |
| 2.754.923,00  | Enel  | 19.411.187,46              | 2,51                         |
| 358.528,00  | Fresenius   | 12.691.891,20              | 1,64                         |
| 354.001,00  | Infineon Technologies   | 14.429.080,76              | 1,87                         |
| 831.485,00  | ING Groep   | 10.179.039,37              | 1,32                         |
| 178.257,00  | Just Eat Takeaway.com   | 8.640.116,79               | 1,12                         |
| 152.878,00  | Kerry Group   | 17.313.433,50              | 2,24                         |
| 112.769,00  | KION Group  | 10.879.953,12              | 1,41                         |
| 545.889,00  | Koninklijke Philips   | 17.886.053,09              | 2,32                         |
| 124.290,00  | Puma  | 13.361.175,00              | 1,73                         |
| 508.640,00  | Sampo A   | 22.410.678,40              | 2,90                         |
| 384.640,00  | Sanofi  | 34.071.411,20              | 4,41                         |
| 156.337,00  | SAP   | 19.526.491,30              | 2,53                         |
| 131.601,00  | Schneider Electric  | 22.695.908,46              | 2,94                         |
| 998.091,00  | Stora Enso R  | 16.109.188,74              | 2,09                         |
| 1.515.311,00  | UniCredit   | 20.523.372,18              | 2,66                         |
| 581.590,00  | Unilever  | 27.366.717,45              | 3,54                         |
| 547.375,00  | Valeo   | 14.549.227,50              | 1,88                         |
| 109.792,00  | Zalando   | 7.810.602,88               | 1,01                         |
|   |   | <b>453.755.946,13</b>      | <b>58,77</b>                 |
| <b>GBP</b>  |   |                            |                              |
| 649.409,00  | Antofagasta   | 10.347.310,58              | 1,34                         |
| 350.995,00  | AstraZeneca   | 36.258.629,24              | 4,70                         |
| 333.612,00  | AVEVA Group   | 13.518.298,16              | 1,75                         |
| 2.210.007,00  | Informa   | 13.590.607,09              | 1,76                         |
| 6.998.966,00  | Legal & General Group   | 24.786.297,59              | 3,21                         |
| 53.188.843,00   | Lloyds Banking Group  | 30.264.900,17              | 3,92                         |
|   |   | <b>128.766.042,83</b>      | <b>16,68</b>                 |
| <b>NOK</b>  |   |                            |                              |
| 3.841.401,00  | Norsk Hydro   | 26.748.145,75              | 3,46                         |
|   |   | <b>26.748.145,75</b>       | <b>3,46</b>                  |
| <b>SEK</b>  |   |                            |                              |
| 623.141,00  | SKF B   | 13.038.094,96              | 1,69                         |
| 2.746.499,00  | SSAB B  | 12.219.122,92              | 1,58                         |
|   |   | <b>25.257.217,88</b>       | <b>3,27</b>                  |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>772.690.529,00</b>      | <b>100,07</b>                |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>772.690.529,00</b>      | <b>100,07</b>                |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>772.690.529,00</b>      | <b>100,07</b>                |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>2.371.003,26</b>        | <b>0,31</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(2.913.921,46)</b>      | <b>(0,38)</b>                |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>772.147.610,80</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - European Stars Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |               | Sektor  |               |
|------------------------|---------------|---|---------------|
| Frankreich             | 20,73         | Pharmazeutika                                       | 12,27         |
| Vereinigtes Königreich | 20,22         | Verschiedene Banken                                 | 10,77         |
| Deutschland            | 12,58         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 8,83          |
| Schweiz                | 9,54          | Mehrspartenversicherungen                           | 7,09          |
| Niederlande            | 9,52          | Halbleiter-Ausrüstung                               | 4,76          |
| Dänemark               | 8,35          | Anwendungssoftware                                  | 4,28          |
| Italien                | 5,17          | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 3,54          |
| Finnland               | 4,99          | Aluminium   | 3,46          |
| Norwegen               | 3,46          | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 3,35          |
| Schweden               | 3,27          | Lebens- und Krankenversicherung                     | 3,21          |
| Irland                 | 2,24          | Elektrische Komponenten und Ausrüstung              | 2,94          |
| <b>Summe</b>           | <b>100,07</b> | Stromversorger                                      | 2,51          |
|                        |               | Industriegase                                       | 2,48          |
|                        |               | Integrierte Telekommunikationsdienste               | 2,38          |
|                        |               | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 2,32          |
|                        |               | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 2,13          |
|                        |               | Papierprodukte                                      | 2,09          |
|                        |               | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen      | 1,97          |
|                        |               | Elektrische Anlagen                                 | 1,91          |
|                        |               | Autoteile und -zubehör                              | 1,88          |
|                        |               | Halbleiter  | 1,87          |
|                        |               | Luffracht und Logistik                              | 1,80          |
|                        |               | Werbung   | 1,76          |
|                        |               | Schuhe  | 1,73          |
|                        |               | Industriemaschinen                                  | 1,69          |
|                        |               | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  | 1,64          |
|                        |               | Stahl   | 1,58          |
|                        |               | Verschiedene Support-Leistungen                     | 1,48          |
|                        |               | Kupfer  | 1,34          |
|                        |               | Arzneimittel-Einzelhandel                           | 0,98          |
|                        |               | <b>Summe</b>  | <b>100,07</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - European Stars Equity Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 210.416,07  | CHF               | 200.727,25         | EUR                | 3.016,23   | 28.01.2022 |
| 17.029,37   | EUR               | 17.756,22          | CHF                | (163,74)   | 28.01.2022 |
| 37.538,72   | EUR               | 42.413,25          | USD                | 113,49   | 28.01.2022 |
| 500.312,12  | USD               | 444.022,12         | EUR                | (2.550,05)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>415,93</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Flexible Credit Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>CHF</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 550.000,00  | Aryzta AG FRN Perpetual                         | 517.838,66                 | 0,64                         |                    |   |                            |                              |
| 400.000,00  | Aryzta AG FRN Perpetual                         | 341.013,77                 | 0,42                         |                    |   |                            |                              |
|   |   | <b>858.852,43</b>          | <b>1,06</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.200.000,00  | ABN AMRO Bank NV 4.750% MULTI Perp FC2027       | 1.299.266,40               | 1,60                         | 775.000,00         | Kronos International Inc 3.75% 15-09-2025       | 784.366,65                 | 0,97                         |
| 900.000,00  | Aegon NV 5.625% MULTI Perp FC2029               | 1.063.800,00               | 1,31                         | 200.000,00         | Laboratoire Eimer Setas 5% 01-02-2029           | 202.250,00                 | 0,25                         |
| 1.450.000,00  | Ahlstrom-Munksjo Holding 3 O 3.625% 04-02-2028  | 1.450.435,00               | 1,79                         | 575.000,00         | Lloyds Banking Group P 6.375% MULTI Perp FC2020 | 625.542,50                 | 0,77                         |
| 1.275.000,00  | Allied Universal Holdco LLC/ 3.625% 01-06-2028  | 1.245.037,50               | 1,54                         | 700.000,00         | Lorca Telecom Bondco SA 4% 18-09-2027           | 711.375,00                 | 0,88                         |
| 1.025.000,00  | Altice Financing SA 4.25% 15-08-2029            | 1.001.425,00               | 1,24                         | 750.000,00         | Mangrove Luxco III Sarl 09-10-2025              | 716.273,44                 | 0,88                         |
| 725.000,00  | Altice France Holding SA 8% 15-05-2027          | 766.019,05                 | 0,94                         | 750.000,00         | Matterhorn Telecom SA 4% 15-11-2027             | 765.000,00                 | 0,94                         |
| 550.000,00  | Altice France SA/France 4.125% 15-01-2029       | 545.875,00                 | 0,67                         | 475.000,00         | Maxeda DIY Holding BV 5.875% 01-10-2026         | 483.736,20                 | 0,60                         |
| 900.000,00  | APCOA Parking Holdings GmbH 4.625% 15-01-2027   | 891.000,00                 | 1,10                         | 375.000,00         | Midco GB SASU 7.75% P-I-K 01-11-2027            | 384.375,00                 | 0,47                         |
| 125.000,00  | APCOA Parking Holdings GmbH FRN 15-01-2027      | 125.500,00                 | 0,15                         | 500.000,00         | MILPK 1X D                                      | 482.158,50                 | 0,59                         |
| 750.000,00  | ARBR 6X E                                       | 747.787,50                 | 0,92                         | 650.000,00         | Motion Finco Sarl 7% 15-05-2025                 | 679.250,00                 | 0,84                         |
| 600.000,00  | ARBR 8X ER                                      | 591.622,20                 | 0,73                         | 1.300.000,00       | NH Hotel Group SA 4% 02-07-2026                 | 1.290.250,00               | 1,59                         |
| 425.000,00  | Arena Luxembourg Finance Sarl 1.875% 01-02-2028 | 400.562,50                 | 0,49                         | 1.150.000,00       | Nidda Healthcare Holding GmbH 3.5% 30-09-2024   | 1.146.987,00               | 1,41                         |
| 1.000.000,00  | ARESE 13X D                                     | 991.093,00                 | 1,22                         | 175.000,00         | Novelis Sheet Ingot GmbH 3.375% 15-04-2029      | 179.760,00                 | 0,22                         |
| 500.000,00  | ARMDA 2X E                                      | 475.546,00                 | 0,59                         | 575.000,00         | Olympus Water US Holding Cor 3.875% 01-10-2028  | 576.437,50                 | 0,71                         |
| 350.000,00  | Bach Bidco SpA FRN 15-10-2028                   | 352.457,00                 | 0,43                         | 1.725.000,00       | Ontex Group NV 3.5% 15-07-2026                  | 1.639.095,00               | 2,02                         |
| 2.314.000,00  | BCCE 2019-1X D                                  | 2.313.386,79               | 2,85                         | 150.000,00         | PCF GmbH 4.75% 15-04-2026                       | 154.687,50                 | 0,19                         |
| 750.000,00  | Belden Inc 3.375% 15-07-2031                    | 769.612,50                 | 0,95                         | 225.000,00         | PCF GmbH FRN 15-04-2026                         | 228.271,05                 | 0,28                         |
| 200.000,00  | Brunello Bidco SpA 3.5% 15-02-2028              | 197.977,60                 | 0,24                         | 1.000.000,00       | PENTA 2020-8X ER                                | 976.576,00                 | 1,20                         |
| 975.000,00  | Burger King France SAS FRN 01-11-2026           | 987.187,50                 | 1,22                         | 625.000,00         | Pinnacle Bidco PLC 5.5% 15-02-2025              | 636.718,75                 | 0,79                         |
| 150.000,00  | CAB SELAS 3.375% 01-02-2028                     | 149.799,90                 | 0,18                         | 350.000,00         | PRVD 5X E                                       | 331.669,10                 | 0,41                         |
| 400.000,00  | Chrome Bidco SASU 3.5% 31-05-2028               | 403.000,00                 | 0,50                         | 775.000,00         | Q-Park Holding I BV 1.5% 01-03-2025             | 745.945,25                 | 0,92                         |
| 275.000,00  | Chrome Holdco SASU 5% 31-05-2029                | 275.000,00                 | 0,34                         | 750.000,00         | Renk AG/Frankfurt am Main 5.75% 15-07-2025      | 778.875,00                 | 0,96                         |
| 850.000,00  | CIFCE 4X E                                      | 823.342,30                 | 1,02                         | 1.527.760,00       | Selecta Group BV 01-04-2026                     | 1.548.002,82               | 1,91                         |
| 1.150.000,00  | CONTE 4X E                                      | 1.131.087,10               | 1,40                         | 603.688,00         | Selecta Group BV 01-07-2026                     | 594.632,68                 | 0,73                         |
| 300.000,00  | CONTE 8X FR                                     | 287.805,00                 | 0,36                         | 212.408,00         | Selecta Group FinCo S.A. 01-10-2026             | 184.556,44                 | 0,23                         |
| 400.000,00  | Coöperatieve Rabobank 3.250% MULTI Perp FC2026  | 409.755,20                 | 0,51                         | 424.814,00         | Selecta Group FinCo S.A. 01-10-2026             | 369.111,14                 | 0,46                         |
| 600.000,00  | Coöperatieve Rabobank 4.375% MULTI Perp FC2027  | 660.000,00                 | 0,81                         | 550.000,00         | SNDPE 4X E                                      | 532.492,95                 | 0,66                         |
| 1.050.000,00  | Coty Inc 3.875% 15-04-2026                      | 1.070.462,40               | 1,32                         | 525.000,00         | SNDPE 5X E                                      | 507.350,03                 | 0,63                         |
| 150.000,00  | Coty Inc 4% 15-04-2023                          | 150.300,00                 | 0,19                         | 700.000,00         | TI Automotive Finance PLC 3.75% 15-04-2029      | 706.125,00                 | 0,87                         |
| 100.000,00  | CRC Breeze Finance SA 08-05-2026                | 11.381,65                  | 0,01                         | 550.000,00         | TK Elevator Midco GmbH 4.375% 15-07-2027        | 567.813,40                 | 0,70                         |
| 1.000.000,00  | CRC Breeze Finance SA 5.29% 08-05-2026          | 270.720,00                 | 0,33                         | 150.000,00         | TK Elevator Midco GmbH FRN 15-07-2027           | 151.406,40                 | 0,19                         |
| 750.000,00  | DERPK 1X ER                                     | 739.338,00                 | 0,91                         | 1.000.000,00       | Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15-08-2026   | 1.011.660,00               | 1,25                         |
| 1.225.000,00  | DKT Finance Aps 7% 17-06-2023                   | 1.238.965,00               | 1,53                         | 425.000,00         | Verde Bidco SpA 4.625% 01-10-2026               | 434.137,50                 | 0,54                         |
| 1.675.000,00  | Dufry One BV 2% 15-02-2027                      | 1.551.468,75               | 1,91                         | 850.000,00         | Verisure Holding AB 3.875% 15-07-2026           | 864.875,00                 | 1,07                         |
| 775.000,00  | eircom Finance DAC 2.625% 15-02-2027            | 760.313,75                 | 0,94                         | 700.000,00         | Verisure Midholding AB 5.25% 15-02-2029         | 709.042,60                 | 0,87                         |
| 625.000,00  | Fastighets AB Balder 2.873% MULTI 02-06-2081    | 595.500,00                 | 0,73                         | 350.000,00         | Virgin Media Finance PLC 3.75% 15-07-2030       | 349.423,90                 | 0,43                         |
| 225.000,00  | Flamingo Lux II SCA 5% 31-03-2029               | 219.093,75                 | 0,27                         | 500.000,00         | Vmed O2 UK Financing I PLC 3.25% 31-01-2031     | 495.625,00                 | 0,61                         |
| 1.300.000,00  | Foncia Management SASU 3.375% 31-03-2028        | 1.276.545,40               | 1,57                         | 700.000,00         | WEPA Hygieneprodukte GmbH 2.875% 15-12-2027     | 663.565,00                 | 0,82                         |
| 1.600.000,00  | Grupo Antolin-Irausa SA 3.5% 30-04-2028         | 1.504.000,00               | 1,86                         | 525.000,00         | WEPA Hygieneprodukte GmbH FRN 15-12-2026        | 505.102,50                 | 0,62                         |
| 1.425.000,00  | Guala Closures SpA 3.25% 15-06-2028             | 1.396.500,00               | 1,72                         | 1.000.000,00       | WILPK 1X D                                      | 956.846,00                 | 1,18                         |
| 1.000.000,00  | HARVT 25X ER                                    | 981.952,00                 | 1,21                         | 675.000,00         | Wp/ap Telecom Holdings III B 5.5% 15-01-2030    | 685.968,75                 | 0,85                         |
| 425.000,00  | Heimstaden Bostad AB 3.000% MULTI Perp FC2027   | 406.300,00                 | 0,50                         | 700.000,00         | Ziggo Bond Co BV 3.375% 28-02-2030              | 681.660,00                 | 0,84                         |
| 650.000,00  | Herens Midco Sarl 5.25% 15-05-2029              | 610.132,90                 | 0,75                         |                    |   | <b>62.178.038,94</b>       | <b>76,70</b>                 |
| 450.000,00  | HNLY 1X ER                                      | 440.964,00                 | 0,54                         | <b>GBP</b>         |   |                            |                              |
| 1.000.000,00  | International Design Group S 6.5% 15-11-2025    | 1.032.756,00               | 1,27                         | 325.000,00         | Allied Universal Holdco LLC/ 4.875% 01-06-2028  | 374.788,18                 | 0,46                         |
| 525.000,00  | Jyske Bank A/S 3.625% MULTI Perp FC2028         | 526.968,75                 | 0,65                         | 900.000,00         | Arqiva Broadcast Finance PLC 6.75% 30-09-2023   | 1.084.746,72               | 1,34                         |
|   |   |                            |                              | 225.000,00         | B&M European Value Retail SA 4% 15-11-2028      | 268.508,29                 | 0,33                         |
|   |   |                            |                              | 1.075.000,00       | Constellation Automotive Fin 4.875% 15-07-2027  | 1.258.815,09               | 1,55                         |
|   |   |                            |                              | 650.000,00         | CPUK Finance Ltd 4.875% 28-08-2025              | 773.756,24                 | 0,95                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Credit Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 600.000,00         | Heathrow Finance PLC 5.25%<br>01-03-2024  | 729.416,91                 | 0,90                         |
| 300.000,00         | Heathrow Finance PLC MULTI<br>01-09-2029  | 351.225,81                 | 0,43                         |
| 400.000,00         | Legal & General Group 5.625%<br>MULTI Perp FC2031   | 524.368,65                 | 0,65                         |
| 200.000,00         | Lloyds Banking Group P 5.125%<br>MULTI Perp FC2024  | 247.006,80                 | 0,30                         |
| 725.000,00         | Natwest Group PLC 4.500%<br>MULTI Perp FC2028   | 857.667,72                 | 1,06                         |
| 475.000,00         | Pinnacle Bidco PLC 6.375%<br>15-02-2025   | 570.639,27                 | 0,70                         |
| 675.000,00         | TalkTalk Telecom Group Ltd<br>3.875% 20-02-2025   | 764.232,19                 | 0,94                         |
| 800.000,00         | Thames Water Kemble Finance<br>4.625% 19-05-2026  | 971.224,54                 | 1,20                         |
| 650.000,00         | Virgin Media Secured Finance<br>4.25% 15-01-2030  | 765.074,69                 | 0,94                         |
| 375.000,00         | Vmed O2 UK Financing I PLC 4%<br>31-01-2029   | 437.246,67                 | 0,54                         |
| 800.000,00         | William Hill Ltd 4.75% 01-05-2026   | 980.884,83                 | 1,21                         |
| 550.000,00         | William Hill Ltd 4.875% 07-09-<br>2023  | 670.430,02                 | 0,83                         |
|                    |   | <b>11.630.032,62</b>       | <b>14,35</b>                 |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 1.075.000,00       | Credit Suisse Group AG 6.375%<br>MULTI Perp FC2026  | 1.022.941,77               | 1,26                         |
| 400.000,00         | EFG International AG 5.500%<br>MULTI Perp FC2027  | 364.808,19                 | 0,45                         |
| 1.000.000,00       | Telenet Finance Luxembourg N<br>5.5% 01-03-2028   | 909.371,83                 | 1,12                         |
|                    |   | <b>2.297.121,79</b>        | <b>2,83</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>76.964.045,78</b>       | <b>94,93</b>                 |
|                    | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>76.964.045,78</b>       | <b>94,93</b>                 |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 200.000,00         | Adevinta ASA 3% 15-11-2027  | 204.720,00                 | 0,25                         |
| 425.000,00         | Brunello Bidco SpA FRN 15-02-<br>2028   | 424.161,90                 | 0,52                         |
| 300.000,00         | Elior Group SA 3.75% 15-07-2026   | 306.675,00                 | 0,38                         |
|                    |   | <b>935.556,90</b>          | <b>1,15</b>                  |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 325.000,00         | Akumin Escrow Inc 7.5% 01-08-<br>2028   | 268.808,99                 | 0,33                         |
| 375.000,00         | Akumin Inc 7% 01-11-2025  | 315.090,72                 | 0,39                         |
| 325.000,00         | Altice France SA/France 5.125%<br>15-01-2029  | 279.592,11                 | 0,34                         |
| 600.000,00         | DKT Finance ApS 9.375% 17-<br>06-2023   | 535.049,66                 | 0,66                         |
| 50.000,00          | Kobe US Midco 2 Inc 9.25% P-I-K<br>01-11-2026   | 44.700,29                  | 0,06                         |
|                    |   | <b>1.443.241,77</b>        | <b>1,78</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>2.378.798,67</b>        | <b>2,93</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>2.378.798,67</b>        | <b>2,93</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>79.342.844,45</b>       | <b>97,87</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>792.620,83</b>          | <b>0,98</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>934.954,72</b>          | <b>1,15</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>81.070.420,00</b>       | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Credit Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| Vereinigtes Königreich | 16,07        | Unternehmensanleihen | 97,87        |
| Irland                 | 15,96        |                      |              |
| Niederlande            | 14,64        | <b>Summe</b>         | <b>97,87</b> |
| Luxemburg              | 8,85         |                      |              |
| Deutschland            | 6,65         |                      |              |
| Frankreich             | 5,93         |                      |              |
| Italien                | 4,73         |                      |              |
| Spanien                | 4,32         |                      |              |
| USA                    | 4,19         |                      |              |
| Schweden               | 3,18         |                      |              |
| Dänemark               | 2,84         |                      |              |
| Schweiz                | 2,77         |                      |              |
| Belgien                | 2,02         |                      |              |
| Länderübergreifend     | 2,00         |                      |              |
| Finnland               | 1,79         |                      |              |
| Jersey                 | 0,95         |                      |              |
| Kanada                 | 0,72         |                      |              |
| Norwegen               | 0,25         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>97,87</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Flexible Credit Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 266.263,92  | CHF                | 253.865,99        | EUR                  | 3.954,42  | 28.01.2022  |
| 4.254,68  | EUR                | 4.435,32          | CHF                  | (39,98)   | 28.01.2022  |
| 85,90   | EUR                | 72,93             | GBP                  | (0,87)  | 28.01.2022  |
| 57,73   | EUR                | 594,47            | NOK                  | (1,75)  | 28.01.2022  |
| 603,49  | EUR                | 6.202,96          | SEK                  | (1,36)  | 28.01.2022  |
| 14.516,99   | EUR                | 16.444,84         | USD                  | 6,13  | 28.01.2022  |
| 4.604,45  | GBP                | 5.459,80          | EUR                  | 18,01   | 28.01.2022  |
| 80.962,00   | NOK                | 8.026,57          | EUR                  | 74,11   | 28.01.2022  |
| 409.505,49  | SEK                | 40.414,18         | EUR                  | (483,26)  | 28.01.2022  |
| 2.125.426,16                                      | USD                | 1.886.716,75      | EUR                  | (11.255,04)   | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(7.729,59)</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 11.000,00   | CHF                | 10.324,95         | EUR                  | 326,02  | 24.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>326,02</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 11.740.821,99                                     | EUR                | 10.082.000,00     | GBP                  | (254.619,00)  | 24.01.2022  |
| 6.669.551,81                                      | EUR                | 7.839.000,00      | USD                  | (248.220,17)  | 24.01.2022  |
| 362.000,00  | GBP                | 422.486,90        | EUR                  | 8.215,90  | 24.01.2022  |
| 126.000,00  | USD                | 109.463,31        | EUR                  | 1.728,37  | 24.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(492.894,90)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 144.000,00  | CHF                | 135.056,61        | EUR                  | 4.374,39  | 24.01.2022  |
| 47.229,60   | EUR                | 50.000,00         | CHF                  | (1.183,80)  | 24.01.2022  |
| 371.661,51  | EUR                | 313.000,00        | GBP                  | (738,95)  | 24.01.2022  |
| 503.592,44  | EUR                | 571.000,00        | USD                  | (296,65)  | 24.01.2022  |
| 1.111.000,00                                      | USD                | 958.456,15        | EUR                  | 21.974,92   | 24.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>24.129,91</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 954.105,41  | EUR                | 1.037.000,00      | CHF                  | (49.999,58)   | 24.01.2022  |
| 722.000,00  | USD                | 622.989,95        | EUR                  | 14.157,82   | 24.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(35.841,76)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                    |                   |                      |   |             |
| 104.000,00  | CHF                | 99.746,64         | EUR                  | 952,55  | 24.01.2022  |
| 77.583,54   | EUR                | 82.000,00         | CHF                  | (1.814,38)  | 24.01.2022  |
| 107.000,00  | GBP                | 125.459,88        | EUR                  | 1.847,04  | 24.01.2022  |
| 257.000,00  | USD                | 226.774,22        | EUR                  | 19,94   | 24.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>1.005,15</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| 80.028,03   | EUR                | 94.000,00         | USD                  | (2.925,20)  | 24.01.2022  |
| 1.968.000,00                                      | USD                | 1.701.387,92      | EUR                  | 35.323,69   | 24.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>32.398,49</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(470.877,09)</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(478.606,68)</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Flexible Credit Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Zinsswaps

| Beschreibung                                   | Nominal         | Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) in der<br>Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|--|-----------------|---------|--|------------|
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>  |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate -0.4490%                     | (11.000.000,00) | EUR     | 80.825,23  | 10.09.2024 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate -0.3910%                     | (7.000.000,00)  | EUR     | 129.995,58   | 10.09.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate -0.3930%                     | (8.000.000,00)  | EUR     | 152.389,09   | 30.09.2026 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate 0.9195%                      | (3.000.000,00)  | USD     | 44.347,81  | 21.05.2026 |
| Receiving floating rate USDLIB 3 months        |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate 0.4890%                      | (5.000.000,00)  | GBP     | 145.014,35   | 19.05.2026 |
| Receiving floating rate GBP-SONIA-OIS COMPOUND |                 |         |  |            |
| Paying fixed rate -0.0550%                     | (6.000.000,00)  | EUR     | 42.250,44  | 19.10.2027 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months       |                 |         |  |            |
|  |                 |         | <b>594.822,50</b>  |            |

BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Zinsswaps 520.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              | 2.300.000,00       | BPCE SFH SA 0.01% 16-10-2028                      | 2.282.547,60               | 0,07                         |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              | 2.300.000,00       | BPCE SFH SA 0.01% 18-03-2031                      | 2.244.358,40               | 0,07                         |
| <b>AUD</b>  |  |                            |                              | 13.800.000,00      | BPCE SFH SA 0.01% 29-01-2029                      | 13.675.082,40              | 0,40                         |
| 5.780.000,00  | Australia Government Bond 2.25% 21-05-2028     | 3.872.356,31               | 0,11                         | 3.500.000,00       | BPCE SFH SA 0.375% 21-02-2024                     | 3.550.687,00               | 0,10                         |
| 5.305.000,00  | Australia Government Bond 2.75% 21-11-2029     | 3.689.533,59               | 0,11                         | 2.000.000,00       | Bundesobligation 0.000000% 10-10-2025             | 2.041.999,60               | 0,06                         |
| 10.743.000,00   | Australia Government Bond 4.25% 21-04-2026     | 7.728.177,79               | 0,23                         | 30.220.131,00      | Bundesobligation 0.000000% 11-04-2025             | 30.807.066,38              | 0,90                         |
|   |  | <b>15.290.067,69</b>       | <b>0,45</b>                  | 850.466,69         | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2026 | 870.189,01                 | 0,03                         |
| <b>CAD</b>  |  |                            |                              | 64.081.410,00      | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2029 | 65.684.470,55              | 1,92                         |
| 10.990.000,00   | Canadian Government Bond 1.5% 01-06-2026       | 7.716.035,37               | 0,23                         | 33.176.774,00      | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2030 | 33.949.792,83              | 0,99                         |
| 5.456.000,00  | Canadian Government Bond 1.5% 01-06-2031       | 3.805.956,96               | 0,11                         | 1.100.000,00       | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2031 | 1.119.601,12               | 0,03                         |
| 4.070.000,00  | Canadian Government Bond 2% 01-06-2028         | 2.945.046,25               | 0,09                         | 516.127,39         | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2050 | 494.028,88                 | 0,01                         |
|   |  | <b>14.467.038,58</b>       | <b>0,42</b>                  | 9.877.010,00       | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-11-2027 | 10.122.283,81              | 0,30                         |
| <b>CHF</b>  |  |                            |                              | 2.800.000,00       | Bundesrepublik Deutschland B 0.25% 15-02-2027     | 2.902.149,60               | 0,09                         |
| 2.000.000,00  | Kommunalkredit Austria AG 2.5% 14-02-2022      | 1.942.846,58               | 0,06                         | 59.836.499,00      | Bundesrepublik Deutschland B 0.25% 15-02-2029     | 62.470.980,38              | 1,83                         |
| 4.800.000,00  | Kommunalkredit Austria AG 3.375% 22-06-2026    | 5.366.777,68               | 0,16                         | 600.000,00         | Bundesrepublik Deutschland B 0.25% 15-08-2028     | 625.618,80                 | 0,02                         |
|   |  | <b>7.309.624,26</b>        | <b>0,21</b>                  | 706.349,34         | Bundesrepublik Deutschland B 0.5% 15-02-2028      | 746.307,52                 | 0,02                         |
| <b>DKK</b>  |  |                            |                              | 95.390.000,00      | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 10-06-2022      | 95.692.386,30              | 2,80                         |
| 50.000.000,00   | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2022 SDO A E     | 6.749.408,49               | 0,20                         | 49.660.000,00      | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 15-12-2022      | 49.962.926,00              | 1,46                         |
| 67.000.000,00   | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2022 SDO AR E    | 9.044.239,90               | 0,26                         | 15.249.000,00      | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 16-06-2023      | 15.395.390,40              | 0,45                         |
| 100.000.000,00  | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2026 SDO A E     | 13.993.307,09              | 0,41                         | 189.050.000,00     | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 16-09-2022      | 189.977.857,40             | 5,57                         |
| 77.197.149,64   | Nordea Kredit 1% 04-01-2026 IO A               | 10.802.434,21              | 0,32                         | 7.400.000,00       | Caisse de Refinancement de l 0.01% 07-02-2028     | 7.368.268,80               | 0,22                         |
| 435.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 01-01-2022 SDO A H      | 58.496.829,45              | 1,71                         | 4.100.000,00       | Caisse Francaise de Financem 0.01% 18-03-2031     | 4.000.812,80               | 0,12                         |
| 150.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 01-01-2022 SDO AR H     | 20.171.320,50              | 0,59                         | 4.300.000,00       | Caisse Francaise de Financem 0.01% 22-02-2028     | 4.279.712,60               | 0,13                         |
| 50.000.000,00   | Nykredit Realkredit 1% 01-01-2027 SDO A H      | 7.014.256,79               | 0,21                         | 3.400.000,00       | Caisse Francaise de Financem 0.01% 27-04-2029     | 3.368.529,60               | 0,10                         |
| 737.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 04-01-2022 SDO AR H     | 99.486.638,95              | 2,91                         | 10.000.000,00      | Caisse Francaise de Financem 0.5% 16-01-2025      | 10.197.820,00              | 0,30                         |
| 335.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2022 SDO A H      | 45.400.301,95              | 1,33                         | 8.000.000,00       | Caisse Francaise de Financem 0.5% 19-01-2026      | 8.179.984,00               | 0,24                         |
| 124.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2025 SDO A H      | 17.297.536,69              | 0,51                         | 16.500.000,00      | Caisse Francaise de Financem 0.625% 13-04-2026    | 16.966.290,00              | 0,50                         |
| 190.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2026 SDO A H      | 26.596.295,07              | 0,78                         | 600.000,00         | Caisse Francaise de Financem 1.5% 28-06-2038      | 691.009,20                 | 0,02                         |
| 490.000.000,00  | Realkredit Danmark 1% 04-01-2022 SDRO A T      | 66.144.226,94              | 1,94                         | 9.200.000,00       | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 07-10-2026     | 9.220.825,40               | 0,27                         |
| 1.649.000.000,00  | Realkredit Danmark 1% 04-01-2022 SDRO AR T     | 222.596.407,88             | 6,52                         | 15.700.000,00      | Canadian Imperial Bank of Co 0.04% 09-07-2027     | 15.657.013,40              | 0,46                         |
| 22.802.850,36   | Realkredit Danmark 1% 04-01-2026 SDRO A T      | 3.190.207,40               | 0,09                         | 100.000,00         | Cie de Financement Foncier S 0.05% 16-04-2024     | 100.731,60                 | 0,00                         |
|   |  | <b>606.983.411,31</b>      | <b>17,78</b>                 | 27.200.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.225% 14-09-2026    | 27.498.384,00              | 0,81                         |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              | 1.600.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.75% 21-01-2025     | 1.644.169,60               | 0,05                         |
| 600.000,00  | Achmea Bank NV 0.01% 16-06-2025                | 601.447,20                 | 0,02                         | 9.600.000,00       | Cie de Financement Foncier S 1% 02-02-2026        | 10.013.337,60              | 0,29                         |
| 2.700.000,00  | Aegon Bank NV 0.01% 16-11-2025                 | 2.701.857,60               | 0,08                         | 6.700.000,00       | Cie de Financement Foncier S 1.2% 29-04-2031      | 7.261.942,40               | 0,21                         |
| 1.400.000,00  | Aegon Bank NV 0.375% 09-06-2036                | 1.370.395,60               | 0,04                         | 17.000.000,00      | Commerzbank AG 0.875% 18-04-2028                  | 17.854.896,00              | 0,52                         |
| 10.500.000,00   | Aegon Bank NV 0.375% 21-11-2024                | 10.648.344,00              | 0,31                         | 4.900.000,00       | Commonwealth Bank of Austral 0.125% 15-10-2029    | 4.844.453,60               | 0,14                         |
| 7.000.000,00  | ANZ New Zealand Int'l Ltd/Lo 0.125% 22-09-2023 | 7.055.095,39               | 0,21                         | 8.000.000,00       | Commonwealth Bank of Austral 0.375% 24-04-2023    | 8.083.520,00               | 0,24                         |
| 3.000.000,00  | Argenta Spaarbank NV 0.01% 11-02-2031          | 2.934.042,00               | 0,09                         | 2.200.000,00       | Coventry Building Society 0.01% 07-07-2028        | 2.170.357,20               | 0,06                         |
| 100.000,00  | Arkea Home Loans SFH SA 0.125% 12-07-2029      | 99.749,40                  | 0,00                         | 7.500.000,00       | CPPIB Capital Inc 0.375% 20-06-2024               | 7.613.429,25               | 0,22                         |
| 600.000,00  | AXA Bank Europe SCF 1.375% 18-04-2033          | 664.713,60                 | 0,02                         | 2.200.000,00       | Credit Agricole Home Loan SF 0.01% 03-11-2031     | 2.136.239,60               | 0,06                         |
| 900.000,00  | Bausparkasse Schwabebisch Hal 0.01% 22-10-2030 | 883.980,00                 | 0,03                         | 300.000,00         | Credit Agricole Home Loan SF 0.375% 30-09-2024    | 304.767,00                 | 0,01                         |
| 1.000.000,00  | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.01% 03-09-2029  | 988.276,00                 | 0,03                         | 7.000.000,00       | Credit Agricole Home Loan SF 0.75% 05-05-2027     | 7.267.946,00               | 0,21                         |
| 500.000,00  | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.01% 23-09-2030  | 490.037,00                 | 0,01                         | 100.000,00         | Credit Agricole Home Loan SF 1% 16-01-2029        | 106.112,80                 | 0,00                         |
| 100.000,00  | Belfius Bank SA 0.01% 01-10-2029               | 98.698,20                  | 0,00                         |                    |   |                            |                              |
| 1.000.000,00  | Belfius Bank SA 0.125% 14-09-2026              | 1.006.278,00               | 0,03                         |                    |   |                            |                              |
| 3.300.000,00  | Belfius Bank SA 0.125% 28-01-2030              | 3.279.599,40               | 0,10                         |                    |   |                            |                              |
| 300.000,00  | BPCE SFH SA 0.01% 10-11-2027                   | 298.995,00                 | 0,01                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 6.000.000,00       | Credit Agricole Public Secto 0.5%<br>10-10-2025      | 6.131.136,00               | 0,18                         | 287.766,93         | IRELAND GOVERNMENT BOND<br>1.1% 15-05-2029           | 310.847,28                 | 0,01                         |
| 18.500.000,00      | Danmarks Skibskredit 0.125%<br>03-20-2025            | 18.485.570,00              | 0,54                         | 340.687,29         | IRELAND GOVERNMENT BOND<br>1.3% 15-05-2033           | 375.914,36                 | 0,01                         |
| 2.000.000,00       | Danske Mortgage Bank PLC<br>0.01% 24-11-2026         | 2.003.708,00               | 0,06                         | 120.747,81         | Ireland Government Bond 1.35%<br>18-03-2031          | 134.457,03                 | 0,00                         |
| 28.000.000,00      | DBS Bank Ltd 0.375% 21-11-2024                       | 28.409.696,00              | 0,83                         | 83.900,00          | Ireland Government Bond 1.5%<br>15-05-2050           | 96.526,95                  | 0,00                         |
| 400.000,00         | DBS Bank Ltd 0.375% 23-01-2024                       | 405.078,40                 | 0,01                         | 182.989,10         | Ireland Government Bond 2%<br>18-02-2045             | 233.394,91                 | 0,01                         |
| 6.000.000,00       | de Volksbank NV 0.75% 18-05-<br>2027                 | 6.230.316,00               | 0,18                         | 3.580.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T<br>0.000000% 01-08-2026 | 3.510.941,80               | 0,10                         |
| 3.000.000,00       | Deutsche Bank AG 0.25% 08-<br>03-2024                | 3.036.042,00               | 0,09                         | 6.057.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T<br>0.000000% 15-08-2024 | 6.048.338,49               | 0,18                         |
| 7.000.000,00       | Deutsche Kreditbank AG 0.875%<br>02-10-2028          | 7.363.510,00               | 0,22                         | 1.972.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 0.25%<br>15-03-2028     | 1.922.949,67               | 0,06                         |
| 4.100.000,00       | DNB Boligkredit AS 0.01% 21-<br>01-2031              | 4.008.611,00               | 0,12                         | 204.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.4%<br>15-05-2030      | 233.260,94                 | 0,01                         |
| 12.300.000,00      | DNB Boligkredit AS 0.375%<br>20-11-2024              | 12.496.726,20              | 0,37                         | 1.811.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 0.6%<br>01-08-2031      | 1.723.934,82               | 0,05                         |
| 500.000,00         | DZ HYP AG 0.01% 20-04-2029                           | 496.274,00                 | 0,01                         | 2.089.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 0.85%<br>15-01-2027     | 2.129.108,80               | 0,06                         |
| 11.300.000,00      | DZ HYP AG 0.01% 29-03-2030                           | 11.139.540,00              | 0,33                         | 658.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.95%<br>15-09-2027     | 671.645,60                 | 0,02                         |
| 13.000.000,00      | DZ HYP AG 0.05% 29-06-2029                           | 12.910.950,00              | 0,38                         | 1.100.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 1.3%<br>15-05-2028      | 1.367.987,49               | 0,04                         |
| 8.000.000,00       | DZ HYP AG 0.875% 30-01-2029                          | 8.429.760,00               | 0,25                         | 243.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 1.45%<br>15-11-2024     | 519.708,00                 | 0,02                         |
| 250.000,00         | Estonia Government Internati<br>0.125% 10-06-2030    | 248.367,00                 | 0,01                         | 1.007.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 1.5%<br>30-04-2045      | 944.840,51                 | 0,03                         |
| 500.000,00         | Federation des Caisses Desja<br>0.01% 24-09-2025     | 501.162,00                 | 0,01                         | 1.472.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 1.65%<br>01-12-2030     | 1.547.671,99               | 0,05                         |
| 243.000,00         | Finland Government Bond 0.125%<br>15-04-2052         | 217.968,08                 | 0,01                         | 300.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 1.7%<br>01-09-2051      | 281.096,44                 | 0,01                         |
| 100.000,00         | Finland Government Bond 0.25%<br>15-09-2040          | 97.577,40                  | 0,00                         | 347.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 2%<br>01-12-2025        | 370.533,54                 | 0,01                         |
| 653.000,00         | Finland Government Bond 1.125%<br>15-04-2034         | 726.586,57                 | 0,02                         | 446.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 2.15%<br>01-03-2072     | 426.430,06                 | 0,01                         |
| 25.000,00          | Finland Government Bond 1.375%<br>15-04-2047         | 30.945,35                  | 0,00                         | 78.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 2.45%<br>01-10-2023     | 81.639,64                  | 0,00                         |
| 186.000,00         | Finland Government Bond 2.75%<br>04-07-2028          | 222.582,48                 | 0,01                         | 300.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 2.8%<br>01-03-2067      | 338.850,00                 | 0,01                         |
| 460.000,00         | French Republic Government B<br>0.000000% 25-11-2029 | 460.395,60                 | 0,01                         | 1.424.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 3.35%<br>01-03-2035     | 1.751.927,26               | 0,05                         |
| 1.700.000,00       | French Republic Government B<br>0.000000% 25-11-2030 | 1.684.153,28               | 0,05                         | 386.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 4%<br>01-02-2037        | 514.135,90                 | 0,02                         |
| 385.507,00         | French Republic Government B<br>0.000000% 25-11-2031 | 378.182,29                 | 0,01                         | 1.000.000,00       | Italy Certificati di Credito FRN<br>15-04-2026       | 1.005.624,16               | 0,03                         |
| 712.044,00         | French Republic Government B<br>0.1% 25-07-2031      | 873.403,49                 | 0,03                         | 612.000,00         | Kingdom of Belgium Governmen<br>0.1% 22-06-2030      | 616.345,50                 | 0,02                         |
| 850.000,00         | French Republic Government B<br>0.5% 25-05-2026      | 881.895,40                 | 0,03                         | 2.030.000,00       | Kingdom of Belgium Governmen<br>0.4% 22-06-2040      | 1.930.259,60               | 0,06                         |
| 608.000,00         | French Republic Government B<br>0.5% 25-05-2040      | 593.955,20                 | 0,02                         | 245.000,00         | Kingdom of Belgium Governmen<br>0.65% 22-06-2071     | 200.736,79                 | 0,01                         |
| 589.724,00         | French Republic Government B<br>0.5% 25-05-2072      | 456.268,28                 | 0,01                         | 474.179,53         | Kingdom of Belgium Governmen<br>0.8% 22-06-2028      | 505.626,17                 | 0,01                         |
| 353.000,00         | French Republic Government B<br>0.5% 25-06-2044      | 337.064,17                 | 0,01                         | 4.200.000,00       | Korea Housing Finance Corp<br>0.01% 05-02-2025       | 4.201.150,80               | 0,12                         |
| 396.000,00         | French Republic Government B<br>0.75% 25-05-2052     | 378.645,30                 | 0,01                         | 37.000.000,00      | La Banque Postale Home Loan<br>0.01% 22-10-2029      | 36.513.746,00              | 1,07                         |
| 663.000,00         | French Republic Government B<br>0.75% 25-11-2028     | 703.451,75                 | 0,02                         | 200.000,00         | La Banque Postale Home Loan<br>0.625% 23-06-2027     | 206.473,20                 | 0,01                         |
| 300.000,00         | French Republic Government B<br>1% 25-05-2027        | 320.868,00                 | 0,01                         | 12.200.000,00      | La Banque Postale Home Loan<br>1% 04-10-2028         | 12.923.679,60              | 0,38                         |
| 821.841,00         | French Republic Government B<br>1.5% 25-05-2031      | 927.432,78                 | 0,03                         | 600.000,00         | Land Thuringen 0.25% 05-03-<br>2040                  | 565.951,85                 | 0,02                         |
| 6.000,00           | French Republic Government B<br>1.5% 25-05-2050      | 6.959,26                   | 0,00                         | 6.300.000,00       | LHV Pank AS 0.1% 09-06-2025                          | 6.319.089,00               | 0,19                         |
| 300.000,00         | French Republic Government B<br>1.75% 25-06-2039     | 362.309,40                 | 0,01                         | 164.000,00         | Lithuania Government Interna<br>0.25% 06-05-2025     | 165.369,40                 | 0,00                         |
| 959.702,00         | French Republic Government B<br>2% 25-05-2048        | 1.234.084,64               | 0,04                         | 100.000,00         | Lloyds Bank PLC 0.125% 18-06-<br>2026                | 100.351,20                 | 0,00                         |
| 1.156.032,00       | French Republic Government B<br>5.75% 25-10-2032     | 1.846.465,18               | 0,05                         | 200.000,00         | Lloyds Bank PLC 0.125% 23-09-<br>2029                | 198.084,00                 | 0,01                         |
| 200.000,00         | HSBC Bank Canada 0.01% 14-<br>09-2026                | 199.624,00                 | 0,01                         | 800.000,00         | mBank Hipoteczny SA 0.242%<br>15-09-2025             | 804.609,60                 | 0,02                         |
| 1.400.000,00       | HYPO NOE Landesbank fuer Nie<br>0.01% 08-09-2028     | 1.387.260,00               | 0,04                         | 2.300.000,00       | MMB SCF SACA 0.01% 14-10-<br>2030                    | 2.244.188,20               | 0,07                         |
| 10.500.000,00      | Hypo Vorarlberg Bank AG 0.375%<br>17-05-2024         | 10.659.012,00              | 0,31                         | 4.850.000,00       | MMB SCF SACA 0.75% 31-10-2025                        | 4.992.531,80               | 0,15                         |
| 4.500.000,00       | ING Belgium SA 0.01% 20-02-<br>2030                  | 4.432.023,00               | 0,13                         | 2.859.000,00       | Muenchener Hypothekenbank eG<br>2.5% 04-07-2028      | 3.307.634,28               | 0,10                         |
| 4.100.000,00       | ING-DiBa AG 0.01% 07-10-2028                         | 4.083.583,60               | 0,12                         | 1.100.000,00       | Netherlands Government Bond<br>0.000000% 15-01-2024  | 1.113.695,00               | 0,03                         |
| 305.000,00         | Ireland Government Bond<br>0.000000% 18-10-2031      | 297.407,94                 | 0,01                         |                    |  |                            |                              |
| 640.000,00         | IRELAND GOVERNMENT BOND<br>0.2% 18-10-2030           | 644.006,40                 | 0,02                         |                    |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                     | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 247.604,00         | Netherlands Government Bond 0.000000% 15-07-2031  | 248.543,76                 | 0,01                         | 1.300.000,00       | State of Brandenburg 0.375% 29-01-2035           | 1.289.121,60               | 0,04                         |
| 843.561,00         | Netherlands Government Bond 0.5% 15-01-2040       | 898.140,24                 | 0,03                         | 283.000,00         | State of North Rhine-Westphalia 0.2% 27-01-2051  | 252.215,26                 | 0,01                         |
| 1.220.022,00       | Netherlands Government Bond 0.75% 15-07-2028      | 1.304.324,54               | 0,04                         | 262.000,00         | State of North Rhine-Westphalia 0.95% 10-01-2121 | 208.145,90                 | 0,01                         |
| 583.347,00         | Netherlands Government Bond 2.5% 15-01-2033       | 743.668,26                 | 0,02                         | 800.000,00         | UniCredit Bank AG 0.01% 21-05-2029               | 792.664,00                 | 0,02                         |
| 100.000,00         | Netherlands Government Bond 2.75% 15-01-2047      | 162.650,40                 | 0,00                         | 600.000,00         | UniCredit Bank AG 0.01% 28-09-2026               | 601.502,40                 | 0,02                         |
| 1.900.000,00       | OP Mortgage Bank 0.01% 19-11-2030                 | 1.865.454,20               | 0,05                         | 800.000,00         | United Overseas Bank Ltd 0.01% 01-12-2027        | 793.544,00                 | 0,02                         |
| 8.400.000,00       | PKO Bank Hipoteczny SA 0.125% 24-06-2022          | 8.408.047,20               | 0,25                         | 8.000.000,00       | Volksbank Wien AG 0.125% 19-11-2029              | 7.942.976,00               | 0,23                         |
| 3.700.000,00       | PKO Bank Hipoteczny SA 0.625% 24-01-2023          | 3.734.114,00               | 0,11                         | 3.100.000,00       | Vseobecna Uverova Banka AS 0.01% 24-03-2026      | 3.093.576,80               | 0,09                         |
| 3.200.000,00       | PKO Bank Hipoteczny SA 0.75% 27-08-2024           | 3.265.369,60               | 0,10                         | 2.300.000,00       | Westpac Banking Corp 0.01% 22-09-2028            | 2.270.468,00               | 0,07                         |
| 100.000,00         | Portugal Obrigacoes do Tesou 1% 12-04-2052        | 90.664,05                  | 0,00                         | 11.100.000,00      | Westpac Securities NZ Ltd/Lo 0.5% 17-01-2024     | 11.276.068,20              | 0,33                         |
| 500.000,00         | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 01-10-2026         | 497.546,00                 | 0,01                         | 2.000.000,00       | Yorkshire Building Society 0.01% 13-10-2027      | 1.984.004,00               | 0,06                         |
| 2.600.000,00       | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 14-09-2027         | 2.579.014,15               | 0,08                         |                    |  | <b>1.158.830.106,04</b>    | <b>33,95</b>                 |
| 645.000,00         | Republic of Austria Governme 0.000000% 20-02-2031 | 640.294,54                 | 0,02                         |                    | <b>GBP</b>                                       |                            |                              |
| 560.000,00         | Republic of Austria Governme 0.25% 20-10-2036     | 546.146,72                 | 0,02                         | 13.414.411,00      | United Kingdom Gilt 1.25% 22-07-2027             | 16.393.384,44              | 0,48                         |
| 586.000,00         | Republic of Austria Governme 0.75% 20-02-2028     | 620.931,46                 | 0,02                         | 2.803.225,00       | United Kingdom Gilt 4.75% 07-12-2030             | 4.435.550,84               | 0,13                         |
| 137.000,00         | Republic of Austria Governme 0.75% 20-03-2051     | 140.854,91                 | 0,00                         |                    |  | <b>20.828.935,28</b>       | <b>0,61</b>                  |
| 97.000,00          | Republic of Austria Governme 0.85% 30-06-2120     | 84.327,36                  | 0,00                         |                    | <b>JPY</b>                                       |                            |                              |
| 277.000,00         | Republic of Austria Governme 2.4% 23-05-2034      | 351.144,04                 | 0,01                         | 339.000.000,00     | Japan Government Ten Year Bo 0.1% 20-06-2027     | 2.623.845,84               | 0,08                         |
| 438.000,00         | Republic of Poland Governmen 0.000000% 10-02-2025 | 437.565,50                 | 0,01                         | 324.850.000,00     | Japan Government Ten Year Bo 0.1% 20-06-2029     | 2.518.859,12               | 0,07                         |
| 77.000,00          | Romanian Government Internat 1.375% 02-12-2029    | 73.431,82                  | 0,00                         | 338.800.000,00     | Japan Government Ten Year Bo 0.4% 20-09-2025     | 2.645.575,99               | 0,08                         |
| 100.000,00         | Romanian Government Internat 2.124% 16-07-2031    | 95.312,00                  | 0,00                         | 908.000.000,00     | Japan Government Ten Year Bo 0.5% 20-12-2024     | 7.079.476,27               | 0,21                         |
| 5.400.000,00       | Santander UK PLC 0.05% 12-01-2027                 | 5.394.211,20               | 0,16                         |                    |  | <b>14.867.757,22</b>       | <b>0,44</b>                  |
| 3.300.000,00       | Societe Generale SFH SA 0.01% 05-02-2031          | 3.229.300,80               | 0,09                         |                    | <b>SEK</b>                                       |                            |                              |
| 3.500.000,00       | Societe Generale SFH SA 0.25% 23-01-2024          | 3.540.390,00               | 0,10                         | 37.190.000,00      | Sweden Government Bond 0.125% 12-05-2031         | 3.592.436,40               | 0,11                         |
| 20.000,00          | Spain Government Bond 0.000000% 31-01-2025        | 20.240,04                  | 0,00                         | 35.990.000,00      | Sweden Government Bond 0.75% 12-05-2028          | 3.652.155,92               | 0,11                         |
| 5.120.000,00       | Spain Government Bond 0.000000% 31-01-2028        | 5.080.576,00               | 0,15                         | 170.000,00         | Sweden Government Bond 1.5% 13-11-2023           | 17.109,47                  | 0,00                         |
| 1.739.000,00       | Spain Government Bond 0.5% 31-10-2031             | 1.728.188,64               | 0,05                         | 122.380.000,00     | Sweden Government Bond 2.5% 12-05-2025           | 12.969.782,74              | 0,38                         |
| 55.000,00          | Spain Government Bond 1% 30-07-2042               | 53.550,48                  | 0,00                         |                    |  | <b>20.231.484,53</b>       | <b>0,59</b>                  |
| 861.000,00         | Spain Government Bond 1% 31-10-2050               | 781.512,48                 | 0,02                         |                    | <b>USD</b>                                       |                            |                              |
| 225.000,00         | Spain Government Bond 1.2% 31-10-2040             | 227.250,00                 | 0,01                         | 286.308.000,00     | United States Treasury Infla 0.25% 15-07-2029    | 305.901.042,77             | 8,96                         |
| 493.000,00         | Spain Government Bond 1.45% 31-10-2071            | 428.230,65                 | 0,01                         | 22.044.000,00      | United States Treasury Infla 0.75% 15-07-2028    | 24.557.635,93              | 0,72                         |
| 948.000,00         | Spain Government Bond 1.5% 30-04-2027             | 1.026.877,39               | 0,03                         | 90.476.000,00      | United States Treasury Infla 0.875% 15-01-2029   | 101.182.301,09             | 2,96                         |
| 444.000,00         | Spain Government Bond 1.6% 30-04-2025             | 472.906,18                 | 0,01                         | 52.590.000,00      | United States Treasury Note/ 0.5% 28-02-2026     | 45.121.439,08              | 1,32                         |
| 1.259.000,00       | Spain Government Bond 2.35% 30-07-2033            | 1.494.201,34               | 0,04                         | 96.584.700,00      | United States Treasury Note/ 0.625% 15-05-2030   | 79.697.140,93              | 2,34                         |
| 61.000,00          | Spain Government Bond 5.15% 31-10-2044            | 109.814,64                 | 0,00                         | 7.524.100,00       | United States Treasury Note/ 0.625% 15-08-2030   | 6.192.184,78               | 0,18                         |
| 2.100.000,00       | SpareBank 1 Boligkreditt AS 0.01% 22-09-2027      | 2.094.044,40               | 0,06                         | 93.560.000,00      | United States Treasury Note/ 0.75% 31-01-2028    | 79.569.676,29              | 2,33                         |
| 4.700.000,00       | SpareBank 1 Boligkreditt AS 0.125% 12-05-2031     | 4.620.241,00               | 0,14                         | 129.520.000,00     | United States Treasury Note/ 0.75% 31-05-2026    | 112.064.274,17             | 3,28                         |
| 2.500.000,00       | Sparebanken Soer Boligkredit 0.5% 06-02-2026      | 2.551.455,00               | 0,07                         | 4.804.600,00       | United States Treasury Note/ 1.125% 15-02-2031   | 4.114.653,25               | 0,12                         |
| 2.900.000,00       | Sparebanken Vest Boligkredit 0.01% 11-11-2026     | 2.899.628,80               | 0,08                         | 6.146.900,00       | United States Treasury Note/ 1.375% 15-11-2031   | 5.355.778,00               | 0,16                         |
| 2.500.000,00       | SP-Kiinnitysluottopankki Oyj 0.05% 19-06-2026     | 2.506.145,00               | 0,07                         | 2.738.900,00       | United States Treasury Note/ 1.5% 30-11-2028     | 2.427.958,14               | 0,07                         |
| 2.500.000,00       | SR-Boligkreditt AS 0.01% 08-09-2028               | 2.478.750,00               | 0,07                         | 1.730.000,00       | United States Treasury Note/ 1.625% 15-05-2026   | 1.553.643,56               | 0,05                         |
| 6.200.000,00       | SR-Boligkreditt AS 0.01% 10-03-2031               | 6.041.131,20               | 0,18                         | 185.700,00         | United States Treasury Note/ 1.625% 15-08-2029   | 166.327,82                 | 0,00                         |
|                    |   |                            |                              | 4.050.100,00       | United States Treasury Note/ 1.875% 31-07-2026   | 3.678.577,13               | 0,11                         |
|                    |   |                            |                              | 11.548.500,00      | United States Treasury Note/ 2% 15-08-2025       | 10.517.413,55              | 0,31                         |
|                    |   |                            |                              | 5.105.600,00       | United States Treasury Note/ 2.25% 15-02-2027    | 4.723.181,48               | 0,14                         |
|                    |   |                            |                              | 92.140.000,00      | United States Treasury Note/ 2.375% 30-04-2026   | 85.346.592,29              | 2,50                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 660.000,00         | United States Treasury Note/<br>2.625% 15-02-2029   | 630.094,53                 | 0,02                         |
| 180.455.000,00     | United States Treasury Note/<br>2.625% 31-01-2026   | 168.519.364,10             | 4,94                         |
| 50.700.000,00      | United States Treasury Note/<br>2.625% 31-12-2025   | 47.332.617,65              | 1,39                         |
| 30.260.000,00      | United States Treasury Note/<br>2.875% 15-05-2028   | 29.113.252,77              | 0,85                         |
| 20.740.000,00      | United States Treasury Note/<br>2.875% 30-11-2025   | 19.522.716,47              | 0,57                         |
| 93.769.900,00      | United States Treasury Note/ 3%<br>31-10-2025   | 88.570.292,29              | 2,59                         |
| 39.760.000,00      | United States Treasury Note/<br>3.125% 15-11-2028   | 39.021.125,75              | 1,14                         |
|                    |   | <b>1.264.879.283,82</b>    | <b>37,06</b>                 |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>3.123.687.708,73</b>    | <b>91,52</b>                 |
|                    | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>3.123.687.708,73</b>    | <b>91,52</b>                 |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 272.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.95%<br>01-08-2030  | 271.062,14                 | 0,01                         |
| 160.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 1.45%<br>01-03-2036  | 160.128,00                 | 0,00                         |
| 295.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 1.85%<br>01-07-2025  | 311.928,87                 | 0,01                         |
| 2.600.000,00       | Sumitomo Mitsui Banking Corp<br>0.01% 10-09-2025  | 2.593.268,24               | 0,08                         |
|                    |   | <b>3.336.387,25</b>        | <b>0,10</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>3.336.387,25</b>        | <b>0,10</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>3.336.387,25</b>        | <b>0,10</b>                  |
|                    | <b>Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren<br/>(OGAW)</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 244.038,77         | Nordea 2 - Emerging Mkt Local<br>Debt Enh Fd Y-EUR  | 20.843.351,26              | 0,61                         |
|                    |   | <b>20.843.351,26</b>       | <b>0,61</b>                  |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 562.405,00         | ISHARES JPM USD EM BND<br>UCITS ETF   | 54.008.556,85              | 1,58                         |
|                    |   | <b>54.008.556,85</b>       | <b>1,58</b>                  |
|                    | <b>Summe Organismen für<br/>gemeinsame Anlagen in<br/>Wertpapieren (OGAW)</b>   | <b>74.851.908,11</b>       | <b>2,19</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>3.201.876.004,09</b>    | <b>93,81</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>109.077.372,44</b>      | <b>3,20</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>102.160.243,10</b>      | <b>2,99</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>3.413.113.619,63</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| USA                    | 37,06        | Staatsanleihen       | 59,15        |
| Deutschland            | 18,64        | Hypothekenanleihen   | 25,34        |
| Dänemark               | 18,33        | Unternehmensanleihen | 7,12         |
| Frankreich             | 6,31         | Offene Anleihefonds  | 2,19         |
| Irland                 | 1,64         |                      |              |
| Kanada                 | 1,40         |                      |              |
| Norwegen               | 1,09         |                      |              |
| Österreich             | 0,91         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich | 0,90         |                      |              |
| Australien             | 0,89         |                      |              |
| Singapur               | 0,87         |                      |              |
| Italien                | 0,77         |                      |              |
| Niederlande            | 0,76         |                      |              |
| Luxemburg              | 0,61         |                      |              |
| Schweden               | 0,59         |                      |              |
| Neuseeland             | 0,54         |                      |              |
| Japan                  | 0,51         |                      |              |
| Polen                  | 0,49         |                      |              |
| Belgien                | 0,44         |                      |              |
| Spanien                | 0,33         |                      |              |
| Finnland               | 0,22         |                      |              |
| Estland                | 0,19         |                      |              |
| Slowakei               | 0,18         |                      |              |
| Republik Korea         | 0,12         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>93,81</b> | <b>Summe</b>         | <b>93,81</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 115.958.280,30                                    | CHF                | 110.557.541,05    | EUR                  | 1.723.577,77  | 28.01.2022  |
| 2.967.786,75                                      | EUR                | 3.093.592,81      | CHF                  | (27.695,54)   | 28.01.2022  |
| 6.651.064,63                                      | EUR                | 5.666.133,59      | GBP                  | (89.808,47)   | 28.01.2022  |
| 11.759,53   | EUR                | 118.407,91        | NOK                  | (87,80)   | 28.01.2022  |
| 5.786.472,04                                      | EUR                | 59.476.849,56     | SEK                  | (13.163,34)   | 28.01.2022  |
| 3.629.012,37                                      | EUR                | 4.093.795,84      | USD                  | 16.672,00   | 28.01.2022  |
| 10.729.513,36                                     | GBP                | 12.722.978,51     | EUR                  | 41.618,90   | 28.01.2022  |
| 22.457.256,78                                     | NOK                | 2.225.954,59      | EUR                  | 21.013,35   | 28.01.2022  |
| 2.293.018.511,74                                  | SEK                | 226.389.408,67    | EUR                  | (2.797.029,34)  | 28.01.2022  |
| 138.528.179,19                                    | USD                | 122.971.335,32    | EUR                  | (735.006,10)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.859.908,57)</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 362.984,82  | EUR                | 47134.000,00      | JPY                  | 1.614,61  | 14.01.2022  |
| 81.767.722,82                                     | EUR                | 95.040.000,00     | USD                  | (2.119.071,56)  | 14.01.2022  |
| 24.400.000,00                                     | JPY                | 185.641,51        | EUR                  | 1.430,68  | 14.01.2022  |
| 120.338.000,00                                    | USD                | 103.553.173,46    | EUR                  | 2.662.825,81  | 14.01.2022  |
| 68.331,16   | EUR                | 71.000,00         | CHF                  | (428,73)  | 28.02.2022  |
| 271.000,00  | USD                | 239.877,87        | EUR                  | (909,89)  | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>545.460,92</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 6.330.000,00                                      | AUD                | 4.681.844,38      | USD                  | (83.009,92)   | 14.01.2022  |
| 2.268.000,00                                      | CAD                | 205.918.206,00    | JPY                  | (4.315,48)  | 14.01.2022  |
| 371.127.535,61                                    | CZK                | 14.568.000,00     | EUR                  | 329.483,79  | 14.01.2022  |
| 1.603.716,37                                      | EUR                | 209.543.000,00    | JPY                  | (2.824,98)  | 14.01.2022  |
| 183.383.935,59                                    | EUR                | 210.065.532,08    | USD                  | (2.029.147,56)  | 14.01.2022  |
| 207.659.000,00                                    | JPY                | 1.595.541,27      | EUR                  | (3.445,92)  | 14.01.2022  |
| 349.513.975,00                                    | USD                | 304.957.587,22    | EUR                  | 3.538.870,19  | 14.01.2022  |
| 15.163.000,00                                     | USD                | 236.630.783,31    | ZAR                  | 314.332,34  | 14.01.2022  |
| 12.373.000,00                                     | AUD                | 8.841.876,95      | USD                  | 111.466,14  | 01.02.2022  |
| 16.108.484,39                                     | CAD                | 17.486.000,00     | AUD                  | (4.462,41)  | 01.02.2022  |
| 57.121.334,57                                     | CAD                | 39.324.000,00     | EUR                  | 314.577,71  | 01.02.2022  |
| 6.911.000,00                                      | CAD                | 626.051.456,00    | JPY                  | (3.007,69)  | 01.02.2022  |
| 4.625.000,00                                      | CAD                | 31.787.568,11     | SEK                  | 110.013,92  | 01.02.2022  |
| 30.419.000,00                                     | EUR                | 31.731.138,77     | CHF                  | (306.619,99)  | 01.02.2022  |
| 1.156.000,00                                      | EUR                | 11.916.349,02     | SEK                  | (5.924,06)  | 01.02.2022  |
| 1.583.000,00                                      | EUR                | 1.795.414,38      | USD                  | (1.137,55)  | 01.02.2022  |
| 2.028.000,00                                      | GBP                | 2.501.283,08      | CHF                  | (9.585,08)  | 01.02.2022  |
| 131.954.487,91                                    | NOK                | 14.580.000,00     | USD                  | 336.683,05  | 01.02.2022  |
| 3.333.000,00                                      | NZD                | 20.585.472,58     | SEK                  | (125,97)  | 01.02.2022  |
| 308.335.811,55                                    | SEK                | 34.065.000,00     | USD                  | 8.366,07  | 01.02.2022  |
| 65.970.000,00                                     | USD                | 7.512.534.531,00  | JPY                  | 622.562,91  | 01.02.2022  |
| 2.601.000,00                                      | USD                | 22.217.221,28     | SEK                  | 128.678,26  | 01.02.2022  |
| 6.472.000,00                                      | USD                | 491.826.696,00    | INR                  | (85.410,16)   | 22.02.2022  |
| 89.508.000,00                                     | DKK                | 12.035.372,60     | EUR                  | 1.733,72  | 28.02.2022  |
| 20.390.809,77                                     | EUR                | 209.030.296,54    | SEK                  | 15.994,25   | 28.02.2022  |
| 9.050.000,00                                      | SEK                | 880.279,73        | EUR                  | 1.853,93  | 28.02.2022  |
| 147.000,00  | CAD                | 101.033,02        | EUR                  | 908,44  | 02.03.2022  |
| 23.252.252,75                                     | EUR                | 37.104.000,00     | AUD                  | (464.371,77)  | 02.03.2022  |
| 121.644,47  | EUR                | 174.000,00        | CAD                  | 981,38  | 02.03.2022  |
| 685.544,73  | EUR                | 581.000,00        | GBP                  | (5.066,70)  | 02.03.2022  |
| 972,05  | EUR                | 9.982,00          | SEK                  | (0,89)  | 02.03.2022  |
| 2.703.032,46                                      | EUR                | 3.059.700,00      | USD                  | 4.981,09  | 02.03.2022  |
| 962.000,00  | GBP                | 1.140.229,29      | EUR                  | 3.255,77  | 02.03.2022  |
| 4.982,00  | SEK                | 483,74            | EUR                  | 1,85  | 02.03.2022  |
| 17.262.000,00                                     | USD                | 15.218.326,41     | EUR                  | 3.385,40  | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>2.839.674,08</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 4.948.000,00                                      | AUD                | 411.418.778,00    | JPY                  | 11.019,50   | 14.01.2022  |
| 51.880,00   | CAD                | 34.579,87         | EUR                  | 1.435,36  | 14.01.2022  |
| 5.593.371,81                                      | CAD                | 4.524.000,00      | USD                  | (110.204,97)  | 14.01.2022  |
| 76.520.531,70                                     | EUR                | 114.803.371,10    | CAD                  | (3.176.266,81)  | 14.01.2022  |
| 16.888.167,59                                     | EUR                | 2.195.328.000,00  | JPY                  | 56.870,04   | 14.01.2022  |
| 64.240.583,51                                     | EUR                | 74.160.261,54     | USD                  | (1.216.655,23)  | 14.01.2022  |
| 9.653.000,00                                      | GBP                | 12.934.732,34     | USD                  | 70.680,27   | 14.01.2022  |
| 20.411.964.975,00                                 | JPY                | 156.974.251,27    | EUR                  | (478.327,25)  | 14.01.2022  |
| 360.820.774,58                                    | MXN                | 15.020.470,86     | EUR                  | 523.163,96  | 14.01.2022  |
| 93.169.096,89                                     | USD                | 81.504.270,01     | EUR                  | 730.831,68  | 14.01.2022  |
| 235.444.556,55                                    | ZAR                | 13.833.405,20     | EUR                  | (829.892,09)  | 14.01.2022  |
| 8.889.283,13                                      | AUD                | 5.625.000,00      | EUR                  | 59.922,71   | 01.02.2022  |
| 5.401.000,00                                      | AUD                | 447.756.285,00    | JPY                  | 21.949,18   | 01.02.2022  |
| 6.138.521,09                                      | CAD                | 3.584.000,00      | GBP                  | (3.660,18)  | 01.02.2022  |
| 1.612.274,16                                      | CAD                | 1.869.000,00      | NZD                  | (6.681,17)  | 01.02.2022  |
| 1.536.000,00                                      | CAD                | 10.591.675,39     | SEK                  | 33.144,58   | 01.02.2022  |
| 843.813,10  | CAD                | 683.000,00        | USD                  | (17.087,28)   | 01.02.2022  |
| 2.291.000,00                                      | EUR                | 3.584.890,36      | AUD                  | (1.615,30)  | 01.02.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|---|------------|
| 177.234.508,70    | EUR               | 255.192.879,69     | CAD                | 147.775,32  | 01.02.2022 |
| 121.434.522,50    | EUR               | 102.831.968,00     | GBP                | (890.762,62)  | 01.02.2022 |
| 160.875.997,41    | EUR               | 1.574.533.605,63   | NOK                | 3.361.168,18  | 01.02.2022 |
| 17.289.000,00     | GBP               | 2.603.474.438,00   | JPY                | 610.633,67  | 01.02.2022 |
| 4.551.000,00      | GBP               | 8.940.908,25       | NZD                | 29.603,03   | 01.02.2022 |
| 30.118.774.599,00 | JPY               | 227.001.413,91     | EUR                | 3.865.796,73  | 01.02.2022 |
| 283.459.000,00    | JPY               | 22.757.505,82      | SEK                | (46.274,41)   | 01.02.2022 |
| 370.186.598,00    | JPY               | 3.266.000,00       | USD                | (44.159,69)   | 01.02.2022 |
| 86.348.777,11     | NOK               | 1.070.856.000,00   | JPY                | 430.338,52  | 01.02.2022 |
| 302.846.973,22    | NOK               | 33.636.000,00      | USD                | 619.421,70  | 01.02.2022 |
| 2.482.000,00      | NZD               | 200.176.775,00     | JPY                | (39.779,89)   | 01.02.2022 |
| 46.768.000,00     | NZD               | 287.998.232,59     | SEK                | 81.460,86   | 01.02.2022 |
| 53.852.771,52     | SEK               | 8.784.000,00       | NZD                | (38.643,90)   | 01.02.2022 |
| 13.614.000,00     | USD               | 115.598.420,80     | NOK                | 447.719,90  | 01.02.2022 |
| 60.837.229,59     | BRL               | 10.510.000,00      | USD                | 241.668,49  | 22.02.2022 |
| 1.115.240.697,50  | INR               | 14.832.103,54      | USD                | 55.498,42   | 22.02.2022 |
| 2.038.840.694,10  | RUB               | 26.927.320,09      | USD                | (45.212,78)   | 22.02.2022 |
| 203.585.000,00    | DKK               | 27.374.945,26      | EUR                | 3.325,18  | 28.02.2022 |
| 23.150.855,18     | EUR               | 172.191.000,00     | DKK                | (5.528,47)  | 28.02.2022 |
| 769.599,72        | EUR               | 18.993.267,85      | MXN                | (41.231,07)   | 01.03.2022 |
| 22.347.000,00     | AUD               | 14.092.984,77      | EUR                | 190.965,70  | 02.03.2022 |
| 2.522.000,00      | CAD               | 1.733.548,94       | EUR                | 15.405,81   | 02.03.2022 |
| 14.054.914,18     | EUR               | 22.259.000,00      | AUD                | (172.767,98)  | 02.03.2022 |
| 15.045.234,78     | EUR               | 21.912.000,00      | CAD                | (150.301,60)  | 02.03.2022 |
| 7.367.593,41      | EUR               | 7.680.000,00       | CHF                | (70.199,91)   | 02.03.2022 |
| 1.137.481,80      | EUR               | 967.000,00         | GBP                | (11.956,31)   | 02.03.2022 |
| 24.444.680,85     | EUR               | 27.638.300,00      | USD                | 73.188,14   | 02.03.2022 |
| 283.000,00        | GBP               | 333.313,82         | EUR                | 3.077,63  | 02.03.2022 |
| 962.000,00        | USD               | 848.035,84         | EUR                | 260,31  | 02.03.2022 |
|                   |                   |                    |                    | <b>4.289.115,96</b>   |            |

#### Gegenpartei: Citibank Europe PLC

|                |     |                  |     |                   |            |
|----------------|-----|------------------|-----|-------------------|------------|
| 305.777.648,78 | CZK | 12.107.000,00    | EUR | 167.237,86        | 14.01.2022 |
| 80.123.424,27  | EUR | 128.380.000,00   | AUD | (2.003.816,74)    | 14.01.2022 |
| 25.831,34      | EUR | 3.363.000,00     | JPY | 47,64             | 14.01.2022 |
| 16.515.521,54  | EUR | 19.118.000,00    | USD | (358.911,26)      | 14.01.2022 |
| 47.795.000,00  | JPY | 367.637,73       | EUR | (1.199,60)        | 14.01.2022 |
| 2.076.000,00   | USD | 2.625.808,05     | CAD | 9.542,13          | 14.01.2022 |
| 107.040.003,57 | USD | 93.269.556,19    | EUR | 1.208.706,34      | 14.01.2022 |
| 14.480.000,00  | CAD | 102.516.430,72   | NOK | (207.743,23)      | 01.02.2022 |
| 879.000,00     | EUR | 8.988.996,81     | NOK | (20.273,84)       | 01.02.2022 |
| 16.619.000,00  | GBP | 2.548.880.959,00 | JPY | 231.872,86        | 01.02.2022 |
| 858.646.002,00 | JPY | 10.652.000,00    | AUD | (230.667,90)      | 01.02.2022 |
| 401.081.000,00 | JPY | 31.637.898,63    | NOK | (90.772,08)       | 01.02.2022 |
| 531.178.380,00 | JPY | 6.943.000,00     | NZD | (109.488,02)      | 01.02.2022 |
| 89.881.000,00  | JPY | 7.101.307,71     | SEK | (3.473,79)        | 01.02.2022 |
| 76.492.717,18  | NOK | 10.733.000,00    | CAD | 204.489,13        | 01.02.2022 |
| 139.478.381,82 | TRY | 7.990.000,00     | USD | 1.695.772,08      | 22.02.2022 |
| 6.472.000,00   | USD | 491.985.260,00   | INR | (87.279,53)       | 22.02.2022 |
| 73.624.675,19  | EUR | 547.669.000,00   | DKK | (26.300,29)       | 28.02.2022 |
| 95.882,45      | EUR | 988.000,00       | SEK | (421,44)          | 28.02.2022 |
| 167.000,00     | AUD | 105.318,85       | EUR | 1.425,66          | 02.03.2022 |
| 1.227.879,10   | EUR | 1.947.000,00     | AUD | (16.621,33)       | 02.03.2022 |
| 3.889,27       | EUR | 40.000,00        | SEK | (9,56)            | 02.03.2022 |
| 125.773,24     | EUR | 142.000,00       | USD | 557,64            | 02.03.2022 |
|                |     |                  |     | <b>362.672,73</b> |            |

#### Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE

|                   |     |                   |     |                 |            |
|-------------------|-----|-------------------|-----|-----------------|------------|
| 114.538.000,00    | AUD | 77.094.840,57     | CHF | (1.372.012,49)  | 14.01.2022 |
| 2.057.000,00      | AUD | 1.494.338,51      | USD | (3.070,41)      | 14.01.2022 |
| 1.567.276,47      | EUR | 203.233.000,00    | JPY | 9.116,18        | 14.01.2022 |
| 1.341.476.064,80  | EUR | 1.591.401.600,00  | USD | (63.177.276,46) | 14.01.2022 |
| 52.839.016,01     | GBP | 61.746.000,00     | EUR | 1.134.494,06    | 14.01.2022 |
| 111.928.000,00    | JPY | 867.431,40        | EUR | (9.295,43)      | 14.01.2022 |
| 237.378.212,99    | MXN | 11.398.000,00     | USD | 165.514,61      | 14.01.2022 |
| 387.376.344,94    | USD | 328.599.803,02    | EUR | 13.318.061,49   | 14.01.2022 |
| 92.455.000,00     | USD | 10.089.678.869,00 | JPY | 4.249.374,48    | 14.01.2022 |
| 1.950.000,00      | USD | 41.714.569,65     | MXN | (75.856,02)     | 14.01.2022 |
| 26.940.000,00     | AUD | 2.145.067.866,00  | JPY | 786.904,28      | 01.02.2022 |
| 1.796.000,00      | AUD | 11.668.894,15     | SEK | 10.794,79       | 01.02.2022 |
| 66.074.374,88     | CHF | 62.259.721,73     | EUR | 1.721.479,41    | 01.02.2022 |
| 32.502.386,16     | CHF | 35.761.000,00     | USD | (80.587,07)     | 01.02.2022 |
| 203.575.702,61    | EUR | 315.416.122,11    | AUD | 1.861.416,32    | 01.02.2022 |
| 1.330.000,00      | EUR | 174.669.685,00    | JPY | (8.874,61)      | 01.02.2022 |
| 183.692.733,39    | EUR | 299.781.852,25    | NZD | 3.169.809,35    | 01.02.2022 |
| 59.324.622,51     | EUR | 69.280.658,63     | USD | (1.804.415,66)  | 01.02.2022 |
| 694.000,00        | GBP | 8.361.281,26      | NOK | (10.917,09)     | 01.02.2022 |
| 30.118.774.601,00 | JPY | 227.193.194,50    | EUR | 3.673.903,13    | 01.02.2022 |
| 30.483.902,95     | NOK | 399.147.000,00    | JPY | (9.908,89)      | 01.02.2022 |
| 5.360.000,00      | NZD | 428.563.410,00    | JPY | (57.313,37)     | 01.02.2022 |
| 83.036.124,10     | SEK | 8.408.000,00      | CHF | (44.984,53)     | 01.02.2022 |
| 55.677.982,70     | SEK | 4.602.000,00      | GBP | (45.419,34)     | 01.02.2022 |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                              | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|--|--------------------|-------------------|----------------------|--|-------------|
| 108.743.093,82                                 | USD                | 93.116.074,80     | EUR                  | 2.832.215,30   | 01.02.2022  |
| 1.908.000,00                                   | USD                | 142.638.446,98    | RUB                  | 24.480,20  | 22.02.2022  |
| 22.466.000,00                                  | DKK                | 3.020.677,73      | EUR                  | 567,79   | 28.02.2022  |
| 5.378.528,10                                   | EUR                | 40.000.000,00     | DKK                  | (703,32)   | 28.02.2022  |
| 414.415,09                                     | EUR                | 4.281.000,00      | SEK                  | (2.870,42)   | 28.02.2022  |
| 8.407.000,00                                   | SEK                | 813.825,67        | EUR                  | 5.636,90   | 28.02.2022  |
| 2.342.677,41                                   | EUR                | 2.659.000,00      | USD                  | (2.090,43)   | 01.03.2022  |
| 35.000.564,57                                  | TRY                | 2.210.235,79      | EUR                  | (30.339,83)  | 01.03.2022  |
| 9.325.000,00                                   | AUD                | 5.904.981,72      | EUR                  | 55.425,81  | 02.03.2022  |
| 143.000,00                                     | CAD                | 99.763,61         | EUR                  | (597,73)   | 02.03.2022  |
| 2.493.673,21                                   | EUR                | 3.977.000,00      | AUD                  | (48.396,59)  | 02.03.2022  |
| 307.356,74                                     | EUR                | 447.000,00        | CAD                  | (2.628,39)   | 02.03.2022  |
| 22.280.153,87                                  | EUR                | 18.983.138,00     | GBP                  | (284.475,24)   | 02.03.2022  |
| 99,25  | EUR                | 1.000,00          | NOK                  | (0,68)   | 02.03.2022  |
| 1.662,27                                       | EUR                | 17.000,00         | SEK                  | 5,28   | 02.03.2022  |
| 458.000,00                                     | GBP                | 538.675,13        | EUR                  | 5.733,07   | 02.03.2022  |
| 9.757.000,00                                   | SEK                | 944.497,45        | EUR                  | 6.530,56   | 02.03.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(34.040.570,99)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: HSBC Continental Europe SA</b> |                    |                   |                      |  |             |
| 1.158.304,47                                   | EUR                | 1.338.000,00      | USD                  | (22.675,72)  | 14.01.2022  |
| 21.000,00                                      | USD                | 18.179,67         | EUR                  | 355,90   | 14.01.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(22.319,82)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>               |                    |                   |                      |  |             |
| 2.004.845,66                                   | CAD                | 1.582.000,00      | USD                  | (4.585,23)   | 14.01.2022  |
| 12.678.021,84                                  | EUR                | 1.628.108.000,00  | JPY                  | 195.566,45   | 14.01.2022  |
| 31.962.886,18                                  | EUR                | 36.659.758,00     | USD                  | (394.639,95)   | 14.01.2022  |
| 4.212.000,00                                   | GBP                | 7.212.924,90      | CAD                  | 5.242,72   | 14.01.2022  |
| 526.203.258,00                                 | JPY                | 4.271.000,00      | CHF                  | (100.883,81)   | 14.01.2022  |
| 1.711.411.000,00                               | JPY                | 13.324.444,95     | EUR                  | (203.317,61)   | 14.01.2022  |
| 106.128.660,00                                 | TRY                | 9.907.103,74      | EUR                  | (3.014.169,30)   | 14.01.2022  |
| 21.550.000,00                                  | USD                | 19.046.901,15     | EUR                  | (25.982,80)  | 14.01.2022  |
| 8.098.000,00                                   | AUD                | 674.252.194,00    | JPY                  | 10.606,73  | 01.02.2022  |
| 1.186.000,00                                   | CAD                | 8.295.052,77      | NOK                  | (6.838,75)   | 01.02.2022  |
| 9.321.410,72                                   | CAD                | 7.238.000,00      | USD                  | 82.225,29  | 01.02.2022  |
| 6.327.000,00                                   | EUR                | 64.941.652,24     | SEK                  | (5.231,31)   | 01.02.2022  |
| 15.957.000,00                                  | GBP                | 191.605.897,12    | SEK                  | 299.173,93   | 01.02.2022  |
| 53.832.859,78                                  | SEK                | 8.297.000,00      | AUD                  | (57.093,67)  | 01.02.2022  |
| 123.337.784,87                                 | SEK                | 13.576.000,00     | USD                  | 47.826,21  | 01.02.2022  |
| 6.745.000,00                                   | USD                | 8.724.017,54      | CAD                  | (102.671,99)   | 01.02.2022  |
| 34.877.000,00                                  | USD                | 32.115.379,85     | CHF                  | (324.885,60)   | 01.02.2022  |
| 1.418.000,00                                   | USD                | 12.896.953,75     | NOK                  | (39.102,93)  | 01.02.2022  |
| 80.262.548,00                                  | BRL                | 14.093.956,96     | USD                  | 117.472,27   | 22.02.2022  |
| 2.191.842.710,80                               | INR                | 28.891.173,71     | USD                  | 337.838,02   | 22.02.2022  |
| 367.000,00                                     | USD                | 2.113.960,37      | BRL                  | (6.808,09)   | 22.02.2022  |
| 88.909.000,00                                  | DKK                | 11.954.519,02     | EUR                  | 2.033,65   | 28.02.2022  |
| 1.444,97                                       | EUR                | 1.500,00          | CHF                  | (7,70)   | 28.02.2022  |
| 7.993.966,83                                   | EUR                | 59.464.000,00     | DKK                  | (2.800,51)   | 28.02.2022  |
| 847.536,05                                     | EUR                | 8.723.000,00      | SEK                  | (2.724,85)   | 28.02.2022  |
| 4.517.000,00                                   | SEK                | 441.038,36        | EUR                  | (753,15)   | 28.02.2022  |
| 16.256.000,00                                  | EUR                | 18.409.157,59     | USD                  | 22.418,95  | 01.03.2022  |
| 15.636.000,00                                  | CAD                | 10.762.840,25     | EUR                  | 80.384,61  | 02.03.2022  |
| 11.499.587,07                                  | EUR                | 16.705.000,00     | CAD                  | (84.964,92)  | 02.03.2022  |
| 16.141.606,19                                  | EUR                | 13.767.000,00     | GBP                  | (222.790,57)   | 02.03.2022  |
| 3.025,07                                       | EUR                | 31.000,00         | SEK                  | 3,48   | 02.03.2022  |
| 561.752,70                                     | EUR                | 636.000,00        | USD                  | 926,13   | 02.03.2022  |
| 13.973.000,00                                  | GBP                | 16.383.581,89     | EUR                  | 225.680,06   | 02.03.2022  |
| 46.000,00                                      | SEK                | 4.471,54          | EUR                  | 12,12  | 02.03.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(3.172.842,12)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>            |                    |                   |                      |  |             |
| 139.386,46                                     | EUR                | 162.000,00        | USD                  | (3.602,40)   | 14.01.2022  |
| 48.000,00                                      | USD                | 41.299,69         | EUR                  | 1.067,37   | 14.01.2022  |
| 93.899.630,59                                  | EUR                | 934.992.538,35    | SEK                  | 2.733.462,24   | 01.02.2022  |
| 2.000.486.301,31                               | SEK                | 200.905.266,08    | EUR                  | (5.848.446,44)   | 01.02.2022  |
| 18.253.625,54                                  | SEK                | 2.012.000,00      | USD                  | 4.612,93   | 01.02.2022  |
| 558.159.717,00                                 | EUR                | 4.151.262.660,81  | DKK                  | (105.381,70)   | 28.02.2022  |
| 16.418.218,57                                  | EUR                | 168.763.000,00    | SEK                  | (31.670,32)  | 28.02.2022  |
| 171.986.000,00                                 | SEK                | 16.731.770,23     | EUR                  | 32.275,15  | 28.02.2022  |
| 97,63  | EUR                | 1.000,00          | SEK                  | 0,16   | 02.03.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>(3.217.683,01)</b>  |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                       | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 165.876.975,08                          | EUR                | 187.427.000,00    | USD                  | 446.235,11  | 14.01.2022  |
| 4.340.000,00                            | USD                | 3.838.482,29      | EUR                  | (7.820,05)  | 14.01.2022  |
| 4.404.000,00                            | EUR                | 43.686.579,00     | SEK                  | 144.362,96  | 01.02.2022  |
| 44.313.683,30                           | SEK                | 4.319.000,00      | EUR                  | 1.869,86  | 01.02.2022  |
| 809.000,00                              | USD                | 7.370.181,89      | NOK                  | (23.529,07)   | 01.02.2022  |
| 2.075.000,00                            | USD                | 18.110.107,81     | SEK                  | 65.008,38   | 01.02.2022  |
| 73.500,00                               | CHF                | 70.858,54         | EUR                  | 322,34  | 28.02.2022  |
| 172.727.000,00                          | DKK                | 23.226.111,10     | EUR                  | 2.350,78  | 28.02.2022  |
| 13.631.553,84                           | EUR                | 101.374.000,00    | DKK                  | (1.300,78)  | 28.02.2022  |
| 706.411,73                              | EUR                | 7.301.000,00      | SEK                  | (5.245,16)  | 28.02.2022  |
| 429.075,99                              | EUR                | 363.000,00        | GBP                  | (2.406,70)  | 02.03.2022  |
| 939.373,28                              | EUR                | 9.709.000,00      | SEK                  | (6.976,65)  | 02.03.2022  |
| 43.000,00                               | GBP                | 50.827,18         | EUR                  | 285,09  | 02.03.2022  |
| 9.971.000,00                            | USD                | 8.818.232,97      | EUR                  | (25.790,12)   | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>587.365,99</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(31.829.126,26)</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(33.689.034,83)</b>  |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

## Credit Default Swaps

| Basiswert  | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal          | Wahrung | Kosten (EUR)         | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)      | Falligkeit |
|--|--------------|-----------------|------------------|----------|----------------------|--|----------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>    |              |                 |                  |          |                      |  |                      |             |
| CDX-EMS36V1-5Y                                   | Verkauf      | 1,00%           | (6.650.000,00)   | USD      | (290.852,88)         | 52.609,84  | (238.243,04)         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (38.104.000,00)  | USD      | 3.158.805,02         | (49.994,18)  | 3.108.810,84         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (49.828.000,00)  | USD      | 4.132.452,12         | (67.109,21)  | 4.065.342,91         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (53.664.000,00)  | USD      | 4.446.000,00         | (67.687,37)  | 4.378.312,63         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (46.898.000,00)  | USD      | 3.788.886,87         | 37.404,61  | 3.826.291,48         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (46.877.000,00)  | USD      | 3.804.140,78         | 20.437,36  | 3.824.578,14         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (53.930.000,00)  | USD      | 4.359.485,28         | 40.529,64  | 4.400.014,92         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (1.191.000,00)   | USD      | 101.148,90           | (3.978,17)   | 97.170,73            | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (5.443.000,00)   | USD      | 379.956,70           | 64.124,16  | 444.080,86           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (4.029.000,00)   | USD      | 308.974,58           | 19.741,54  | 328.716,12           | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                  |          | <b>24.188.997,37</b> | <b>46.078,22</b>                                     | <b>24.235.075,59</b> |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |              |                 |                  |          |                      |  |                      |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (52.775.000,00)  | USD      | 4.226.970,23         | 78.811,10  | 4.305.781,33         | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (3.114.000,00)   | USD      | 251.717,47           | 2.346,06   | 254.063,53           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (5.443.000,00)   | USD      | 381.830,26           | 62.250,60  | 444.080,86           | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                  |          | <b>4.860.517,96</b>  | <b>143.407,76</b>                                    | <b>5.003.925,72</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>    |              |                 |                  |          |                      |  |                      |             |
| Chile Government Internation 3.24% 06-02-2028    | Verkauf      | 1,00%           | (10.400.000,00)  | USD      | 101.546,69           | 26.235,16  | 127.781,85           | 20.12.2026  |
| Colombia Government Internat 10.375% 28-01-2033  | Verkauf      | 1,00%           | (11.520.000,00)  | USD      | (234.174,84)         | (254.599,13)   | (488.773,97)         | 20.12.2026  |
| Turkey Government Internatio 11.875% 15-01-2030  | Verkauf      | 1,00%           | (1.300.000,00)   | USD      | (154.336,99)         | (64.482,10)  | (218.819,09)         | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                  |          | <b>(286.965,14)</b>  | <b>(292.846,07)</b>                                  | <b>(579.811,21)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |              |                 |                  |          |                      |  |                      |             |
| Brazilian Government Interna 4.25% 07-01-2025    | Verkauf      | 1,00%           | (5.590.000,00)   | USD      | (234.783,35)         | (3.287,96)   | (238.071,31)         | 20.12.2026  |
| CDX-EMS36V1-5Y                                   | Verkauf      | 1,00%           | (27.540.000,00)  | USD      | (1.130.581,80)       | 143.933,16   | (986.648,64)         | 20.12.2026  |
| CDX-NAIGS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 1,00%           | (514.370.000,00) | USD      | 10.557.556,59        | 516.007,66   | 11.073.564,25        | 20.12.2026  |
| CDX-NAIGS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 1,00%           | (31.610.000,00)  | USD      | 623.416,77           | 57.096,03  | 680.512,80           | 20.12.2026  |
| Philippine Government Intern 10.625% 16-03-2025  | Verkauf      | 1,00%           | (9.470.000,00)   | USD      | 193.909,05           | (19.392,32)  | 174.516,73           | 20.12.2026  |
|  |              |                 |                  |          | <b>10.009.517,26</b> | <b>694.356,57</b>                                    | <b>10.703.873,83</b> |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |              |                 |                  |          |                      |  |                      |             |
| CDX-EMS36V1-5Y                                   | Verkauf      | 1,00%           | (120.020.000,00) | USD      | (3.467.927,45)       | (831.911,69)   | (4.299.839,14)       | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (4.720.000,00)   | USD      | 380.274,46           | 4.818,63   | 385.093,09           | 20.12.2026  |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (24.030.000,00)  | USD      | 1.744.232,98         | 216.315,11   | 1.960.548,09         | 20.12.2026  |
| China Government Internation 7.5% 28-10-2027     | Verkauf      | 1,00%           | (20.180.000,00)  | USD      | 502.469,52           | 9.346,24   | 511.815,76           | 20.12.2026  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert                                      | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal          | Währung | Kosten (EUR)          | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)       | Fälligkeit |
|--|--------------|-----------------|------------------|---------|-----------------------|---|-----------------------|------------|
| Indonesia Government Interna 4.125% 15-01-2025 | Verkauf      | 1,00%           | (21.050.000,00)  | USD     | 172.053,51            | 48.631,72   | 220.685,23            | 20.12.2026 |
| Malaysia (No ref obligation)                   | Verkauf      | 1,00%           | (13.480.000,00)  | USD     | 299.656,26            | 12.303,29   | 311.959,55            | 20.12.2026 |
| Peruvian Government Internat 8.75% 21-11-2033  | Verkauf      | 1,00%           | (9.740.000,00)   | USD     | 21.005,76             | 77.221,84   | 98.227,60             | 20.12.2026 |
| Republic of South Africa Gov 5.875% 16-09-2025 | Verkauf      | 1,00%           | (5.440.000,00)   | USD     | (244.820,16)          | 15.759,06   | (229.061,10)          | 20.12.2026 |
| Saudi Government Internation 4% 17-04-2025     | Verkauf      | 1,00%           | (11.940.000,00)  | USD     | 235.000,98            | 14.902,46   | 249.903,44            | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                  |         | <b>(358.054,14)</b>   | <b>(432.613,34)</b>                                 | <b>(790.667,48)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: ICE Clear Europe Limited</b>   |              |                 |                  |         |                       |   |                       |            |
| ITRAXX-EUROPES36V1-5Y                          | Verkauf      | 1,00%           | (318.182.000,00) | EUR     | 8.195.106,08          | 84.714,90   | 8.279.820,98          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                           | Verkauf      | 5,00%           | (537.491.000,00) | EUR     | 63.168.876,12         | 901.830,86  | 64.070.706,98         | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                  |         | <b>71.363.982,20</b>  | <b>986.545,76</b>                                   | <b>72.350.527,96</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>               |              |                 |                  |         |                       |   |                       |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                               | Verkauf      | 5,00%           | (7.948.000,00)   | USD     | 613.516,62            | 34.940,98   | 648.457,60            | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                               | Verkauf      | 5,00%           | (5.607.000,00)   | USD     | 396.111,73            | 61.349,49   | 457.461,22            | 20.12.2026 |
| Russian Foreign Bond - Eurob MULTI 31-03-2030  | Verkauf      | 1,00%           | (15.300.000,00)  | USD     | 92.680,04             | (250.180,76)  | (157.500,72)          | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                  |         | <b>1.102.308,39</b>   | <b>(153.890,29)</b>                                 | <b>948.418,10</b>     |            |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>   |              |                 |                  |         |                       |   |                       |            |
| Mexico Government Internatio 4.15% 28-03-2027  | Verkauf      | 1,00%           | (21.370.000,00)  | USD     | 36.857,29             | 43.850,17   | 80.707,46             | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                  |         | <b>36.857,29</b>      | <b>43.850,17</b>                                    | <b>80.707,46</b>      |            |
|  |              |                 |                  |         | <b>110.917.161,19</b> | <b>1.034.888,78</b>                                 | <b>111.952.049,97</b> |            |

## Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|-------------------------------|--------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                               |                          |   |  |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022 | AUD     | 2.229,00                      | 219.054.975,00           | (715.832,00)  | 667.970,80   |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | (414,00)                      | (58.891.500,00)          | 34.497,42   | (1.149.021,64)   |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | 549,00                        | 78.095.250,00            | (45.746,57)   | 1.521.209,73   |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (3.543,00)                    | (472.175.610,00)         | (106.290,00)  | 3.535.173,75   |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | 8,00                          | 1.066.160,00             | 240,00  | (8.094,39)   |
| Euro-BTP Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (50,00)                       | (7.348.000,00)           | 2.500,00  | 121.955,27   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (5.337,00)                    | (914.601.690,00)         | 0,00  | 16.303.048,48  |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | 5.110,00                      | 875.700.700,00           | 0,00  | (15.617.868,27)  |
| EURO-BUXL 30Y BND 3/2022               | 10.03.2022 | EUR     | (52,00)                       | (10.750.480,00)          | 0,00  | 540.964,32   |
| Euro-OAT Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (10,00)                       | (1.632.100,00)           | (600,00)  | 21.761,92  |
| EURO-SCHATZ FUT 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | 69,00                         | 7.730.070,00             | 0,00  | (5.531,44)   |
| EURO-SCHATZ FUT 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (4.399,00)                    | (492.819.970,00)         | 0,00  | 717.123,93   |
| JPN 10Y BOND(OSE) 3/2022               | 22.03.2022 | JPY     | (110,00)                      | (16.684.800.000,00)      | (75.915,77)   | 347.996,26   |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022 | GBP     | (715,00)                      | (89.324.950,00)          | (127.669,78)  | 217.005,07   |
| Short Euro-BTP Fu 3/2022               | 10.03.2022 | EUR     | 31,00                         | 3.500.520,00             | 310,00  | (11.985,63)  |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (10.912,00)                   | (1.422.993.000,00)       | 0,00  | (10.846.746,58)  |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 10.745,00                     | 1.401.215.156,25         | 0,00  | 9.553.119,41   |
| US 2YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (999,00)                      | (217.969.312,50)         | (55.125,15)   | 357.990,14   |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (4.857,00)                    | (587.507.285,58)         | (234.520,22)  | (895.187,08)   |
|  |            |         |                               |                          | <b>(1.324.152,07)</b>   | <b>5.371.584,05</b>  |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 23.800.000,00 EUR gezahlt.  
 BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 4.890.000,00 EUR gezahlt.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 150.000,00 EUR erhalten.  
 Citibank Europe PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 10.680.000,00 EUR gezahlt.  
 Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 830.000,00 EUR erhalten.  
 J.P. Morgan SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 1.090.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
|                    | <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                            |                              |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>AUD</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 415.000,00         | Australia Government Bond 2.75% 21-11-2027  | 285.454,53                 | 0,39                         |                    |   |                            |                              |
| 322.000,00         | Australia Government Bond 4.75% 21-04-2027  | 241.530,69                 | 0,33                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>526.985,22</b>          | <b>0,72</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>CAD</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 294.000,00         | Canadian Government Bond 1% 01-06-2027  | 201.133,82                 | 0,28                         |                    |   |                            |                              |
| 297.000,00         | Canadian Government Bond 1.5% 01-06-2026  | 208.522,52                 | 0,29                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>409.656,34</b>          | <b>0,56</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>DKK</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 7.300.000,00       | Nykredit Realkredit 1% 01-01-2022 SDO A H   | 981.670,93                 | 1,35                         | 9.063,00           | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 16-06-2023      | 9.150,00                   | 0,01                         |
| 46.000.000,00      | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2022 SDO A H   | 6.234.071,31               | 8,55                         | 500.000,00         | Caisse Francaise de Financem 0.01% 18-03-2031     | 487.904,00                 | 0,67                         |
| 8.500.000,00       | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2025 SDO A H   | 1.185.718,24               | 1,63                         | 500.000,00         | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 07-10-2026     | 501.131,82                 | 0,69                         |
| 15.600.000,00      | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2026 SDO A H   | 2.183.695,81               | 2,99                         | 1.200.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.2% 16-09-2022      | 1.206.187,20               | 1,65                         |
|                    |   | <b>10.585.156,29</b>       | <b>14,51</b>                 | 600.000,00         | Commerzbank AG 0.125% 15-12-2026                  | 603.891,60                 | 0,83                         |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              | 100.000,00         | Commonwealth Bank of Austral 0.125% 15-10-2029    | 98.866,40                  | 0,14                         |
| 100.000,00         | Aegon Bank NV 0.375% 09-06-2036   | 97.885,40                  | 0,13                         | 400.000,00         | Coventry Building Society 0.01% 07-07-2028        | 394.610,40                 | 0,54                         |
| 500.000,00         | ASB Finance Ltd/London 0.625% 18-10-2024  | 510.194,00                 | 0,70                         | 2.200.000,00       | Credit Agricole Public Secto 0.01% 13-09-2028     | 2.183.024,80               | 2,99                         |
| 2.300.000,00       | AXA Bank Europe SCF 0.01% 22-01-2027  | 2.296.292,40               | 3,15                         | 1.300.000,00       | Deutsche Apotheker-und Aerzt 0.375% 01-03-2027    | 1.322.827,31               | 1,81                         |
| 1.000.000,00       | AXA Bank Europe SCF 0.375% 23-03-2023   | 1.010.070,00               | 1,38                         | 100.000,00         | Deutsche Bank AG 0.05% 20-11-2024                 | 100.111,00                 | 0,14                         |
| 1.100.000,00       | Bausparkasse Schwaebisch Hal 0.01% 22-10-2030   | 1.080.420,00               | 1,48                         | 1.000.000,00       | Deutsche Kreditbank AG 1.625% 18-06-2024          | 1.046.100,00               | 1,43                         |
| 100.000,00         | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.01% 03-09-2029   | 98.827,60                  | 0,14                         | 400.000,00         | DNB Boligkredditt AS 0.01% 08-10-2027             | 398.550,40                 | 0,55                         |
| 100.000,00         | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.1% 12-05-2031  | 98.266,43                  | 0,13                         | 700.000,00         | DNB Boligkredditt AS 0.375% 20-11-2024            | 711.195,80                 | 0,97                         |
| 100.000,00         | BPCE SFH SA 0.01% 16-10-2028  | 99.241,20                  | 0,14                         | 500.000,00         | Eika Boligkredditt AS 0.375% 26-02-2025           | 507.908,00                 | 0,70                         |
| 2.000.000,00       | BPCE SFH SA 0.01% 18-03-2031  | 1.951.616,00               | 2,68                         | 100.000,00         | Eika Boligkredditt AS 0.875% 01-02-2029           | 105.044,80                 | 0,14                         |
| 10.000,00          | Bundessobligation 0.000000% 08-04-2022  | 10.017,00                  | 0,01                         | 200.000,00         | Erste Group Bank AG 0.75% 05-02-2025              | 205.594,40                 | 0,28                         |
| 88.813,75          | Bundessobligation 0.000000% 10-10-2025  | 90.678,82                  | 0,12                         | 11.000,00          | Estonia Government Internati 0.125% 10-06-2030    | 10.928,15                  | 0,01                         |
| 127.297,00         | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-02-2030   | 130.415,78                 | 0,18                         | 3.000,00           | Finland Government Bond 0.25% 15-09-2040          | 2.927,32                   | 0,00                         |
| 37.766,56          | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2026   | 38.642,37                  | 0,05                         | 29.000,00          | Finland Government Bond 1.125% 15-04-2034         | 32.268,01                  | 0,04                         |
| 75.200,00          | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2030   | 77.363,20                  | 0,11                         | 1.000,00           | Finland Government Bond 1.375% 15-04-2047         | 1.237,81                   | 0,00                         |
| 158.342,00         | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2030   | 162.031,37                 | 0,22                         | 8.000,00           | Finland Government Bond 2.75% 04-07-2028          | 9.573,44                   | 0,01                         |
| 48.847,56          | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2031   | 49.717,98                  | 0,07                         | 29.309,00          | French Republic Government B 0.000000% 25-11-2029 | 29.334,21                  | 0,04                         |
| 22.000,00          | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2050   | 21.058,05                  | 0,03                         | 75.492,00          | French Republic Government B 0.000000% 25-11-2030 | 74.788,29                  | 0,10                         |
| 124.339,26         | Bundesrepublik Deutschland B 0.25% 15-02-2027   | 128.875,40                 | 0,18                         | 34.000,00          | French Republic Government B 0.000000% 25-11-2031 | 33.353,99                  | 0,05                         |
| 26.644,13          | Bundesrepublik Deutschland B 0.25% 15-08-2028   | 27.781,78                  | 0,04                         | 60.708,00          | French Republic Government B 0.1% 25-07-2031      | 74.465,31                  | 0,10                         |
| 31.366,78          | Bundesrepublik Deutschland B 0.5% 15-02-2028  | 33.141,20                  | 0,05                         | 37.746,00          | French Republic Government B 0.5% 25-05-2026      | 39.162,38                  | 0,05                         |
| 10.000,00          | Bundesrepublik Deutschland B 1.5% 04-09-2022  | 10.153,82                  | 0,01                         | 26.999,00          | French Republic Government B 0.5% 25-05-2040      | 26.375,32                  | 0,04                         |
| 34.694,58          | Bundesrepublik Deutschland B 1.5% 15-05-2024  | 36.490,30                  | 0,05                         | 49.053,00          | French Republic Government B 0.5% 25-05-2072      | 37.952,21                  | 0,05                         |
| 18.627,50          | Bundesrepublik Deutschland B 3.25% 04-07-2042   | 31.149,35                  | 0,04                         | 15.676,00          | French Republic Government B 0.5% 25-06-2044      | 14.968,32                  | 0,02                         |
| 9.800,00           | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 10-03-2023  | 9.875,99                   | 0,01                         | 23.980,00          | French Republic Government B 0.75% 25-05-2052     | 22.929,08                  | 0,03                         |
| 10.000,00          | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 10-06-2022  | 10.031,70                  | 0,01                         | 29.442,00          | French Republic Government B 0.75% 25-11-2028     | 31.238,35                  | 0,04                         |
| 10.000,00          | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 11-03-2022  | 10.013,00                  | 0,01                         | 13.322,00          | French Republic Government B 1% 25-05-2027        | 14.248,68                  | 0,02                         |
| 10.000,00          | Bundesschatzanweisungen 0.000000% 15-12-2022  | 10.061,00                  | 0,01                         | 36.495,00          | French Republic Government B 1.5% 25-05-2031      | 41.183,95                  | 0,06                         |
|                    |   |                            |                              | 13.322,00          | French Republic Government B 1.75% 25-06-2039     | 16.088,95                  | 0,02                         |
|                    |   |                            |                              | 42.617,00          | French Republic Government B 2% 25-05-2048        | 54.801,37                  | 0,08                         |
|                    |   |                            |                              | 51.336,00          | French Republic Government B 5.75% 25-10-2032     | 81.996,12                  | 0,11                         |
|                    |   |                            |                              | 100.000,00         | Hypo Vorarlberg Bank AG 0.75% 11-02-2025          | 102.731,00                 | 0,14                         |
|                    |   |                            |                              | 300.000,00         | ING-DiBa AG 0.01% 07-10-2028                      | 298.798,80                 | 0,41                         |
|                    |   |                            |                              | 13.544,10          | Ireland Government Bond 0.000000% 18-10-2031      | 13.206,96                  | 0,02                         |
|                    |   |                            |                              | 28.420,40          | IRELAND GOVERNMENT BOND 0.2% 18-10-2030           | 28.598,31                  | 0,04                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 12.778,83          | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.1% 15-05-2029           | 13.803,76                  | 0,02                         | 200.000,00         | PKO Bank Hipoteczny SA 0.75% 24-01-2024           | 203.580,00                 | 0,28                         |
| 15.128,86          | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.3% 15-05-2033           | 16.693,18                  | 0,02                         | 4.440,69           | Portugal Obrigaçoes do Tesou 1% 12-04-2052        | 4.026,11                   | 0,01                         |
| 5.362,00           | Ireland Government Bond 1.35% 18-03-2031          | 5.970,78                   | 0,01                         | 100.000,00         | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 14-09-2027         | 99.192,85                  | 0,14                         |
| 3.725,73           | Ireland Government Bond 1.5% 15-05-2050           | 4.286,45                   | 0,01                         | 25.000,00          | Republic of Austria Governme 0.25% 20-10-2036     | 24.381,55                  | 0,03                         |
| 8.125,98           | Ireland Government Bond 2% 18-02-2045             | 10.364,35                  | 0,01                         | 26.000,00          | Republic of Austria Governme 0.75% 20-02-2028     | 27.549,86                  | 0,04                         |
| 159.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 01-08-2026 | 155.932,89                 | 0,21                         | 6.000,00           | Republic of Austria Governme 0.85% 30-06-2120     | 5.216,13                   | 0,01                         |
| 269.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 15-08-2024 | 268.615,33                 | 0,37                         | 12.000,00          | Republic of Austria Governme 2.4% 23-05-2034      | 15.212,02                  | 0,02                         |
| 88.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 0.25% 15-03-2028     | 85.811,14                  | 0,12                         | 13.000,00          | Republic of Poland Governmen 0.000000% 10-02-2025 | 12.987,10                  | 0,02                         |
| 44.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 0.4% 15-05-2030      | 50.311,18                  | 0,07                         | 700.000,00         | Royal Bank of Canada 0.01% 21-01-2027             | 698.185,60                 | 0,96                         |
| 80.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 0.6% 01-08-2031      | 76.153,94                  | 0,10                         | 1.000,00           | Spain Government Bond 0.000000% 31-01-2025        | 1.012,00                   | 0,00                         |
| 93.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 0.85% 15-01-2027     | 94.785,60                  | 0,13                         | 227.000,00         | Spain Government Bond 0.000000% 31-01-2028        | 225.252,10                 | 0,31                         |
| 49.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 1.3% 15-05-2028      | 60.937,62                  | 0,08                         | 78.000,00          | Spain Government Bond 0.5% 31-10-2031             | 77.515,07                  | 0,11                         |
| 22.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 1.45% 15-11-2024     | 22.867,15                  | 0,03                         | 2.000,00           | Spain Government Bond 1% 30-07-2042               | 1.947,29                   | 0,00                         |
| 45.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 1.5% 30-04-2045      | 42.222,27                  | 0,06                         | 38.000,00          | Spain Government Bond 1% 31-10-2050               | 34.491,84                  | 0,05                         |
| 65.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 1.65% 01-12-2030     | 68.341,49                  | 0,09                         | 10.000,00          | Spain Government Bond 1.2% 31-10-2040             | 10.100,00                  | 0,01                         |
| 15.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 2% 01-12-2025        | 16.017,30                  | 0,02                         | 22.000,00          | Spain Government Bond 1.45% 31-10-2071            | 19.109,68                  | 0,03                         |
| 26.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 2.15% 01-03-2072     | 24.859,15                  | 0,03                         | 42.000,00          | Spain Government Bond 1.5% 30-04-2027             | 45.494,57                  | 0,06                         |
| 3.000,00           | Italy Buoni Poliennali Del T 2.45% 01-10-2023     | 3.139,99                   | 0,00                         | 20.000,00          | Spain Government Bond 1.6% 30-04-2025             | 21.302,08                  | 0,03                         |
| 18.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 2.8% 01-03-2067      | 20.331,00                  | 0,03                         | 56.000,00          | Spain Government Bond 2.35% 30-07-2033            | 66.461,70                  | 0,09                         |
| 63.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 3.35% 01-03-2035     | 77.508,02                  | 0,11                         | 3.000,00           | Spain Government Bond 5.15% 31-10-2044            | 5.400,72                   | 0,01                         |
| 5.000,00           | Italy Buoni Poliennali Del T 3.5% 01-03-2030      | 6.033,50                   | 0,01                         | 400.000,00         | Sparebanken Vest Boligkredit 0.01% 11-11-2026     | 399.948,80                 | 0,55                         |
| 17.000,00          | Italy Buoni Poliennali Del T 4% 01-02-2037        | 22.643,29                  | 0,03                         | 100.000,00         | SR-Boligkredit AS 0.01% 08-09-2028                | 99.150,00                  | 0,14                         |
| 44.000,00          | Italy Certificati di Credito FRN 15-04-2026       | 44.247,46                  | 0,06                         | 200.000,00         | SR-Boligkredit AS 0.01% 10-03-2031                | 194.875,20                 | 0,27                         |
| 27.177,01          | Kingdom of Belgium Governmen 0.1% 22-06-2030      | 27.369,98                  | 0,04                         | 100.000,00         | Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.409% 07-11-2029    | 100.391,80                 | 0,14                         |
| 72.383,20          | Kingdom of Belgium Governmen 0.4% 22-06-2040      | 68.826,78                  | 0,09                         | 100.000,00         | Sumitomo Mitsui Trust Bank L 0.01% 15-10-2027     | 98.356,80                  | 0,13                         |
| 10.879,68          | Kingdom of Belgium Governmen 0.65% 22-06-2071     | 8.914,09                   | 0,01                         | 100.000,00         | UniCredit Bank AG 0.01% 28-09-2026                | 100.250,40                 | 0,14                         |
| 21.056,84          | Kingdom of Belgium Governmen 0.8% 22-06-2028      | 22.453,29                  | 0,03                         | 100.000,00         | United Overseas Bank Ltd 0.01% 01-12-2027         | 99.193,00                  | 0,14                         |
| 400.000,00         | Kookmin Bank 0.052% 15-07-2025                    | 400.136,00                 | 0,55                         | 100.000,00         | United Overseas Bank Ltd 0.1% 25-05-2029          | 98.960,80                  | 0,14                         |
| 200.000,00         | LHV Pank AS 0.1% 09-06-2025                       | 200.606,00                 | 0,27                         | 100.000,00         | Volksbank Wien AG 0.125% 19-11-2029               | 99.287,20                  | 0,14                         |
| 7.000,00           | Lithuania Government Interna 0.25% 06-05-2025     | 7.058,45                   | 0,01                         | 700.000,00         | Volksbank Wien AG 0.375% 04-03-2026               | 711.298,00                 | 0,98                         |
| 100.000,00         | Lloyds Bank PLC 0.125% 23-09-2029                 | 99.042,00                  | 0,14                         | 400.000,00         | Vseobecná Uverova Banka AS 0.01% 24-03-2026       | 399.171,20                 | 0,55                         |
| 900.000,00         | MMB SCF SACA 0.05% 17-09-2029                     | 888.411,60                 | 1,22                         | 200.000,00         | Vseobecná Uverova Banka AS 0.25% 26-03-2024       | 201.913,20                 | 0,28                         |
| 400.000,00         | National Bank of Canada 0.000000% 29-09-2023      | 402.276,00                 | 0,55                         | 100.000,00         | Westpac Banking Corp 0.01% 22-09-2028             | 98.716,00                  | 0,14                         |
| 800.000,00         | Nationale-Nederlanden Bank N 0.625% 11-09-2025    | 819.336,00                 | 1,12                         | 300.000,00         | Westpac Banking Corp 0.375% 02-04-2026            | 304.545,60                 | 0,42                         |
| 48.848,00          | Netherlands Government Bond 0.000000% 15-01-2024  | 49.456,16                  | 0,07                         | 400.000,00         | Yorkshire Building Society 0.125% 08-05-2024      | 402.836,00                 | 0,55                         |
| 37.460,00          | Netherlands Government Bond 0.5% 15-01-2040       | 39.883,70                  | 0,05                         |                    |   |                            |                              |
| 54.177,00          | Netherlands Government Bond 0.75% 15-07-2028      | 57.920,59                  | 0,08                         |                    |   | <b>28.436.692,92</b>       | <b>38,98</b>                 |
| 25.905,00          | Netherlands Government Bond 2.5% 15-01-2033       | 33.024,47                  | 0,05                         | 269.342,00         | United Kingdom Gilt 0.125% 31-01-2028             | 308.077,82                 | 0,42                         |
| 4.441,00           | Netherlands Government Bond 2.75% 15-01-2047      | 7.223,30                   | 0,01                         | 250.377,00         | United Kingdom Gilt 1.25% 22-07-2027              | 305.978,88                 | 0,42                         |
|                    |   |                            |                              |                    |   | <b>614.056,70</b>          | <b>0,84</b>                  |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal | Marktwert<br>(Anmerkung 2)  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal                                 | Marktwert<br>(Anmerkung 2)          | % des<br>Netto-<br>vermögens                    |
|---------------------------------|---|------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| <b>JPY</b>                      |   |                              | <b>Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW)</b> |                                     |   |
| 26.300.000,00                   | Japan Government Ten Year Bo 0.1% 20-06-2027  | 203.560,90                   | 0,28  |                                     |   |
| 6.250.000,00                    | Japan Government Ten Year Bo 0.1% 20-06-2029  | 48.461,97                    | 0,07  |                                     |   |
| 27.750.000,00                   | Japan Government Ten Year Bo 0.1% 20-12-2026  | 214.720,01                   | 0,29  |                                     |   |
|                                 |   | <b>466.742,88</b>            | <b>0,64</b>   |                                     |   |
| <b>SEK</b>                      |   |                              | <b>EUR</b>  |                                     |   |
| 1.490.000,00                    | Sweden Government Bond 0.125% 12-05-2031  | 143.929,29                   | 0,20  | 10.382,84                           | Nordea 2 - Emerging Mkt Local Debt Enh Fd Y-EUR |
| 2.230.000,00                    | Sweden Government Bond 0.75% 12-05-2028   | 226.293,63                   | 0,31  |                                     | <b>886.798,02</b>                               |
| 2.465.000,00                    | Sweden Government Bond 1% 12-11-2026  | 251.595,41                   | 0,34  |                                     | <b>1,22</b>                                     |
|                                 |   | <b>621.818,33</b>            | <b>0,85</b>   |                                     |   |
| <b>USD</b>                      |   |                              | <b>USD</b>  |                                     |   |
| 14.028.000,00                   | United States Treasury Infla 0.25% 15-07-2029   | 14.987.984,36                | 20,55   | 23.740,00                           | ISHARES JPM USD EM BND UCITS ETF                |
| 1.261.000,00                    | United States Treasury Infla 0.75% 15-07-2028   | 1.404.789,46                 | 1,93  |                                     | <b>2.279.786,17</b>                             |
| 1.741.000,00                    | United States Treasury Infla 0.875% 15-01-2029  | 1.947.017,85                 | 2,67  |                                     | <b>3,13</b>                                     |
| 1.150.000,00                    | United States Treasury Note/ 0.75% 31-05-2026   | 995.011,70                   | 1,36  |                                     |   |
| 88.700,00                       | United States Treasury Note/ 1.375% 15-11-2031  | 77.284,08                    | 0,11  |                                     |   |
| 14.000,00                       | United States Treasury Note/ 1.625% 15-12-2022  | 12.508,62                    | 0,02  |                                     |   |
| 10.000,00                       | United States Treasury Note/ 2% 31-05-2024  | 9.073,37                     | 0,01  |                                     |   |
| 10.000,00                       | United States Treasury Note/ 2.5% 15-05-2024  | 9.173,73                     | 0,01  |                                     |   |
| 10.000,00                       | United States Treasury Note/ 2.5% 15-08-2023  | 9.094,41                     | 0,01  |                                     |   |
| 14.400,00                       | United States Treasury Note/ 2.875% 30-09-2023  | 13.202,22                    | 0,02  |                                     |   |
| 10.000,00                       | United States Treasury Note/ 2.875% 31-05-2025  | 9.362,72                     | 0,01  |                                     |   |
|                                 |   | <b>19.474.502,52</b>         | <b>26,70</b>  |                                     |   |
|                                 | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>61.135.611,20</b>         | <b>83,80</b>  |                                     |   |
|                                 | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>61.135.611,20</b>         | <b>83,80</b>  |                                     |   |
|                                 | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                              |   |                                     |   |
|                                 | <b>Anleihen</b>   |                              |   |                                     |   |
|                                 | <b>EUR</b>  |                              |   |                                     |   |
| 7.000,00                        | Italy Buoni Poliennali Del T 1.45% 01-03-2036   | 7.005,60                     | 0,01  |                                     |   |
| 13.000,00                       | Italy Buoni Poliennali Del T 1.85% 01-07-2025   | 13.746,02                    | 0,02  |                                     |   |
|                                 |   | <b>20.751,62</b>             | <b>0,03</b>   |                                     |   |
|                                 | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>20.751,62</b>             | <b>0,03</b>   |                                     |   |
|                                 | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>20.751,62</b>             | <b>0,03</b>   |                                     |   |
|                                 |   |                              |   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>      | <b>64.322.947,01</b>                            |
|                                 |   |                              |   |                                     | <b>88,17</b>                                    |
|                                 |   |                              |   | <b>Bankguthaben</b>                 | <b>3.403.884,10</b>                             |
|                                 |   |                              |   |                                     | <b>4,67</b>                                     |
|                                 |   |                              |   | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b> | <b>5.224.131,41</b>                             |
|                                 |   |                              |   |                                     | <b>7,16</b>                                     |
|                                 |   |                              |   | <b>Summe Nettovermögen</b>          | <b>72.950.962,52</b>                            |
|                                 |   |                              |   |                                     | <b>100,00</b>                                   |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| USA                    | 26,70        | Staatsanleihen       | 35,41        |
| Frankreich             | 14,69        | Hypothekenanleihen   | 26,89        |
| Dänemark               | 14,51        | Unternehmensanleihen | 21,53        |
| Deutschland            | 7,47         | Offene Anleihefonds  | 4,34         |
| Norwegen               | 3,31         |                      |              |
| Irland                 | 3,25         | <b>Summe</b>         | <b>88,17</b> |
| Kanada                 | 2,76         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich | 2,07         |                      |              |
| Österreich             | 1,90         |                      |              |
| Italien                | 1,59         |                      |              |
| Niederlande            | 1,51         |                      |              |
| Australien             | 1,41         |                      |              |
| Luxemburg              | 1,22         |                      |              |
| Slowakei               | 0,96         |                      |              |
| Japan                  | 0,91         |                      |              |
| Schweden               | 0,85         |                      |              |
| Neuseeland             | 0,70         |                      |              |
| Spanien                | 0,70         |                      |              |
| Republik Korea         | 0,55         |                      |              |
| Polen                  | 0,30         |                      |              |
| Estland                | 0,29         |                      |              |
| Singapur               | 0,27         |                      |              |
| Belgien                | 0,17         |                      |              |
| Finnland               | 0,06         |                      |              |
| Litauen                | 0,01         |                      |              |
| Portugal               | 0,01         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>88,17</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                             | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>        |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 3.477.580,30                                  | EUR                | 4.043.000,00      | USD                  | (90.962,73)   | 14.01.2022  |
| 4.324.000,00                                  | USD                | 3.719.174,49      | EUR                  | 97.392,46   | 14.01.2022  |
| 357.873,93                                    | AUD                | 192.000,00        | GBP                  | 472,89  | 01.02.2022  |
| 93.000,00                                     | USD                | 1.352.372,61      | TRY                  | (2.732,44)  | 22.02.2022  |
| 12.922,69                                     | EUR                | 1.679.000,00      | JPY                  | 57,76   | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>4.227,94</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| 222.000,00                                    | AUD                | 164.746,40        | USD                  | (3.395,96)  | 14.01.2022  |
| 16.686.472,81                                 | CZK                | 655.000,00        | EUR                  | 14.814,11   | 14.01.2022  |
| 2.953.511,55                                  | EUR                | 3.412.781,63      | USD                  | (58.766,38)   | 14.01.2022  |
| 7.552.346,91                                  | USD                | 6.600.965,02      | EUR                  | 65.066,69   | 14.01.2022  |
| 660.000,00                                    | USD                | 10.299.829,65     | ZAR                  | 13.681,94   | 14.01.2022  |
| 633.800,60                                    | CAD                | 688.000,00        | AUD                  | (175,58)  | 01.02.2022  |
| 2.715.153,88                                  | CAD                | 1.870.000,00      | EUR                  | 14.143,84   | 01.02.2022  |
| 121.000,00                                    | CAD                | 10.996.882,00     | JPY                  | (327,02)  | 01.02.2022  |
| 1.380.000,00                                  | EUR                | 1.439.526,99      | CHF                  | (13.910,24)   | 01.02.2022  |
| 78.000,00                                     | EUR                | 88.466,41         | USD                  | (56,06)   | 01.02.2022  |
| 6.054.701,81                                  | NOK                | 669.000,00        | USD                  | 15.448,62   | 01.02.2022  |
| 584.134,62                                    | SEK                | 7.511.000,00      | JPY                  | (616,43)  | 01.02.2022  |
| 1.300.148,83                                  | SEK                | 210.000,00        | NZD                  | 313,74  | 01.02.2022  |
| 13.577.094,30                                 | SEK                | 1.500.000,00      | USD                  | 368,38  | 01.02.2022  |
| 3.085.000,00                                  | USD                | 351.355.318,00    | JPY                  | 28.794,64   | 01.02.2022  |
| 27.000,00                                     | USD                | 230.628,59        | SEK                  | 1.335,76  | 01.02.2022  |
| 269.500,00                                    | USD                | 20.480.113,50     | INR                  | (3.556,55)  | 22.02.2022  |
| 2.000,00                                      | CAD                | 1.374,60          | EUR                  | 12,36   | 02.03.2022  |
| 831.125,14                                    | EUR                | 1.326.000,00      | AUD                  | (16.444,89)   | 02.03.2022  |
| 10.486,59                                     | EUR                | 15.000,00         | CAD                  | 84,61   | 02.03.2022  |
| 24.724,75                                     | EUR                | 21.000,00         | GBP                  | (237,18)  | 02.03.2022  |
| 10.599,78                                     | EUR                | 1.358.000,00      | JPY                  | 194,59  | 02.03.2022  |
| 18.000,00                                     | GBP                | 21.333,64         | EUR                  | 62,14   | 02.03.2022  |
| 412.000,00                                    | JPY                | 3.207,73          | EUR                  | (50,92)   | 02.03.2022  |
| 351.000,00                                    | SEK                | 34.139,86         | EUR                  | 72,39   | 02.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>56.856,60</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 296.472,14                                    | CAD                | 236.000,00        | USD                  | (2.494,43)  | 14.01.2022  |
| 3.292.463,79                                  | EUR                | 4.939.666,96      | CAD                  | (136.665,85)  | 14.01.2022  |
| 2.351.466,40                                  | EUR                | 2.707.342,02      | USD                  | (38.155,88)   | 14.01.2022  |
| 8.109.938,00                                  | JPY                | 89.000,00         | CAD                  | 394,61  | 14.01.2022  |
| 4.632.300,00                                  | JPY                | 37.000,00         | CHF                  | (308,30)  | 14.01.2022  |
| 853.319.508,00                                | JPY                | 6.562.421,23      | EUR                  | (20.129,76)   | 14.01.2022  |
| 8.655.300,90                                  | MXN                | 360.308,23        | EUR                  | 12.549,56   | 14.01.2022  |
| 87.000,00                                     | USD                | 111.711,88        | CAD                  | (760,27)  | 14.01.2022  |
| 2.631.507,66                                  | USD                | 2.296.153,50      | EUR                  | 26.531,26   | 14.01.2022  |
| 5.759.283,00                                  | ZAR                | 338.383,25        | EUR                  | (20.300,25)   | 14.01.2022  |
| 748.521,84                                    | AUD                | 474.000,00        | EUR                  | 4.698,56  | 01.02.2022  |
| 408.000,00                                    | AUD                | 33.945.351,00     | JPY                  | 728,97  | 01.02.2022  |
| 48.972,74                                     | CAD                | 53.000,00         | AUD                  | 89,23   | 01.02.2022  |
| 70.223,04                                     | CAD                | 41.000,00         | GBP                  | (41,88)   | 01.02.2022  |
| 306.000,00                                    | CAD                | 2.158.809,80      | SEK                  | 1.846,84  | 01.02.2022  |
| 47.599,44                                     | CHF                | 65.000,00         | CAD                  | 985,73  | 01.02.2022  |
| 359.000,00                                    | EUR                | 569.512,22        | AUD                  | (5.218,36)  | 01.02.2022  |
| 7.570.511,17                                  | EUR                | 10.900.476,21     | CAD                  | 6.312,18  | 01.02.2022  |
| 5.121.054,02                                  | EUR                | 4.336.559,75      | GBP                  | (37.564,64)   | 01.02.2022  |
| 6.917.001,48                                  | EUR                | 67.698.422,77     | NOK                  | 144.516,32  | 01.02.2022  |
| 72.000,00                                     | EUR                | 117.808,42        | NZD                  | 1.057,91  | 01.02.2022  |
| 757.000,00                                    | GBP                | 113.993.299,00    | JPY                  | 26.736,63   | 01.02.2022  |
| 18.313.220,00                                 | JPY                | 218.000,00        | AUD                  | 958,48  | 01.02.2022  |
| 2.708.310,00                                  | JPY                | 22.000,00         | CHF                  | (543,44)  | 01.02.2022  |
| 1.318.810.204,00                              | JPY                | 9.942.034,52      | EUR                  | 166.942,22  | 01.02.2022  |
| 6.856.385,00                                  | JPY                | 45.000,00         | GBP                  | (975,53)  | 01.02.2022  |
| 2.484.392,00                                  | JPY                | 31.000,00         | NZD                  | 375,66  | 01.02.2022  |
| 2.237.064,67                                  | NOK                | 27.743.000,00     | JPY                  | 11.148,91   | 01.02.2022  |
| 13.658.546,15                                 | NOK                | 1.517.000,00      | USD                  | 27.936,22   | 01.02.2022  |
| 79.870,02                                     | NZD                | 77.000,00         | AUD                  | (1.147,12)  | 01.02.2022  |
| 2.337.000,00                                  | NZD                | 14.391.290,40     | SEK                  | 4.070,60  | 01.02.2022  |
| 42.879,68                                     | USD                | 38.000,00         | EUR                  | (166,34)  | 01.02.2022  |
| 605.000,00                                    | USD                | 5.137.141,52      | NOK                  | 19.896,47   | 01.02.2022  |
| 12.641,11                                     | USD                | 18.000,00         | NZD                  | 314,37  | 01.02.2022  |
| 2.952.139,59                                  | BRL                | 510.000,00        | USD                  | 11.727,01   | 22.02.2022  |
| 48.552.636,60                                 | INR                | 645.724,04        | USD                  | 2.416,16  | 22.02.2022  |
| 91.084.436,70                                 | RUB                | 1.203.219,04      | USD                  | (2.241,60)  | 22.02.2022  |
| 104.000,00                                    | EUR                | 117.944,02        | USD                  | (5,68)  | 01.03.2022  |
| 6.173.713,29                                  | MXN                | 250.156,43        | EUR                  | 13.402,05   | 01.03.2022  |
| 1.035.000,00                                  | AUD                | 652.655,00        | EUR                  | 8.905,42  | 02.03.2022  |
| 135.000,00                                    | CAD                | 93.105,02         | EUR                  | 514,34  | 02.03.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                                | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|--|-------------------|--------------------|--------------------|---|------------|
| 611.538,20                                       | EUR               | 969.000,00         | AUD                | (7.835,17)  | 02.03.2022 |
| 469.782,04                                       | EUR               | 683.000,00         | CAD                | (3.863,95)  | 02.03.2022 |
| 37.590,83  | EUR               | 32.000,00          | GBP                | (446,48)  | 02.03.2022 |
| 512.924,67                                       | EUR               | 65.855.000,00      | JPY                | 8.333,31  | 02.03.2022 |
| 2.000,00   | GBP               | 2.342,94           | EUR                | 34,40   | 02.03.2022 |
| 4.103.000,00                                     | JPY               | 31.764,66          | EUR                | (326,63)  | 02.03.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>224.231,86</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                   |                    |                    |   |            |
| 14.143.510,64                                    | CZK               | 560.000,00         | EUR                | 7.735,46  | 14.01.2022 |
| 3.335.251,44                                     | EUR               | 5.344.000,00       | AUD                | (83.411,72)   | 14.01.2022 |
| 244.113,73                                       | EUR               | 283.000,00         | USD                | (5.675,28)  | 14.01.2022 |
| 3.545.291,92                                     | USD               | 3.113.677,12       | EUR                | 15.548,72   | 14.01.2022 |
| 698.000,00                                       | CAD               | 4.941.745,07       | NOK                | (10.014,14)   | 01.02.2022 |
| 40.000,00  | EUR               | 409.055,60         | NOK                | (922,59)  | 01.02.2022 |
| 665.000,00                                       | GBP               | 101.992.048,00     | JPY                | 9.278,26  | 01.02.2022 |
| 36.263.654,00                                    | JPY               | 474.000,00         | NZD                | (7.474,78)  | 01.02.2022 |
| 1.368.359,42                                     | NOK               | 192.000,00         | CAD                | 3.658,06  | 01.02.2022 |
| 4.115.047,83                                     | SEK               | 454.000,00         | USD                | 668,98  | 01.02.2022 |
| 7.209.583,44                                     | TRY               | 413.000,00         | USD                | 87.653,81   | 22.02.2022 |
| 269.500,00                                       | USD               | 20.486.716,25      | INR                | (3.634,40)  | 22.02.2022 |
| 118.000,00                                       | USD               | 1.426.972,47       | TRY                | 14.658,21   | 22.02.2022 |
| 4.640.633,34                                     | ZAR               | 253.861,47         | EUR                | 551,89  | 01.03.2022 |
| 57.389,32  | EUR               | 91.000,00          | AUD                | (776,85)  | 02.03.2022 |
| 617.713,15                                       | EUR               | 6.353.000,00       | SEK                | (1.519,29)  | 02.03.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>26.324,34</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                   |                    |                    |   |            |
| 5.175.000,00                                     | AUD               | 3.483.261,45       | CHF                | (61.989,60)   | 14.01.2022 |
| 26.810.929,01                                    | EUR               | 31.734.836,02      | USD                | (1.199.862,87)  | 14.01.2022 |
| 2.840.227,61                                     | GBP               | 3.319.000,00       | EUR                | 60.981,85   | 14.01.2022 |
| 1.814.247,00                                     | JPY               | 21.000,00          | CAD                | (668,67)  | 14.01.2022 |
| 108.205,42                                       | USD               | 146.000,00         | AUD                | 2.108,62  | 14.01.2022 |
| 16.157.832,22                                    | USD               | 13.664.826,91      | EUR                | 596.899,87  | 14.01.2022 |
| 3.935.000,00                                     | USD               | 429.611.265,00     | JPY                | 179.463,25  | 14.01.2022 |
| 164.662,95                                       | AUD               | 104.000,00         | EUR                | 1.306,27  | 01.02.2022 |
| 1.315.000,00                                     | AUD               | 104.705.429,00     | JPY                | 38.410,50   | 01.02.2022 |
| 2.867.107,89                                     | CHF               | 2.701.581,96       | EUR                | 74.698,67   | 01.02.2022 |
| 1.441.480,51                                     | CHF               | 1.586.000,00       | USD                | (3.574,03)  | 01.02.2022 |
| 8.831.321,02                                     | EUR               | 13.683.072,16      | AUD                | 80.750,14   | 01.02.2022 |
| 101.000,00                                       | EUR               | 146.886,43         | CAD                | (929,92)  | 01.02.2022 |
| 122.000,00                                       | EUR               | 104.230,76         | GBP                | (1.989,88)  | 01.02.2022 |
| 301.000,00                                       | EUR               | 38.825.346,00      | JPY                | 3.399,90  | 01.02.2022 |
| 102.000,00                                       | EUR               | 1.052.012,75       | NOK                | (3.245,57)  | 01.02.2022 |
| 7.671.329,14                                     | EUR               | 12.510.048,60      | NZD                | 138.019,43  | 01.02.2022 |
| 2.541.732,11                                     | EUR               | 2.968.293,22       | USD                | (77.309,24)   | 01.02.2022 |
| 187.000,00                                       | GBP               | 317.481,34         | CAD                | 2.138,06  | 01.02.2022 |
| 1.306.647.069,00                                 | JPY               | 9.856.354,57       | EUR                | 159.385,46  | 01.02.2022 |
| 4.747.000,00                                     | JPY               | 355.531,77         | NOK                | 819,45  | 01.02.2022 |
| 762.889,68                                       | NOK               | 74.000,00          | EUR                | 2.321,07  | 01.02.2022 |
| 1.130.544,11                                     | NOK               | 124.000,00         | USD                | 3.693,98  | 01.02.2022 |
| 28.000,00  | NZD               | 19.105,96          | USD                | 3,60  | 01.02.2022 |
| 336.686,05                                       | SEK               | 53.000,00          | AUD                | (1.066,21)  | 01.02.2022 |
| 4.009.594,00                                     | SEK               | 406.000,00         | CHF                | (2.172,19)  | 01.02.2022 |
| 254.071,63                                       | SEK               | 21.000,00          | GBP                | (207,26)  | 01.02.2022 |
| 440.833,72                                       | SEK               | 5.497.000,00       | JPY                | 849,29  | 01.02.2022 |
| 88.804,05  | SEK               | 89.000,00          | NOK                | (244,76)  | 01.02.2022 |
| 1.747.456,79                                     | SEK               | 286.000,00         | NZD                | (1.838,37)  | 01.02.2022 |
| 4.751.087,72                                     | USD               | 4.068.328,61       | EUR                | 123.742,13  | 01.02.2022 |
| 64.000,00  | USD               | 4.784.518,14       | RUB                | 821,14  | 22.02.2022 |
| 1.099.844,05                                     | EUR               | 1.248.351,70       | USD                | (981,42)  | 01.03.2022 |
| 11.094.153,31                                    | MXN               | 528.000,00         | USD                | 7.994,17  | 01.03.2022 |
| 4.966.063,36                                     | TRY               | 313.599,83         | EUR                | (4.304,77)  | 01.03.2022 |
| 60.000,00  | USD               | 1.294.364,28       | MXN                | (2.347,11)  | 01.03.2022 |
| 410.000,00                                       | AUD               | 259.814,54         | EUR                | 2.251,43  | 02.03.2022 |
| 24.000,00  | CAD               | 16.560,95          | EUR                | 82,47   | 02.03.2022 |
| 150.585,01                                       | EUR               | 240.000,00         | AUD                | (2.821,15)  | 02.03.2022 |
| 29.681,91  | EUR               | 43.000,00          | CAD                | (137,56)  | 02.03.2022 |
| 674.840,63                                       | EUR               | 575.000,00         | GBP                | (8.642,89)  | 02.03.2022 |
| 31.829,92  | EUR               | 4.118.000,00       | JPY                | 276,91  | 02.03.2022 |
| 15.197,71  | EUR               | 157.000,00         | SEK                | (105,29)  | 02.03.2022 |
| 18.000,00  | GBP               | 21.165,50          | EUR                | 230,47  | 02.03.2022 |
| 3.170.000,00                                     | JPY               | 24.406,79          | EUR                | (117,42)  | 02.03.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>106.091,95</b>   |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                       | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>        |                   |                    |                    |  |            |
| 95.000,00                               | AUD               | 7.739.663,00       | JPY                | 1.434,33   | 14.01.2022 |
| 26.132,05                               | CHF               | 21.000,00          | GBP                | 310,50   | 14.01.2022 |
| 637.140,53                              | EUR               | 738.000,00         | USD                | (14.252,54)  | 14.01.2022 |
| 2.029.689,28                            | TRY               | 189.471,37         | EUR                | (57.645,38)  | 14.01.2022 |
| 739.000,00                              | USD               | 649.250,72         | EUR                | 3.022,14   | 14.01.2022 |
| 143.939,33                              | AUD               | 92.000,00          | EUR                | 52,32  | 01.02.2022 |
| 30.166,80                               | CAD               | 18.000,00          | GBP                | (478,61)   | 01.02.2022 |
| 363.000,00                              | CAD               | 31.798.593,00      | JPY                | 8.161,58   | 01.02.2022 |
| 23.000,00                               | CAD               | 162.063,12         | SEK                | 158,36   | 01.02.2022 |
| 101.000,00                              | EUR               | 1.002.573,56       | NOK                | 702,66   | 01.02.2022 |
| 318.000,00                              | EUR               | 3.248.751,37       | SEK                | 1.226,60   | 01.02.2022 |
| 719.000,00                              | GBP               | 8.633.492,51       | SEK                | 13.480,37  | 01.02.2022 |
| 6.709.767,00                            | JPY               | 83.000,00          | AUD                | (1.649,88)   | 01.02.2022 |
| 12.621.331,00                           | JPY               | 97.000,00          | EUR                | (255,75)   | 01.02.2022 |
| 9.070.137,00                            | JPY               | 118.000,00         | NZD                | (1.535,03)   | 01.02.2022 |
| 1.773.721,73                            | NOK               | 288.000,00         | NZD                | 4.016,10   | 01.02.2022 |
| 135.000,00                              | NZD               | 825.539,61         | SEK                | 800,33   | 01.02.2022 |
| 5.123.932,72                            | SEK               | 564.000,00         | USD                | 1.986,88   | 01.02.2022 |
| 41.000,00                               | USD               | 52.647,48          | CAD                | (358,78)   | 01.02.2022 |
| 1.575.000,00                            | USD               | 1.450.288,82       | CHF                | (14.671,42)  | 01.02.2022 |
| 48.000,00                               | USD               | 436.568,25         | NOK                | (1.323,65)   | 01.02.2022 |
| 3.491.418,00                            | BRL               | 613.086,63         | USD                | 5.110,04   | 22.02.2022 |
| 98.157.166,10                           | INR               | 1.293.509,42       | USD                | 15.413,93  | 22.02.2022 |
| 20.000,00                               | USD               | 115.202,20         | BRL                | (371,01)   | 22.02.2022 |
| 2.069.738,04                            | EUR               | 15.394.000,00      | DKK                | (459,37)   | 28.02.2022 |
| 655.000,00                              | EUR               | 741.756,78         | USD                | 903,32   | 01.03.2022 |
| 576.000,00                              | CAD               | 396.460,60         | EUR                | 2.982,86   | 02.03.2022 |
| 413.620,42                              | EUR               | 601.000,00         | CAD                | (3.160,05)   | 02.03.2022 |
| 597.986,68                              | EUR               | 510.000,00         | GBP                | (8.234,14)   | 02.03.2022 |
| 423.121,77                              | EUR               | 54.327.000,00      | JPY                | 6.859,75   | 02.03.2022 |
| 467.947,46                              | EUR               | 4.807.000,00       | SEK                | (594,39)   | 02.03.2022 |
| 518.000,00                              | GBP               | 607.366,87         | EUR                | 8.363,30   | 02.03.2022 |
| 56.998.000,00                           | JPY               | 443.782,69         | EUR                | (7.054,89)   | 02.03.2022 |
| 5.069.000,00                            | SEK               | 493.501,07         | EUR                | 578,06   | 02.03.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(36.481,46)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>     |                   |                    |                    |  |            |
| 4.088.567,09                            | EUR               | 40.711.339,26      | SEK                | 119.020,11   | 01.02.2022 |
| 86.637.563,86                           | SEK               | 8.700.855,79       | EUR                | (253.285,99)   | 01.02.2022 |
| 5.405.465,00                            | EUR               | 40.202.659,44      | DKK                | (1.020,56)   | 28.02.2022 |
| 31.763,97                               | EUR               | 327.000,00         | SEK                | (109,03)   | 02.03.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(135.395,47)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 1.283.611,65                            | EUR               | 1.459.000,00       | USD                | (4.163,43)   | 14.01.2022 |
| 447.751,20                              | USD               | 395.836,02         | EUR                | (632,39)   | 14.01.2022 |
| 366.000,00                              | EUR               | 3.630.628,50       | SEK                | 11.997,46  | 01.02.2022 |
| 163.000,00                              | EUR               | 184.323,82         | USD                | 366,92   | 01.02.2022 |
| 3.200.000,00                            | JPY               | 257.569,15         | NOK                | (1.239,55)   | 01.02.2022 |
| 208.132,38                              | SEK               | 32.000,00          | AUD                | (170,55)   | 01.02.2022 |
| 2.909.751,94                            | EUR               | 21.639.000,00      | DKK                | (277,67)   | 28.02.2022 |
| 18.912,44                               | EUR               | 16.000,00          | GBP                | (106,08)   | 02.03.2022 |
| 14.000,00                               | GBP               | 16.366,54          | EUR                | 274,87   | 02.03.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>6.049,58</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>251.905,34</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.



# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps

| Basiswert  | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal         | Währung | Kosten (EUR)        | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)     | Fälligkeit |
|--|--------------|-----------------|-----------------|---------|---------------------|---|---------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (1.595.000,00)  | USD     | 131.836,91          | (1.704,81)  | 130.132,10          | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (2.085.000,00)  | USD     | 172.383,29          | (2.273,31)  | 170.109,98          | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (2.456.000,00)  | USD     | 203.140,77          | (2.761,83)  | 200.378,94          | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (2.000.000,00)  | USD     | 160.895,96          | 2.279,08  | 163.175,04          | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (1.922.000,00)  | USD     | 155.422,00          | 1.389,21  | 156.811,21          | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (2.208.000,00)  | USD     | 176.847,94          | 3.297,30  | 180.145,24          | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (646.000,00)    | USD     | 52.218,85           | 486,69  | 52.705,54           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (250.000,00)    | USD     | 17.537,68           | 2.859,20  | 20.396,88           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (250.000,00)    | USD     | 17.451,62           | 2.945,26  | 20.396,88           | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.609.000,00)  | EUR     | 196.154,24          | (4.356,11)  | 191.798,13          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.754.000,00)  | EUR     | 213.151,69          | (4.069,08)  | 209.082,61          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (844.000,00)    | EUR     | 100.599,63          | 7,96  | 100.607,59          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (455.000,00)    | EUR     | 44.106,33           | 10.131,18   | 54.237,51           | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (331.000,00)    | EUR     | 33.033,88           | 6.422,42  | 39.456,30           | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (330.000,00)    | EUR     | 32.984,85           | 6.352,24  | 39.337,09           | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>1.707.765,64</b> | <b>21.005,40</b>                                    | <b>1.728.771,04</b> |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>    |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (3.200.000,00)  | USD     | 259.504,28          | 1.575,78  | 261.080,06          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-EUROPE36V1-5Y                             | Verkauf      | 1,00%           | (13.570.000,00) | EUR     | 350.326,03          | 2.796,30  | 353.122,33          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.495.000,00)  | EUR     | 182.076,62          | (3.867,67)  | 178.208,95          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (331.000,00)    | EUR     | 33.399,01           | 6.057,29  | 39.456,30           | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>825.305,94</b>   | <b>6.561,70</b>                                     | <b>831.867,64</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| CDX-EMS36V1-5Y                                   | Verkauf      | 1,00%           | (760.000,00)    | USD     | (31.199,79)         | 3.972,01  | (27.227,78)         | 20.12.2026 |
| CDX-NAIGS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 1,00%           | (23.360.000,00) | USD     | 479.469,10          | 23.434,37   | 502.903,47          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (524.000,00)    | EUR     | 63.945,17           | (1.482,63)  | 62.462,54           | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>512.214,48</b>   | <b>25.923,75</b>                                    | <b>538.138,23</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.250.000,00)  | EUR     | 148.411,12          | 593,02  | 149.004,14          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (2.260.000,00)  | EUR     | 269.259,53          | 139,95  | 269.399,48          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.609.000,00)  | EUR     | 191.540,02          | 258,11  | 191.798,13          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.460.000,00)  | EUR     | 174.597,28          | (560,45)  | 174.036,83          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (631.000,00)    | EUR     | 71.855,95           | 3.361,34  | 75.217,29           | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (331.000,00)    | EUR     | 33.165,04           | 6.291,26  | 39.456,30           | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (465.000,00)    | EUR     | 50.945,10           | 4.484,44  | 55.429,54           | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>939.774,04</b>   | <b>14.567,67</b>                                    | <b>954.341,71</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| CDX-EMS36V1-5Y                                   | Verkauf      | 1,00%           | (10.120.000,00) | USD     | (292.413,15)        | (70.146,19)   | (362.559,34)        | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.609.000,00)  | EUR     | 193.863,83          | (2.065,70)  | 191.798,13          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (1.579.000,00)  | EUR     | 192.458,94          | (4.236,91)  | 188.222,03          | 20.12.2026 |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (3.530.000,00)  | EUR     | 411.441,82          | 9.345,87  | 420.787,69          | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>505.351,44</b>   | <b>(67.102,93)</b>                                  | <b>438.248,51</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (301.000,00)    | USD     | 23.234,59           | 1.323,25  | 24.557,84           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                                 | Verkauf      | 5,00%           | (250.000,00)    | USD     | 17.661,48           | 2.735,40  | 20.396,88           | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>40.896,07</b>    | <b>4.058,65</b>                                     | <b>44.954,72</b>    |            |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>     |              |                 |                 |         |                     |   |                     |            |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                             | Verkauf      | 5,00%           | (525.000,00)    | EUR     | 63.956,78           | (1.375,04)  | 62.581,74           | 20.12.2026 |
|  |              |                 |                 |         | <b>63.956,78</b>    | <b>(1.375,04)</b>                                   | <b>62.581,74</b>    |            |
|  |              |                 |                 |         | <b>4.595.264,39</b> | <b>3.639,20</b>                                     | <b>4.598.903,59</b> |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in<br>der Basiswährung des Teilfonds<br>(EUR) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                      |                             |   |  |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022 | AUD     | 99,00                                | 9.729.225,00                | (31.793,35)   | 31.390,67  |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | (19,00)                              | (2.702.750,00)              | 1.583,21  | (52.732,90)  |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | 25,00                                | 3.556.250,00                | (2.083,18)  | 69.385,38  |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (138,00)                             | (18.391.260,00)             | (4.140,00)  | 139.059,63   |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | 1,00                                 | 133.270,00                  | 30,00   | (1.044,80)   |
| Euro-BTP Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (2,00)                               | (293.920,00)                | 100,00  | 5.059,35   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (218,00)                             | (37.358.660,00)             | 0,00  | 667.857,73   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | 229,00                               | 39.243.730,00               | 0,00  | (700.374,82)   |
| EURO-BUXL 30Y BND 3/2022               | 10.03.2022 | EUR     | (2,00)                               | (413.480,00)                | 0,00  | 21.040,17  |
| Euro-OAT Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (1,00)                               | (163.210,00)                | (60,00)   | 2.880,00   |
| EURO-SCHATZ FUT 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (138,00)                             | (15.460.140,00)             | 0,00  | 22.230,17  |
| JPN 10Y BOND(OSE) 3/2022               | 22.03.2022 | JPY     | (5,00)                               | (758.400.000,00)            | (3.450,72)  | 16.139,85  |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022 | GBP     | (29,00)                              | (3.622.970,00)              | (5.178,21)  | (3.333,48)   |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022 | GBP     | 1,00                                 | 124.930,00                  | 178,56  | 149,91   |
| Short Euro-BTP Fu 3/2022               | 10.03.2022 | EUR     | 3,00                                 | 338.760,00                  | 30,00   | (1.159,90)   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 506,00                               | 65.985.562,50               | 0,00  | 499.358,68   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (424,00)                             | (55.292.250,00)             | 0,00  | (467.050,30)   |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (22,00)                              | (2.661.140,68)              | (1.062,27)  | 5.078,90   |
|  |            |         |                                      |                             | <b>(45.845,96)</b>  | <b>253.934,24</b>  |

BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 1.690.000,00 EUR gezahlt.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 830.000,00 EUR gezahlt.  
 Citibank Europe PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 533.716,00 EUR gezahlt.  
 Deutsche Bank AG hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 910.000,00 EUR gezahlt.  
 Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 470.000,00 EUR gezahlt.  
 J.P. Morgan SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 10.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in GBP)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>CHF</b>  |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 2.000.000,00  | Commerzbank Finance & Covere 2.5% 29-08-2025      | 1.768.997,65               | 0,06                         | 2.000.000,00       | Canadian Imperial Bank of Co 0.25% 27-09-2023  | 1.696.537,15               | 0,05                         |
| 12.050.000,00   | Commerzbank Finance & Covere 2.75% 09-02-2022     | 9.828.636,58               | 0,31                         | 2.200.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.01% 16-04-2029  | 1.829.006,55               | 0,06                         |
| 600.000,00  | Kommunalkredit Austria AG 3.375% 22-06-2026       | 563.550,46                 | 0,02                         | 2.900.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.01% 25-09-2030  | 2.387.600,32               | 0,08                         |
|   |   | <b>12.161.184,69</b>       | <b>0,38</b>                  | 3.500.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.05% 16-04-2024  | 2.961.713,00               | 0,09                         |
| <b>DKK</b>  |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 12.000.000,00   | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2026 SDO A E        | 1.410.622,57               | 0,04                         | 1.200.000,00       | Cie de Financement Foncier S 0.2% 16-09-2022   | 1.013.267,03               | 0,03                         |
| 29.277.760,57   | Jyske Realkredit A/S 1% 10-01-2053 SDO E          | 3.117.249,05               | 0,10                         | 2.500.000,00       | Cie de Financement Foncier S 1.2% 29-04-2031   | 2.276.287,95               | 0,07                         |
| 44.608.633,07   | Jyske Realkredit A/S 1.5% 10-01-2053 SDO E        | 4.938.525,25               | 0,16                         | 2.000.000,00       | Commerzbank AG 0.01% 11-03-2030                | 1.656.526,88               | 0,05                         |
| 40.941.307,40   | Nordea Kredit 1% 10-01-2050 SDRO 2                | 4.416.897,96               | 0,14                         | 600.000,00         | Coventry Building Society 0.01% 07-07-2028     | 497.243,35                 | 0,02                         |
| 108.185.547,53  | Nordea Kredit 1% 10-01-2053 SDRO 2                | 11.521.740,14              | 0,36                         | 1.300.000,00       | Coventry Building Society 0.125% 20-06-2026    | 1.094.335,80               | 0,03                         |
| 3.324.933,32  | Nordea Kredit 2% 10-01-2047 IO SDRO 2             | 387.721,71                 | 0,01                         | 2.000.000,00       | Deutsche Bank AG 0.05% 20-11-2024              | 1.681.980,63               | 0,05                         |
| 13.385.831,24   | Nordea Kredit 2% 10-01-2047 SDRO 2                | 1.569.243,63               | 0,05                         | 500.000,00         | Hana Bank 0.01% 26-01-2026                     | 418.567,22                 | 0,01                         |
| 1.221.272,99  | Nordea Kredit 3% 07-01-2046 SDRO 2                | 150.415,00                 | 0,00                         | 200.000,00         | HSBC Bank Canada 0.01% 14-09-2026              | 167.695,71                 | 0,01                         |
| 22.077.884,32   | Nordea Kredit FRN 07-01-2022 IO CIBOR 6M SDRO A 2 | 2.498.091,79               | 0,08                         | 600.000,00         | HYPO NOE Landesbank fuer Nie 0.01% 08-09-2028  | 499.447,99                 | 0,02                         |
| 37.771.588,55   | Nordea Kredit FRN 07-01-2023 IO CITA-6M SDRO A 2  | 4.296.221,12               | 0,14                         | 1.800.000,00       | ING-DiBa AG 1.25% 09-10-2033                   | 1.666.601,86               | 0,05                         |
| 98.000.000,00   | Nykredit Realkredit 1% 01-01-2022 SDO A H         | 11.070.783,64              | 0,35                         | 1.300.000,00       | Korea Housing Finance Corp 0.01% 05-02-2025    | 1.092.374,43               | 0,03                         |
| 21.000.000,00   | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2025 SDO A H         | 2.460.883,68               | 0,08                         | 1.500.000,00       | Leeds Building Society 0.5% 03-07-2024         | 1.280.434,66               | 0,04                         |
| 45.500.000,00   | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2026 SDO A H         | 5.350.423,45               | 0,17                         | 1.500.000,00       | LHV Pank AS 0.1% 09-06-2025                    | 1.263.904,84               | 0,04                         |
| 343.511.387,79  | Nykredit Realkredit 1% 10-01-2050 SDO E           | 36.981.653,68              | 1,16                         | 1.000.000,00       | Lloyds Bank PLC 0.125% 23-09-2029              | 832.010,10                 | 0,03                         |
| 485.160.450,63  | Nykredit Realkredit 1% 10-01-2053 SDO E           | 51.642.091,70              | 1,62                         | 600.000,00         | mBank Hipoteczny SA 0.242% 15-09-2025          | 506.938,96                 | 0,02                         |
| 192.476.349,62  | Nykredit Realkredit 1.5% 10-01-2053 SDO E         | 21.303.204,35              | 0,67                         | 2.400.000,00       | MMB SCF SACA 0.01% 14-10-2030                  | 1.967.215,21               | 0,06                         |
| 22.983.435,32   | Nykredit Realkredit 2% 10-01-2050 SDO E           | 2.673.616,00               | 0,08                         | 2.000.000,00       | Nationale-Nederlanden Bank N 0.125% 24-09-2029 | 1.668.801,80               | 0,05                         |
| 9.994.630,48  | Nykredit Realkredit 2.5% 07-01-2047 SDO E         | 1.207.535,25               | 0,04                         | 2.000.000,00       | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 01-10-2026      | 1.671.869,69               | 0,05                         |
| 10.454.780,11   | Nykredit Realkredit 3% 07-01-2046 SDO E           | 1.288.522,31               | 0,04                         | 1.000.000,00       | Royal Bank of Canada 0.01% 05-10-2028          | 831.324,61                 | 0,03                         |
| 1.212.538,87  | Nykredit Realkredit 3% 10-01-2046 IO SDO E        | 149.236,55                 | 0,00                         | 700.000,00         | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.01% 22-09-2027    | 586.372,81                 | 0,02                         |
| 115.000.000,00  | Realkredit Danmark 1% 01-01-2025 SDRO A T         | 13.440.156,47              | 0,42                         | 3.000.000,00       | SR-Boligkredit AS 0.01% 10-03-2031             | 2.455.596,62               | 0,08                         |
| 72.000.000,00   | Realkredit Danmark 1% 04-01-2022 SDRO A T         | 8.164.650,11               | 0,26                         | 1.000.000,00       | Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.409% 07-11-2029 | 843.349,20                 | 0,03                         |
| 39.000.000,00   | Realkredit Danmark 1% 04-01-2026 SDRO A T         | 4.583.567,22               | 0,14                         | 3.000.000,00       | UniCredit Bank AG 0.01% 10-03-2031             | 2.467.491,84               | 0,08                         |
| 69.626.049,24   | Realkredit Danmark 1.5% 10-01-2053 SDRO S         | 7.704.216,54               | 0,24                         | 1.000.000,00       | United Overseas Bank Ltd 0.1% 25-05-2029       | 831.327,97                 | 0,03                         |
| 9.358.672,56  | Realkredit Danmark 2.5% 04-01-2047 SDRO S         | 1.131.492,75               | 0,04                         | 400.000,00         | Westpac Banking Corp 0.01% 22-09-2028          | 331.708,60                 | 0,01                         |
|   |   | <b>203.458.761,92</b>      | <b>6,40</b>                  | 1.200.000,00       | Westpac Securities NZ Ltd/Lo 0.01% 08-06-2028  | 994.631,85                 | 0,03                         |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 6.500.000,00  | Australia & New Zealand Bank 0.25% 29-11-2022     | 5.497.768,68               | 0,17                         |                    |  | <b>65.097.450,78</b>       | <b>2,05</b>                  |
| 5.300.000,00  | AXA Home Loan SFH SA 0.01% 16-10-2029             | 4.387.872,82               | 0,14                         | <b>NOK</b>         |  |                            |                              |
| 900.000,00  | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.01% 23-09-2030     | 740.986,97                 | 0,02                         | 50.000.000,00      | Spb 1 Boligkredit AS 18/24 ADJ C COVID         | 4.278.533,71               | 0,13                         |
| 3.000.000,00  | BPCE SFH SA 0.375% 21-02-2024                     | 2.556.670,70               | 0,08                         |                    |  | <b>4.278.533,71</b>        | <b>0,13</b>                  |
| 3.000.000,00  | BPCE SFH SA 0.625% 29-05-2031                     | 2.599.125,55               | 0,08                         | <b>USD</b>         |  |                            |                              |
| 4.500.000,00  | BPCE SFH SA 0.75% 27-11-2026                      | 3.918.194,46               | 0,12                         | 14.171.300,00      | United States Treasury Note/ 0.625% 15-05-2030 | 9.823.206,92               | 0,31                         |
| 10.000,00   | Bundesrepublik Deutschland B 1.5% 15-02-2023      | 8.612,44                   | 0,00                         | 12.325.400,00      | United States Treasury Note/ 0.625% 15-08-2030 | 8.521.176,56               | 0,27                         |
| 10.000,00   | Bundesrepublik Deutschland B 1.75% 15-02-2024     | 8.837,41                   | 0,00                         | 12.948.500,00      | United States Treasury Note/ 0.875% 15-11-2030 | 9.127.897,79               | 0,29                         |
| 5.600.000,00  | Caisse de Refinancement de l 0.01% 08-10-2029     | 4.644.277,97               | 0,15                         | 11.775.700,00      | United States Treasury Note/ 1.25% 15-08-2031  | 8.537.229,64               | 0,27                         |
| 1.500.000,00  | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 07-10-2026     | 1.262.939,15               | 0,04                         | 14.124.200,00      | United States Treasury Note/ 1.625% 15-05-2031 | 10.603.232,71              | 0,33                         |
|   |   |                            |                              | 9.160.100,00       | United States Treasury Note/ 1.75% 15-11-2029  | 6.960.475,18               | 0,22                         |
|   |   |                            |                              | 10.060.200,00      | United States Treasury Note/ 2.25% 15-02-2027  | 7.818.143,80               | 0,25                         |
|   |   |                            |                              | 13.011.000,00      | United States Treasury Note/ 2.25% 15-08-2027  | 10.123.756,12              | 0,32                         |
|   |   |                            |                              | 22.688.800,00      | United States Treasury Note/ 2.375% 15-05-2029 | 17.935.971,41              | 0,56                         |
|   |   |                            |                              | 3.374.300,00       | United States Treasury Note/ 2.625% 15-02-2029 | 2.706.167,40               | 0,09                         |
|   |   |                            |                              | 33.279.300,00      | United States Treasury Note/ 2.75% 15-02-2028  | 26.682.076,24              | 0,84                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in GBP) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--------------|----------------------------|------------------------------|
| 6.668.900,00       | United States Treasury Note/<br>2.875% 15-05-2028      | 5.389.955,83               | 0,17                         |                    |              |                            |                              |
| 15.388.200,00      | United States Treasury Note/<br>3.125% 15-11-2028      | 12.686.751,54              | 0,40                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>                                  | <b>136.916.041,14</b>      | <b>4,31</b>                  |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>Aktien</b>  |                            |                              |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>BRL</b>   |                            |                              |                    |              |                            |                              |
| 629.180,00         | Banco Bradesco   | 1.609.387,20               | 0,05                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>CAD</b>   | <b>1.609.387,20</b>        | <b>0,05</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 444.100,00         | Bank of Nova Scotia/The                                | 23.260.707,65              | 0,73                         |                    |              |                            |                              |
| 322.300,00         | Royal Bank of Canada                                   | 25.228.686,30              | 0,79                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>CHF</b>   | <b>48.489.393,95</b>       | <b>1,53</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 118.086,00         | Nestle   | 12.239.019,06              | 0,39                         |                    |              |                            |                              |
| 39.154,00          | Roche Holding  | 12.071.809,06              | 0,38                         |                    |              |                            |                              |
| 8.869,00           | Sonova Holding   | 2.580.818,29               | 0,08                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>DKK</b>   | <b>26.891.646,41</b>       | <b>0,85</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 703.728,00         | Novo Nordisk B   | 58.431.153,22              | 1,84                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>   | <b>58.431.153,22</b>       | <b>1,84</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 85.060,00          | Allianz  | 14.837.697,35              | 0,47                         |                    |              |                            |                              |
| 338.553,00         | Deutsche Post  | 16.080.208,11              | 0,51                         |                    |              |                            |                              |
| 496.537,00         | Iberdrola  | 4.342.217,17               | 0,14                         |                    |              |                            |                              |
| 89.651,00          | Muenchener Rueckversicherungs-<br>Gesellschaft AG in M | 19.618.782,85              | 0,62                         |                    |              |                            |                              |
| 92.835,00          | Prosus   | 5.734.367,24               | 0,18                         |                    |              |                            |                              |
| 305.476,00         | Sanofi   | 22.731.179,19              | 0,72                         |                    |              |                            |                              |
| 165.401,00         | Siemens  | 21.214.337,64              | 0,67                         |                    |              |                            |                              |
| 364.170,00         | Unilever   | 14.395.247,57              | 0,45                         |                    |              |                            |                              |
| 440.740,00         | Vinci  | 34.399.657,76              | 1,08                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>GBP</b>   | <b>153.353.694,88</b>      | <b>4,82</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 1.410.489,00       | National Grid  | 14.948.362,42              | 0,47                         |                    |              |                            |                              |
| 166.697,00         | Reckitt Benckiser Group                                | 10.571.923,74              | 0,33                         |                    |              |                            |                              |
| 884.268,00         | Rightmove  | 7.029.930,60               | 0,22                         |                    |              |                            |                              |
| 255.624,00         | Unilever   | 10.086.539,60              | 0,32                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>HKD</b>   | <b>42.636.756,36</b>       | <b>1,34</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 2.408.000,00       | China Communications<br>Construction                   | 970.925,10                 | 0,03                         |                    |              |                            |                              |
| 10.542.000,00      | China Construction Bank                                | 5.413.525,20               | 0,17                         |                    |              |                            |                              |
| 3.352.592,00       | China Everbright Environment<br>Group                  | 1.995.806,48               | 0,06                         |                    |              |                            |                              |
| 1.274.400,00       | China Gas Holdings                                     | 1.963.288,71               | 0,06                         |                    |              |                            |                              |
| 643.000,00         | China Longyuan Power Group                             | 1.112.873,38               | 0,04                         |                    |              |                            |                              |
| 1.184.500,00       | China Mobile   | 5.271.622,58               | 0,17                         |                    |              |                            |                              |
| 2.687.500,00       | China Overseas Land &<br>Investment                    | 4.717.843,83               | 0,15                         |                    |              |                            |                              |
| 1.251.500,00       | China Railway Construction                             | 606.966,08                 | 0,02                         |                    |              |                            |                              |
| 944.000,00         | China Resources Land                                   | 2.944.484,21               | 0,09                         |                    |              |                            |                              |
| 9.516.000,00       | China Telecom  | 2.352.833,38               | 0,07                         |                    |              |                            |                              |
| 2.228.000,00       | CRRC   | 709.779,39                 | 0,02                         |                    |              |                            |                              |
| 562.000,00         | Hengan International Group                             | 2.145.780,31               | 0,07                         |                    |              |                            |                              |
| 12.670.000,00      | Industrial & Commercial Bank<br>of China               | 5.301.425,75               | 0,17                         |                    |              |                            |                              |
| 1.459.000,00       | Ping An Insurance Group Co of<br>China                 | 7.790.555,82               | 0,25                         |                    |              |                            |                              |
| 2.638.800,00       | Sinopharm Group  | 4.255.942,14               | 0,13                         |                    |              |                            |                              |
| 669.000,00         | Techtronic Industries                                  | 9.873.729,52               | 0,31                         |                    |              |                            |                              |
| 83.000,00          | Tencent Holdings                                       | 3.605.517,26               | 0,11                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>IDR</b>   | <b>61.032.899,14</b>       | <b>1,92</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 40.250.900,00      | Telkom Indonesia Persero                               | 8.462.123,83               | 0,27                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>INR</b>   | <b>8.462.123,83</b>        | <b>0,27</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 175.943,00         | Axis Bank  | 1.191.160,19               | 0,04                         |                    |              |                            |                              |
| 608.925,00         | HCL Technologies                                       | 8.014.157,02               | 0,25                         |                    |              |                            |                              |
| 594.010,00         | Infosys  | 11.188.054,09              | 0,35                         |                    |              |                            |                              |
| 2.513.089,00       | Power Grid Corp of India                               | 5.125.132,32               | 0,16                         |                    |              |                            |                              |
| 729.041,00         | UPL  | 5.434.342,56               | 0,17                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>JPY</b>   | <b>30.952.846,18</b>       | <b>0,97</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 127.100,00         | Hoya   | 14.008.816,57              | 0,44                         |                    |              |                            |                              |
| 967.900,00         | KDDI   | 20.962.066,17              | 0,66                         |                    |              |                            |                              |
| 1.137.000,00       | Nippon Telegraph & Telephone                           | 23.071.557,16              | 0,73                         |                    |              |                            |                              |
| 230.200,00         | Seven & i Holdings                                     | 7.497.531,05               | 0,24                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>KRW</b>   | <b>65.539.970,95</b>       | <b>2,06</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 66.345,00          | BNK Financial Group                                    | 347.703,80                 | 0,01                         |                    |              |                            |                              |
| 35.233,00          | Hyundai Glovis   | 3.693.013,13               | 0,12                         |                    |              |                            |                              |
| 21.857,00          | Hyundai Mobis  | 3.470.565,82               | 0,11                         |                    |              |                            |                              |
| 19.572,00          | LG   | 987.883,37                 | 0,03                         |                    |              |                            |                              |
| 8.161,00           | LX Holdings  | 50.917,30                  | 0,00                         |                    |              |                            |                              |
| 240.312,00         | Samsung Electronics                                    | 11.739.758,59              | 0,37                         |                    |              |                            |                              |
| 39.951,00          | Samsung Fire & Marine Insurance                        | 5.035.017,34               | 0,16                         |                    |              |                            |                              |
| 157.348,00         | SK Square  | 6.518.553,78               | 0,21                         |                    |              |                            |                              |
| 155.867,00         | SK Telecom   | 5.630.600,14               | 0,18                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>MXN</b>   | <b>37.474.013,27</b>       | <b>1,18</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 247.200,00         | Grupo Financiero Banorte                               | 1.200.306,14               | 0,04                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>PHP</b>   | <b>1.200.306,14</b>        | <b>0,04</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 19.095,00          | PLDT   | 503.251,43                 | 0,02                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>THB</b>   | <b>503.251,43</b>          | <b>0,02</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 399.500,00         | Advanced Info Service                                  | 2.040.077,23               | 0,06                         |                    |              |                            |                              |
| 658.400,00         | Bangkok Bank   | 1.776.102,76               | 0,06                         |                    |              |                            |                              |
| 1.924.200,00       | Thai Union Group                                       | 833.080,20                 | 0,03                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>TRY</b>   | <b>4.649.260,19</b>        | <b>0,15</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 4.502.292,00       | Akbank TAS   | 1.779.469,90               | 0,06                         |                    |              |                            |                              |
| 193.268,00         | BIM Birlesik Magazalar                                 | 655.198,51                 | 0,02                         |                    |              |                            |                              |
| 2.574.120,00       | Turkcell Iletisim Hizmetleri                           | 2.544.174,59               | 0,08                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>TWD</b>   | <b>4.978.843,00</b>        | <b>0,16</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 762.000,00         | Taiwan Semiconductor<br>Manufacturing                  | 12.562.656,43              | 0,40                         |                    |              |                            |                              |
|                    | <b>USD</b>   | <b>12.562.656,43</b>       | <b>0,40</b>                  |                    |              |                            |                              |
| 140.786,00         | Accenture  | 43.116.038,72              | 1,36                         |                    |              |                            |                              |
| 442.726,00         | Akamai Technologies                                    | 38.444.233,46              | 1,21                         |                    |              |                            |                              |
| 68.664,00          | Alibaba Group Holding ADR                              | 6.162.088,54               | 0,19                         |                    |              |                            |                              |
| 39.188,00          | Alphabet   | 84.656.019,98              | 2,66                         |                    |              |                            |                              |
| 191.730,00         | Amgen  | 32.218.546,33              | 1,01                         |                    |              |                            |                              |
| 146.281,00         | Anthem   | 50.664.022,28              | 1,59                         |                    |              |                            |                              |
| 180.006,00         | Apple  | 23.748.028,79              | 0,75                         |                    |              |                            |                              |
| 252.329,00         | Archer-Daniels-Midland                                 | 12.557.498,97              | 0,40                         |                    |              |                            |                              |
| 202.767,00         | Automatic Data Processing                              | 36.915.534,67              | 1,16                         |                    |              |                            |                              |
| 37.654,00          | AutoZone   | 58.191.250,54              | 1,83                         |                    |              |                            |                              |
| 27.378,00          | Baidu ADR  | 3.043.804,93               | 0,10                         |                    |              |                            |                              |
| 1.198.992,00       | Bristol-Myers Squibb                                   | 55.747.836,78              | 1,75                         |                    |              |                            |                              |
| 180.812,00         | Cadence Design Systems                                 | 24.897.690,32              | 0,78                         |                    |              |                            |                              |
| 223.558,00         | Cerner   | 15.420.080,07              | 0,49                         |                    |              |                            |                              |
| 249.716,00         | Check Point Software<br>Technologies                   | 21.621.186,52              | 0,68                         |                    |              |                            |                              |
| 92.680,00          | Chubb  | 13.309.818,56              | 0,42                         |                    |              |                            |                              |
| 293.707,00         | Cia de Saneamento Basico do<br>Estado de Sao Paulo AD  | 1.605.444,33               | 0,05                         |                    |              |                            |                              |
| 353.270,00         | Cigna  | 60.600.621,63              | 1,91                         |                    |              |                            |                              |
| 1.326.515,00       | Cisco Systems  | 62.444.490,75              | 1,96                         |                    |              |                            |                              |
| 60.759,00          | Citrix Systems   | 4.314.821,80               | 0,14                         |                    |              |                            |                              |
| 2.101.818,00       | Coca-Cola  | 91.497.594,95              | 2,88                         |                    |              |                            |                              |
| 474.229,00         | Cognizant Technology Solutions                         | 31.240.094,71              | 0,98                         |                    |              |                            |                              |
| 295.410,00         | Colgate-Palmolive                                      | 18.557.611,03              | 0,58                         |                    |              |                            |                              |
| 1.418.069,00       | Comcast  | 53.239.377,47              | 1,68                         |                    |              |                            |                              |
| 498.730,00         | CVS Health   | 38.217.595,12              | 1,20                         |                    |              |                            |                              |
| 71.171,00          | Dollar General   | 12.445.819,44              | 0,39                         |                    |              |                            |                              |
| 1.018.800,00       | eBay   | 50.037.036,17              | 1,57                         |                    |              |                            |                              |
| 42.276,00          | Estee Lauder Cos                                       | 11.547.747,54              | 0,36                         |                    |              |                            |                              |
| 219.606,00         | Expeditors International of<br>Washington              | 21.634.847,53              | 0,68                         |                    |              |                            |                              |
| 64.015,00          | F5   | 11.657.348,45              | 0,37                         |                    |              |                            |                              |
| 433.725,00         | Fiserv   | 33.548.305,39              | 1,06                         |                    |              |                            |                              |
| 131.606,00         | Global Payments  | 13.378.267,69              | 0,42                         |                    |              |                            |                              |
| 87.039,00          | Hershey  | 12.342.844,15              | 0,39                         |                    |              |                            |                              |
| 438.713,00         | Infosys ADR  | 8.290.741,84               | 0,26                         |                    |              |                            |                              |
| 8.217,00           | Intuit   | 3.904.766,17               | 0,12                         |                    |              |                            |                              |
| 699.625,00         | Johnson & Johnson                                      | 89.291.307,39              | 2,81                         |                    |              |                            |                              |
| 217.904,00         | Kellogg  | 10.333.591,73              | 0,33                         |                    |              |                            |                              |
| 110.294,00         | Kimberly-Clark   | 11.611.014,11              | 0,37                         |                    |              |                            |                              |
| 50.064,00          | Kyndryl Holdings                                       | 690.269,05                 | 0,02                         |                    |              |                            |                              |
| 7.532,00           | Lowe's Cos   | 1.433.498,86               | 0,05                         |                    |              |                            |                              |
| 104.726,00         | Marsh & McLennan Cos                                   | 13.465.326,21              | 0,42                         |                    |              |                            |                              |
| 128.489,00         | Mastercard   | 34.463.221,74              | 1,08                         |                    |              |                            |                              |
| 139.428,00         | McDonald's   | 27.646.722,34              | 0,87                         |                    |              |                            |                              |
| 610.737,00         | Medtronic  | 47.298.937,49              | 1,49                         |                    |              |                            |                              |
| 310.657,00         | Merck  | 17.803.505,41              | 0,56                         |                    |              |                            |                              |
| 202.544,00         | Microsoft  | 50.681.817,54              | 1,59                         |                    |              |                            |                              |
| 812.367,00         | Mondelez International                                 | 39.642.280,40              | 1,25                         |                    |              |                            |                              |
| 424.207,00         | Monster Beverage                                       | 30.037.115,04              | 0,95                         |                    |              |                            |                              |
| 357.700,00         | NIKE   | 44.246.240,36              | 1,39                         |                    |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in GBP) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 228.682,00         | Oracle  | 14.877.983,39              | 0,47                         |
| 57.212,00          | Organon   | 1.302.259,35               | 0,04                         |
| 83.488,00          | Paychex   | 8.431.774,04               | 0,27                         |
| 474.837,00         | PepsiCo   | 60.640.942,57              | 1,91                         |
| 744.562,00         | Pfizer  | 32.757.856,38              | 1,03                         |
| 238.575,00         | Procter & Gamble  | 28.767.724,86              | 0,91                         |
| 714.657,00         | Public Service Enterprise Group   | 35.120.650,25              | 1,10                         |
| 187.589,00         | Ross Stores   | 15.858.039,14              | 0,50                         |
| 48.983,79          | SK Telecom ADR  | 976.188,03                 | 0,03                         |
| 354.481,00         | Starbucks   | 30.663.145,40              | 0,96                         |
| 75.879,00          | State Street  | 5.234.936,26               | 0,16                         |
| 56.025,00          | Stryker   | 11.222.451,95              | 0,35                         |
| 30.554,00          | Target  | 5.211.153,18               | 0,16                         |
| 326.894,00         | Texas Roadhouse   | 22.060.435,36              | 0,69                         |
| 361.269,00         | TJX Cos   | 20.256.572,24              | 0,64                         |
| 241.907,00         | Toro  | 17.817.832,92              | 0,56                         |
| 38.016,00          | UnitedHealth Group  | 14.219.275,33              | 0,45                         |
| 748.553,00         | Verizon Communications  | 28.997.198,78              | 0,91                         |
| 200.027,00         | Visa  | 32.201.928,75              | 1,01                         |
| 272.808,00         | VMware  | 23.703.520,83              | 0,75                         |
| 172.359,00         | Walmart   | 18.273.914,56              | 0,57                         |
| 106.584,00         | Waste Management  | 13.106.598,80              | 0,41                         |
| 33.247,00          | WW Grainger   | 12.724.011,30              | 0,40                         |
| 296.840,00         | Xilinx  | 46.704.470,43              | 1,47                         |
| 150.528,00         | Zimmer Biomet Holdings  | 14.290.279,58              | 0,45                         |
|                    |   | <b>1.995.285.046,97</b>    | <b>62,78</b>                 |
|                    | <b>ZAR</b>  |                            |                              |
| 220.495,00         | Absa Group  | 1.564.097,15               | 0,05                         |
| 66.751,00          | FirstRand   | 188.718,35                 | 0,01                         |
| 22.958,00          | Naspers   | 2.638.975,05               | 0,08                         |
| 620.416,00         | Netcare   | 458.127,39                 | 0,01                         |
| 514.826,00         | Sanlam  | 1.421.042,71               | 0,04                         |
| 259.243,00         | Standard Bank Group   | 1.687.791,75               | 0,05                         |
| 16.015,00          | Vodacom Group   | 100.251,13                 | 0,00                         |
|                    |   | <b>8.059.003,53</b>        | <b>0,25</b>                  |
|                    | <b>Summe Aktien</b>   | <b>2.562.112.253,08</b>    | <b>80,61</b>                 |
|                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>2.984.024.225,32</b>    | <b>93,88</b>                 |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 1.000.000,00       | Sumitomo Mitsui Banking Corp<br>0.01% 10-09-2025  | 837.882,82                 | 0,03                         |
|                    |   | <b>837.882,82</b>          | <b>0,03</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>837.882,82</b>          | <b>0,03</b>                  |
|                    | <b>Aktien</b>   |                            |                              |
|                    | <b>CNY</b>  |                            |                              |
| 527.216,00         | China Resources Double Crane<br>Pharmaceutical  | 820.286,73                 | 0,03                         |
| 1.434.501,00       | China Resources Sanjiu Medical &<br>Pharmaceutical  | 5.715.843,25               | 0,18                         |
| 413.500,00         | Shenzhen Overseas Chinese Town  | 338.761,36                 | 0,01                         |
|                    |   | <b>6.874.891,34</b>        | <b>0,22</b>                  |
|                    | <b>Summe Aktien</b>   | <b>6.874.891,34</b>        | <b>0,22</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>7.712.774,16</b>        | <b>0,24</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>2.991.736.999,48</b>    | <b>94,13</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>144.683.437,86</b>      | <b>4,55</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>41.976.079,40</b>       | <b>1,32</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>3.178.396.516,74</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land  |              |   |              |
|---|--------------|---|--------------|
| USA   | 62,51        | Handelsgesellschaften und Großhändler               | 0,40         |
| Dänemark  | 8,24         | Industriemaschinen                                  | 0,31         |
| Irland  | 2,84         | Stromversorger                                      | 0,30         |
| Frankreich  | 2,76         | Lebens- und Krankenversicherung                     | 0,29         |
| Deutschland   | 2,49         | Lebensmitteleinzelhandel                            | 0,26         |
| Japan   | 2,11         | Immobilienentwicklung                               | 0,24         |
| Vereinigtes Königreich                              | 1,91         | Dünger und Chemikalien für die Landwirtschaft       | 0,17         |
| Kanada  | 1,65         | Vermögensverwaltung und Depotbanken                 | 0,16         |
| Republik Korea                                      | 1,26         | Gesundheitswesen: Vertrieb                          | 0,13         |
| Schweiz   | 1,26         | Autoteile und -zubehör                              | 0,11         |
| Indien  | 1,23         | Gasversorger  | 0,06         |
| China   | 1,11         | Einzelhandel: Heimwerker und Garten                 | 0,05         |
| Hongkong  | 0,69         | Wasserversorger                                     | 0,05         |
| Israel  | 0,68         | Erneuerbare Elektrizität                            | 0,04         |
| Kaimaninseln  | 0,56         | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 0,02         |
| Taiwan, Provinz Chinas                              | 0,40         | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 0,01         |
| Luxemburg   | 0,36         | Freizeiteinrichtungen                               | 0,01         |
| Indonesien  | 0,27         | Sonstige verschiedene Finanzdienstleistungen        | 0,01         |
| Südafrika   | 0,25         | Regionale Banken                                    | 0,01         |
| Niederlande   | 0,23         |   |              |
| Norwegen  | 0,23         |   |              |
| Australien  | 0,18         |   |              |
| Türkei  | 0,16         |   |              |
| Thailand  | 0,15         |   |              |
| Spanien   | 0,14         |   |              |
| Brasilien   | 0,10         |   |              |
| Österreich  | 0,06         |   |              |
| Bermuda   | 0,06         |   |              |
| Slowakei  | 0,05         |   |              |
| Estland   | 0,04         |   |              |
| Mexiko  | 0,04         |   |              |
| Neuseeland  | 0,03         |   |              |
| Singapur  | 0,03         |   |              |
| Philippinen   | 0,02         |   |              |
| Polen   | 0,02         |   |              |
| <b>Summe</b>  | <b>94,13</b> | <b>Summe</b>  | <b>94,13</b> |
| <b>Sektor</b>                                       |              |   |              |
| Pharmazeutika                                       | 9,33         |   |              |
| Alkoholfreie Getränke                               | 5,73         |   |              |
| Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 5,00         |   |              |
| Kündbare Hypothekendarlehen                         | 4,73         |   |              |
| Staatsanleihen                                      | 4,34         |   |              |
| Systemssoftware                                     | 3,49         |   |              |
| IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen           | 3,23         |   |              |
| Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  | 3,11         |   |              |
| Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 3,09         |   |              |
| Hypothekendarlehen                                  | 3,02         |   |              |
| Restaurants   | 2,53         |   |              |
| Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 2,37         |   |              |
| Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 2,37         |   |              |
| Kommunikationsanlagen                               | 2,33         |   |              |
| Verschiedene Banken                                 | 2,20         |   |              |
| Haushaltsprodukte                                   | 2,19         |   |              |
| Halbleiter  | 2,07         |   |              |
| Gesundheitswesen: Managed Health Care               | 2,04         |   |              |
| Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 2,03         |   |              |
| Integrierte Telekommunikationsdienste               | 1,98         |   |              |
| Kraftfahrzeugeinzelhandel                           | 1,83         |   |              |
| Kabel und Satellitenübertragung                     | 1,68         |   |              |
| Mehrsparten-Versorger                               | 1,58         |   |              |
| Schuhe  | 1,39         |   |              |
| Luftfracht und Logistik                             | 1,30         |   |              |
| Unternehmensanleihen                                | 1,22         |   |              |
| Internet-Dienste und -Infrastruktur                 | 1,21         |   |              |
| Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 1,20         |   |              |
| Drahtlose Telekommunikationsdienste                 | 1,20         |   |              |
| Bekleidung-Einzelhandel                             | 1,14         |   |              |
| Bau- und Ingenieurwesen                             | 1,13         |   |              |
| Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie    | 1,12         |   |              |
| Anwendungssoftware                                  | 1,04         |   |              |
| Biotechnologie                                      | 1,01         |   |              |
| Industriekonglomerate                               | 0,70         |   |              |
| Rückversicherungen                                  | 0,62         |   |              |
| Sach- und Unfallversicherung                        | 0,58         |   |              |
| Großmärkte  | 0,57         |   |              |
| Landwirtschafts- und Landmaschinen                  | 0,56         |   |              |
| Warenhäuser   | 0,56         |   |              |
| Gesundheitswesen: Technologie                       | 0,49         |   |              |
| Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 0,48         |   |              |
| Mehrspartenversicherungen                           | 0,47         |   |              |
| Gesundheitswesen: Produkte                          | 0,44         |   |              |
| Versicherungsmakler                                 | 0,42         |   |              |
| Landwirtschaftliche Produkte                        | 0,40         |   |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                             | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag  | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (GBP) | Falligkeit |
|---|--------------------|--------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>        |                    |                    |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b> |                    |                    |                      |   |             |
| 4.023.454,61                                  | CHF                | 5.453.000,00       | CAD                  | 94.071,07   | 01.02.2022  |
| 233.426.449,72                                | GBP                | 397.416.046,98     | CAD                  | 1.592.414,28  | 01.02.2022  |
| 4.498.000,00                                  | GBP                | 52.000.829,24      | NOK                  | 124.789,07  | 01.02.2022  |
| 27.599.327.126,00                             | JPY                | 176.233.565,26     | GBP                  | 1.607.629,03  | 01.02.2022  |
| 373.103.000,00                                | JPY                | 29.861.786,62      | SEK                  | (43.562,63)   | 01.02.2022  |
| 5.591.000,00                                  | AUD                | 3.990.069,15       | USD                  | 46.358,40   | 16.02.2022  |
| 413.788.183,78                                | GBP                | 487.797.027,03     | EUR                  | 3.564.975,70  | 16.02.2022  |
| 6.127.064,96                                  | GBP                | 8.121.000,00       | USD                  | 102.950,97  | 18.02.2022  |
| 981.000,00                                    | USD                | 736.342,87         | GBP                  | (8.643,26)  | 18.02.2022  |
| 7.945.146,83                                  | GBP                | 9.323.099,00       | EUR                  | 100.579,62  | 07.03.2022  |
|   |                    |                    |                      | <b>7.181.562,25</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>            |                    |                    |                      |   |             |
| 168.609.200,98                                | GBP                | 198.494.766,00     | EUR                  | 1.815.080,08  | 13.01.2022  |
| 7.321.000,00                                  | AUD                | 5.231.664,20       | USD                  | 55.404,83   | 01.02.2022  |
| 7.068.534,87                                  | CAD                | 7.673.000,00       | AUD                  | (1.644,95)  | 01.02.2022  |
| 1.242.700,39                                  | CAD                | 1.435.000,00       | NZD                  | (1.502,49)  | 01.02.2022  |
| 2.446.320,66                                  | CHF                | 3.931.000,00       | NZD                  | 1.334,93  | 01.02.2022  |
| 62.908.000,00                                 | EUR                | 65.621.568,03      | CHF                  | (532.685,08)  | 01.02.2022  |
| 27.599.327.127,00                             | JPY                | 176.942.355,95     | GBP                  | 898.917,88  | 01.02.2022  |
| 43.206.000,00                                 | JPY                | 3.339.936,52       | SEK                  | 4.635,76  | 01.02.2022  |
| 9.303.389,08                                  | NOK                | 118.550.000,00     | JPY                  | 18.501,05   | 01.02.2022  |
| 633.842.121,70                                | SEK                | 70.027.000,00      | USD                  | 14.444,59   | 01.02.2022  |
| 143.825.000,00                                | USD                | 163.800.349.264,00 | JPY                  | 1.128.377,98  | 01.02.2022  |
| 1.357.000,00                                  | USD                | 11.976.127,92      | SEK                  | 24.850,18   | 01.02.2022  |
| 4.292.000,00                                  | EUR                | 3.651.351,19       | GBP                  | (43.037,87)   | 04.02.2022  |
| 7.289.000,00                                  | EUR                | 8.261.776,64       | USD                  | (96,95)   | 04.02.2022  |
| 261.026.628,69                                | GBP                | 479.131.996,26     | AUD                  | 3.409.776,38  | 16.02.2022  |
| 6.829.852,63                                  | GBP                | 8.052.000,00       | EUR                  | 58.353,34   | 16.02.2022  |
| 61.516.157,23                                 | GBP                | 117.700.075,50     | NZD                  | 1.942.632,32  | 16.02.2022  |
| 308.415.946,00                                | JPY                | 2.378.000,00       | EUR                  | (12.105,87)   | 16.02.2022  |
| 47.375.120.498,00                             | JPY                | 309.069.224,05     | GBP                  | (3.739.408,22)  | 16.02.2022  |
| 2.994.719,13                                  | USD                | 4.263.000,00       | AUD                  | (70.656,04)   | 16.02.2022  |
| 6.220.013,87                                  | USD                | 5.480.000,00       | EUR                  | 5.375,80  | 16.02.2022  |
| 101.890.338,26                                | USD                | 75.730.253,63      | GBP                  | (149.873,46)  | 16.02.2022  |
| 12.825.483,87                                 | EUR                | 10.862.039,00      | GBP                  | (75.592,20)   | 18.02.2022  |
| 38.247.242,99                                 | GBP                | 47.595.244,00      | CHF                  | (515.795,10)  | 18.02.2022  |
| 6.963.305,00                                  | GBP                | 8.211.923,45       | EUR                  | 56.937,81   | 18.02.2022  |
| 76.811.068,14                                 | GBP                | 11.798.054.864,00  | JPY                  | 771.150,19  | 18.02.2022  |
| 4.362.834,63                                  | GBP                | 51.166.000,00      | NOK                  | 60.810,13   | 18.02.2022  |
| 321.477.112,28                                | GBP                | 432.257.000,00     | USD                  | 818.843,78  | 24.02.2022  |
|   |                    |                    |                      | <b>5.943.028,80</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |                    |                    |                      |   |             |
| 2.442.000,00                                  | EUR                | 2.080.845,29       | GBP                  | (28.845,09)   | 13.01.2022  |
| 1.798.974,43                                  | GBP                | 2.126.000,00       | EUR                  | 12.507,97   | 13.01.2022  |
| 1.734.000,00                                  | AUD                | 141.029.688,00     | JPY                  | 23.465,56   | 01.02.2022  |
| 2.691.000,00                                  | AUD                | 1.923.763,34       | USD                  | 19.811,88   | 01.02.2022  |
| 2.250.898,10                                  | CAD                | 2.436.000,00       | AUD                  | 3.445,17  | 01.02.2022  |
| 11.867.000,00                                 | CAD                | 84.097.935,13      | SEK                  | 29.265,77   | 01.02.2022  |
| 852.000,00                                    | EUR                | 109.236.624,00     | JPY                  | 12.343,62   | 01.02.2022  |
| 77.098.467,74                                 | GBP                | 148.584.766,12     | NZD                  | 1.880.639,82  | 01.02.2022  |
| 85.050.668,00                                 | JPY                | 741.000,00         | USD                  | (1.576,88)  | 01.02.2022  |
| 52.774.019,05                                 | NOK                | 654.478.000,00     | JPY                  | 220.946,13  | 01.02.2022  |
| 26.142.000,00                                 | NZD                | 160.982.932,70     | SEK                  | 38.252,18   | 01.02.2022  |
| 4.360.000,00                                  | USD                | 5.588.038,47       | CAD                  | (25.883,78)   | 01.02.2022  |
| 8.155.000,00                                  | USD                | 922.049.153,00     | JPY                  | 107.345,00  | 01.02.2022  |
| 4.396.000,00                                  | USD                | 40.000.364,54      | NOK                  | (103.348,51)  | 01.02.2022  |
| 105.289.375,11                                | EUR                | 89.711.075,04      | GBP                  | (1.193.570,78)  | 04.02.2022  |
| 91.593.460,85                                 | GBP                | 124.951.771,81     | USD                  | (1.086.754,09)  | 04.02.2022  |
| 2.504.820,79                                  | USD                | 2.215.000,00       | EUR                  | (4.263,92)  | 04.02.2022  |
| 5.966.000,00                                  | AUD                | 481.937.656,00     | JPY                  | 101.681,20  | 16.02.2022  |
| 4.676.000,00                                  | EUR                | 5.313.538,00       | USD                  | (9.107,65)  | 16.02.2022  |
| 6.261.000,00                                  | GBP                | 945.581.925,00     | JPY                  | 166.761,14  | 16.02.2022  |
| 573.478.820,79                                | GBP                | 768.520.000,00     | USD                  | 3.404.317,75  | 16.02.2022  |
| 243.371.146,00                                | JPY                | 1.878.000,00       | EUR                  | (10.830,12)   | 16.02.2022  |
| 3.894.510,59                                  | USD                | 5.443.000,00       | AUD                  | (37.668,30)   | 16.02.2022  |
| 4.402.847,42                                  | USD                | 3.896.000,00       | EUR                  | (10.465,13)   | 16.02.2022  |
| 486.696.335,18                                | USD                | 363.173.955,60     | GBP                  | (2.151.248,79)  | 16.02.2022  |
| 3.348.000,00                                  | AUD                | 1.798.607,93       | GBP                  | 1.549,38  | 18.02.2022  |
| 1.119.000,00                                  | CAD                | 663.648,06         | GBP                  | (10.840,58)   | 18.02.2022  |
| 60.943.000,00                                 | DKK                | 6.990.635,83       | GBP                  | (97.962,15)   | 18.02.2022  |
| 9.423.548,63                                  | EUR                | 8.014.713,68       | GBP                  | (89.343,50)   | 18.02.2022  |
| 4.275.127,51                                  | GBP                | 7.903.000,00       | AUD                  | 25.824,57   | 18.02.2022  |
| 51.478.565,08                                 | GBP                | 86.881.000,00      | CAD                  | 793.529,95  | 18.02.2022  |
| 5.597.544,08                                  | GBP                | 48.925.000,00      | DKK                  | 64.113,63   | 18.02.2022  |
| 242.872.443,11                                | GBP                | 287.079.690,39     | EUR                  | 1.433.674,26  | 18.02.2022  |
| 6.789.216,99                                  | GBP                | 1.026.136.000,00   | JPY                  | 175.618,57  | 18.02.2022  |
| 1.279.199.308,13                              | GBP                | 1.720.134.000,00   | USD                  | 3.217.537,01  | 18.02.2022  |
| 1.530.458.000,00                              | JPY                | 10.079.957,06      | GBP                  | (215.939,46)  | 18.02.2022  |
| 63.769.000,00                                 | USD                | 47.657.837,30      | GBP                  | (354.443,38)  | 18.02.2022  |
| 11.150.083,54                                 | GBP                | 15.000.000,00      | USD                  | 22.737,25   | 24.02.2022  |
|   |                    |                    |                      | <b>6.323.275,70</b>   |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                                | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (GBP) | Falligkeit |
|--|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                    |                   |                      |   |             |
| 4.497.000,00                                     | CAD                | 399.267.494,00    | JPY                  | 50.578,90   | 01.02.2022  |
| 1.749.000,00                                     | EUR                | 2.529.557,71      | CAD                  | (5.332,61)  | 01.02.2022  |
| 87.979.592,63                                    | GBP                | 160.875.436,03    | AUD                  | 1.490.870,51  | 01.02.2022  |
| 1.121.000,00                                     | GBP                | 171.929.452,00    | JPY                  | 13.139,27   | 01.02.2022  |
| 188.390.040,28                                   | GBP                | 2.174.865.994,12  | NOK                  | 5.486.239,78  | 01.02.2022  |
| 36.824.547,62                                    | NOK                | 5.167.000,00      | CAD                  | 82.698,48   | 01.02.2022  |
| 58.894.022,02                                    | NOK                | 5.766.000,00      | EUR                  | 105.721,14  | 01.02.2022  |
| 70.563.099,87                                    | SEK                | 7.785.000,00      | USD                  | 9.636,23  | 01.02.2022  |
| 1.188.000,00                                     | USD                | 1.521.007,33      | CAD                  | (6.116,56)  | 01.02.2022  |
| 2.200.000,00                                     | EUR                | 2.493.468,12      | USD                  | 74,46   | 04.02.2022  |
| 456.899.965,00                                   | JPY                | 5.514.000,00      | AUD                  | (20.036,88)   | 16.02.2022  |
| 743.000,00                                       | AUD                | 400.205,46        | GBP                  | (707,94)  | 18.02.2022  |
| 1.232.000,00                                     | CAD                | 724.632,29        | GBP                  | (5.903,75)  | 18.02.2022  |
| 787.150,26                                       | GBP                | 1.332.000,00      | CAD                  | 10.082,50   | 18.02.2022  |
| 382.877,53                                       | GBP                | 4.014.000,00      | HKD                  | 1.068,06  | 18.02.2022  |
| 540.200,03                                       | GBP                | 83.010.000,00     | JPY                  | 5.190,41  | 18.02.2022  |
| 26.443.604,24                                    | GBP                | 35.241.000,00     | USD                  | 302.054,43  | 18.02.2022  |
| 340.094.000,00                                   | JPY                | 2.213.212,74      | GBP                  | (21.265,21)   | 18.02.2022  |
| 76.274.000,00                                    | USD                | 56.909.297,83     | GBP                  | (329.805,22)  | 18.02.2022  |
| 26.356.257,24                                    | GBP                | 34.964.000,00     | USD                  | 419.050,08  | 24.02.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>7.587.236,08</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 14.012.000,00                                    | AUD                | 1.115.690.087,00  | JPY                  | 343.824,22  | 01.02.2022  |
| 3.935.206,25                                     | CAD                | 2.719.000,00      | EUR                  | 9.893,64  | 01.02.2022  |
| 64.743.924,33                                    | CHF                | 71.235.000,00     | USD                  | (134.852,27)  | 01.02.2022  |
| 790.000,00                                       | EUR                | 674.936,90        | GBP                  | (10.824,39)   | 01.02.2022  |
| 3.243.000,00                                     | EUR                | 32.147.828,19     | NOK                  | 22.629,01   | 01.02.2022  |
| 2.552.311,35                                     | GBP                | 2.994.000,00      | EUR                  | 35.409,64   | 01.02.2022  |
| 8.758.000,00                                     | GBP                | 105.411.676,81    | NOK                  | (106.962,40)  | 01.02.2022  |
| 4.486.000,00                                     | GBP                | 8.811.451,89      | NZD                  | 25.402,50   | 01.02.2022  |
| 161.249.289,38                                   | GBP                | 1.894.984.087,12  | SEK                  | 5.919.626,35  | 01.02.2022  |
| 118.545.000,00                                   | JPY                | 9.559.960,05      | NOK                  | (40.108,09)   | 01.02.2022  |
| 25.855.650,30                                    | NOK                | 2.862.000,00      | USD                  | 51.606,82   | 01.02.2022  |
| 41.151.137,45                                    | SEK                | 4.184.000,00      | CHF                  | (32.689,62)   | 01.02.2022  |
| 1.000.815.907,11                                 | SEK                | 85.155.611,38     | GBP                  | (3.119.884,92)  | 01.02.2022  |
| 23.968.401,41                                    | SEK                | 3.840.000,00      | NZD                  | 20.739,94   | 01.02.2022  |
| 2.718.874,18                                     | USD                | 2.412.000,00      | EUR                  | (11.112,44)   | 04.02.2022  |
| 3.799.000,00                                     | GBP                | 5.081.373,34      | USD                  | 29.725,83   | 16.02.2022  |
| 248.496.467,00                                   | JPY                | 3.112.000,00      | AUD                  | (71.680,79)   | 16.02.2022  |
| 350.177.270,00                                   | JPY                | 2.722.000,00      | EUR                  | (32.246,52)   | 16.02.2022  |
| 3.365.627,29                                     | USD                | 2.525.000,00      | GBP                  | (28.434,45)   | 16.02.2022  |
| 4.677.572,76                                     | USD                | 6.914.000,00      | NZD                  | (29.732,31)   | 16.02.2022  |
| 2.025.000,00                                     | AUD                | 1.092.002,02      | GBP                  | (3.196,24)  | 18.02.2022  |
| 4.930.000,00                                     | CAD                | 2.914.554,93      | GBP                  | (38.470,52)   | 18.02.2022  |
| 951.000,00                                       | CHF                | 771.460,00        | GBP                  | 3.065,49  | 18.02.2022  |
| 16.530.609,98                                    | EUR                | 14.028.023,00     | GBP                  | (125.496,50)  | 18.02.2022  |
| 1.252.961,90                                     | GBP                | 2.316.000,00      | AUD                  | 7.689,75  | 18.02.2022  |
| 2.850.868,59                                     | GBP                | 4.869.000,00      | CAD                  | 10.377,08   | 18.02.2022  |
| 1.279.595,93                                     | GBP                | 1.571.000,00      | CHF                  | 120,96  | 18.02.2022  |
| 9.806.334,00                                     | GBP                | 11.517.762,19     | EUR                  | 119.690,95  | 18.02.2022  |
| 5.932.708,17                                     | GBP                | 894.689.000,00    | JPY                  | 166.302,03  | 18.02.2022  |
| 15.667.088,53                                    | GBP                | 20.849.000,00     | USD                  | 201.427,52  | 18.02.2022  |
| 7.091.000,00                                     | HKD                | 683.193,01        | GBP                  | (8.699,40)  | 18.02.2022  |
| 1.588.215.000,00                                 | JPY                | 10.513.297,41     | GBP                  | (277.015,41)  | 18.02.2022  |
| 55.715.000,00                                    | USD                | 42.189.484,17     | GBP                  | (860.361,70)  | 18.02.2022  |
| 30.000.000,00                                    | USD                | 22.512.778,82     | GBP                  | (258.025,40)  | 24.02.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>1.777.738,36</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: HSBC Continental Europe SA</b>   |                    |                   |                      |   |             |
| 603.355,99                                       | GBP                | 6.221.000,00      | HKD                  | 11.615,57   | 18.02.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>11.615,57</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| 889.000,00                                       | CAD                | 6.217.792,50      | NOK                  | (4.306,31)  | 01.02.2022  |
| 3.520.066,61                                     | CAD                | 2.719.000,00      | USD                  | 36.692,44   | 01.02.2022  |
| 4.466.000,00                                     | EUR                | 6.477.168,87      | CAD                  | (24.142,99)   | 01.02.2022  |
| 2.432.000,00                                     | EUR                | 24.149.136,19     | NOK                  | 13.543,95   | 01.02.2022  |
| 7.388.000,00                                     | EUR                | 75.627.631,94     | SEK                  | 11.616,89   | 01.02.2022  |
| 3.281.000,00                                     | GBP                | 5.598.319,12      | CAD                  | 15.201,85   | 01.02.2022  |
| 1.657.000,00                                     | GBP                | 19.911.494,10     | NOK                  | (17.526,80)   | 01.02.2022  |
| 3.478.000,00                                     | GBP                | 4.629.663,67      | USD                  | 44.066,78   | 01.02.2022  |
| 507.952.000,00                                   | JPY                | 40.405.761,10     | NOK                  | (124.971,14)  | 01.02.2022  |
| 13.633.000,00                                    | NOK                | 13.705.297,16     | SEK                  | 23.111,00   | 01.02.2022  |
| 3.911.000,00                                     | NZD                | 2.448.527,70      | CHF                  | (13.254,67)   | 01.02.2022  |
| 1.919.360,32                                     | USD                | 2.722.000,00      | AUD                  | (39.741,43)   | 01.02.2022  |
| 2.710.000,00                                     | USD                | 3.455.419,38      | CAD                  | (5.659,27)  | 01.02.2022  |
| 71.842.000,00                                    | USD                | 66.153.428,31     | CHF                  | (562.184,64)  | 01.02.2022  |
| 1.850.000,00                                     | EUR                | 2.089.005,39      | USD                  | 5.828,55  | 04.02.2022  |
| 4.529.994,42                                     | USD                | 3.995.000,00      | EUR                  | 1.409,60  | 04.02.2022  |
| 3.646.000,00                                     | EUR                | 4.118.096,11      | USD                  | 11.445,74   | 16.02.2022  |
| 4.130.000,00                                     | GBP                | 7.730.586,86      | AUD                  | (26.518,47)   | 16.02.2022  |
| 147.053.290,00                                   | JPY                | 1.769.000,00      | AUD                  | (3.394,84)  | 16.02.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                       | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (GBP) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| 923.443.496,00                          | JPY                | 7.199.000,00      | EUR                  | (102.595,14)  | 16.02.2022  |
| 3.490.478,89                            | USD                | 4.904.000,00      | AUD                  | (47.563,83)   | 16.02.2022  |
| 674.000,00                              | AUD                | 363.313,47        | GBP                  | (915,93)  | 18.02.2022  |
| 2.738.000,00                            | CAD                | 1.611.842,42      | GBP                  | (14.537,91)   | 18.02.2022  |
| 88.000,00                               | CHF                | 72.241,14         | GBP                  | (570,87)  | 18.02.2022  |
| 50.038,43                               | EUR                | 42.550,00         | GBP                  | (466,80)  | 18.02.2022  |
| 481.922,32                              | GBP                | 892.000,00        | AUD                  | 2.309,88  | 18.02.2022  |
| 2.018.213,63                            | GBP                | 3.454.000,00      | CAD                  | 3.209,95  | 18.02.2022  |
| 261.724.349,11                          | GBP                | 2.300.164.000,00  | DKK                  | 1.575.528,20  | 18.02.2022  |
| 3.495.893,00                            | GBP                | 4.111.139,40      | EUR                  | 38.352,59   | 18.02.2022  |
| 11.104.019,91                           | GBP                | 116.304.563,00    | HKD                  | 41.191,56   | 18.02.2022  |
| 816.922,63                              | GBP                | 123.223.000,00    | JPY                  | 22.731,77   | 18.02.2022  |
| 66.818.173,53                           | GBP                | 88.570.000,00     | USD                  | 1.117.426,62  | 18.02.2022  |
| 14.717.000,00                           | HKD                | 1.418.420,92      | GBP                  | (18.544,57)   | 18.02.2022  |
| 19.925.000,00                           | USD                | 14.907.120,88     | GBP                  | (126.892,79)  | 18.02.2022  |
| 25.835.702,02                           | GBP                | 34.903.000,00     | USD                  | (56.117,95)   | 24.02.2022  |
| 20.000.000,00                           | USD                | 14.992.672,33     | GBP                  | (156.174,59)  | 24.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>1.617.586,43</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 134.003.582,51                          | CHF                | 106.948.926,48    | GBP                  | 2.130.205,73  | 01.02.2022  |
| 4.754.000,00                            | GBP                | 57.191.527,54     | SEK                  | 66.089,00   | 01.02.2022  |
| 25.609.934,09                           | GBP                | 35.322.406,84     | USD                  | (589.443,21)  | 01.02.2022  |
| 217.227.259,92                          | USD                | 157.497.076,43    | GBP                  | 3.624.983,22  | 01.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>5.231.834,74</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 2.867.542,56                            | GBP                | 3.399.000,00      | EUR                  | 11.381,38   | 13.01.2022  |
| 226.618.106,00                          | EUR                | 192.115.272,74    | GBP                  | (1.609.214,68)  | 01.02.2022  |
| 2.019.000,00                            | EUR                | 20.027.975,25     | SEK                  | 55.597,43   | 01.02.2022  |
| 2.389.000,00                            | EUR                | 2.697.535,29      | USD                  | 8.093,21  | 16.02.2022  |
| 229.000,00                              | CHF                | 185.259,90        | GBP                  | 1.245,08  | 18.02.2022  |
| 22.590.000,00                           | DKK                | 2.559.876,61      | GBP                  | (4.947,39)  | 18.02.2022  |
| 548.866,70                              | GBP                | 668.000,00        | CHF                  | 4.824,02  | 18.02.2022  |
| 7.398.253,63                            | GBP                | 64.997.000,00     | DKK                  | 47.084,62   | 18.02.2022  |
| 6.454.805,77                            | GBP                | 975.710.000,00    | JPY                  | 166.210,58  | 18.02.2022  |
| 5.704.430,24                            | GBP                | 7.626.000,00      | USD                  | 47.516,08   | 18.02.2022  |
| 360.267.000,00                          | JPY                | 2.393.497,73      | GBP                  | (71.521,28)   | 18.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.343.730,95)</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>34.330.146,98</b>  |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

## Credit Default Swaps

| Basiswert                                     | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal         | Wahrung | Kosten (GBP)        | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) (GBP) | Marktwert (GBP)     | Falligkeit |
|---|--------------|-----------------|-----------------|----------|---------------------|--|---------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b> |              |                 |                 |          |                     |  |                     |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (4.089.000,00)  | USD      | 290.427,22          | (10.174,38)  | 280.252,84          | 2012.2026   |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (5.367.000,00)  | USD      | 380.165,76          | (12.321,05)  | 367.844,71          | 2012.2026   |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (6.268.000,00)  | USD      | 443.626,62          | (14.028,96)  | 429.597,66          | 2012.2026   |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (5.022.000,00)  | USD      | 346.357,46          | (2.158,44)   | 344.199,02          | 2012.2026   |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (4.935.000,00)  | USD      | 343.741,90          | (5.505,71)   | 338.236,19          | 2012.2026   |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (1.320.000,00)  | USD      | 96.233,65           | (5.763,18)   | 90.470,47           | 2012.2026   |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (976.000,00)    | USD      | 67.221,53           | (328,21)   | 66.893,32           | 2012.2026   |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (1.018.000,00)  | USD      | 68.137,88           | 1.634,05   | 69.771,93           | 2012.2026   |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (1.192.000,00)  | USD      | 67.524,01           | 14.173,56  | 81.697,57           | 2012.2026   |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (1.258.000,00)  | USD      | 74.588,71           | 11.632,39  | 86.221,10           | 2012.2026   |
|   |              |                 |                 |          | <b>2.178.024,74</b> | <b>(22.839,93)</b>                                   | <b>2.155.184,81</b> |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>            |              |                 |                 |          |                     |  |                     |             |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (5.769.000,00)  | USD      | 396.597,56          | (1.200,48)   | 395.397,08          | 2012.2026   |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (1.225.000,00)  | USD      | 84.669,65           | (710,31)   | 83.959,34           | 2012.2026   |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (1.257.000,00)  | USD      | 75.050,41           | 11.102,15  | 86.152,56           | 2012.2026   |
|   |              |                 |                 |          | <b>556.317,62</b>   | <b>9.191,36</b>                                      | <b>565.508,98</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: ICE Clear Europe Limited</b>  |              |                 |                 |          |                     |  |                     |             |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (90.759.000,00) | EUR      | 9.096.449,81        | (8.054,35)   | 9.088.395,46        | 2012.2026   |
|   |              |                 |                 |          | <b>9.096.449,81</b> | <b>(8.054,35)</b>                                    | <b>9.088.395,46</b> |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert                        | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal        | Währung | Kosten (GBP)         | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (GBP) | Marktwert (GBP)      | Fälligkeit |
|----------------------------------|--------------|-----------------|----------------|---------|----------------------|---|----------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b> |              |                 |                |         |                      |   |                      |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                 | Verkauf      | 5,00%           | (1.979.000,00) | USD     | 129.303,51           | 6.333,66  | 135.637,17           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                 | Verkauf      | 5,00%           | (1.295.000,00) | USD     | 77.705,83            | 11.051,18   | 88.757,01            | 20.12.2026 |
|                                  |              |                 |                |         | <b>207.009,34</b>    | <b>17.384,84</b>                                    | <b>224.394,18</b>    |            |
|                                  |              |                 |                |         | <b>12.037.801,51</b> | <b>(4.318,08)</b>                                   | <b>12.033.483,43</b> |            |

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (GBP) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (GBP) |
|--|------------|---------|-------------------------------|--------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                               |                          |   |  |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | (1.291,00)                    | (183.644.750,00)         | 90.369,46   | (3.048.061,93)   |
| EURO STOXX 50 3/2022                   | 18.03.2022 | EUR     | (2.130,00)                    | (91.164.000,00)          | 134.199,24  | (1.660.831,17)   |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (2.962,00)                    | (394.745.740,00)         | (74.647,54)   | 2.561.246,85   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (1.272,00)                    | (217.982.640,00)         | 0,00  | 3.303.567,76   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | 484,00                        | 82.943.080,00            | 0,00  | (1.256.747,94)   |
| FTSE 100 IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022 | GBP     | (578,00)                      | (42.404.970,00)          | 69.360,00   | (802.240,79)   |
| MSCI EmgMkt 3/2022                     | 18.03.2022 | USD     | (2.117,00)                    | (130.661.240,00)         | (86.356,89)   | (36.153,23)  |
| NIKKEI 225 MINI 3/2022                 | 11.03.2022 | JPY     | (2.589,00)                    | (7.466.676.000,00)       | (100.066,61)  | (550.272,27)   |
| S&P500 EMINI FUT 3/2022                | 18.03.2022 | USD     | (2.790,00)                    | (664.996.500,00)         | 543.184,01  | (7.617.991,63)   |
| SPI 200 FUTURES 3/2022                 | 17.03.2022 | AUD     | (321,00)                      | (58.975.725,00)          | 370.975,46  | (689.805,23)   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 5.910,00                      | 770.700.937,50           | 0,00  | 4.709.034,63   |
|  |            |         |                               |                          | <b>947.017,13</b>   | <b>(5.088.254,95)</b>  |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 2.030.000,00 GBP gezahlt.  
BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps 630.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                     | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>AUD</b>  |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 2.100.000,00  | Australia Government Bond 0.25% 21-11-2025        | 1.293.971,01               | 2,31                         | 500.000,00         | North Macedonia Government I 3.675% 03-06-2026   | 529.340,00                 | 0,94                         |
| 1.470.000,00  | Australia Government Bond 1% 21-12-2030           | 890.805,19                 | 1,59                         | 100.000,00         | Portugal Obrigaçoes do Tesou 1% 12-04-2052       | 90.664,05                  | 0,16                         |
| 200.000,00  | Australia Government Bond 1.75% 21-06-2051        | 110.943,41                 | 0,20                         | 99.000,00          | Republic of Austria Governme 0.75% 20-03-2051    | 101.785,66                 | 0,18                         |
| 600.000,00  | New South Wales Treasury Cor 2% 08-03-2033        | 380.152,54                 | 0,68                         | 50.000,00          | Republic of Austria Governme 0.85% 30-06-2120    | 43.467,71                  | 0,08                         |
|   |   | <b>2.675.872,15</b>        | <b>4,77</b>                  | 62.000,00          | Romanian Government Internat 1.375% 02-12-2029   | 59.145,52                  | 0,11                         |
| <b>CAD</b>  |   |                            |                              | 600.000,00         | Romanian Government Internat 2% 14-04-2033       | 546.240,00                 | 0,97                         |
| 2.231.000,00  | Canadian Government Bond 2.25% 01-06-2025         | 1.604.836,42               | 2,86                         | 100.000,00         | Romanian Government Internat 2.124% 16-07-2031   | 95.321,60                  | 0,17                         |
|   |   | <b>1.604.836,42</b>        | <b>2,86</b>                  | 800.000,00         | San Marino Government Bond 3.25% 24-02-2024      | 823.024,00                 | 1,47                         |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              | 300.000,00         | Skipton Building Society 0.01% 22-09-2024        | 301.244,40                 | 0,54                         |
| 400.000,00  | Action Logement Services 0.375% 05-10-2031        | 397.208,00                 | 0,71                         | 200.000,00         | Slovenska Sporitelna AS 0.125% 12-06-2026        | 200.817,60                 | 0,36                         |
| 150.000,00  | BNG Bank NV 0.25% 22-11-2036                      | 144.578,81                 | 0,26                         | 500.000,00         | Societe Du Grand Paris EPIC 0.000000% 25-11-2030 | 486.509,00                 | 0,87                         |
| 612.413,85  | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-05-2035 | 614.186,18                 | 1,09                         | 587.000,00         | Spain Government Bond 0.5% 31-10-2031            | 583.350,62                 | 1,04                         |
| 362.000,00  | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2031 | 369.464,44                 | 0,66                         | 518.000,00         | Spain Government Bond 1.45% 31-10-2071           | 449.946,20                 | 0,80                         |
| 472.000,00  | Finland Government Bond 0.000000% 15-09-2030      | 471.953,74                 | 0,84                         | 200.000,00         | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.375% 26-06-2024     | 203.018,00                 | 0,36                         |
| 204.000,00  | Finland Government Bond 0.125% 15-04-2052         | 182.985,55                 | 0,33                         | 211.000,00         | State of Bremen 1% 27-05-2039                    | 225.633,69                 | 0,40                         |
| 762.000,00  | Finland Government Bond 0.5% 15-09-2029           | 797.890,20                 | 1,42                         | 206.000,00         | State of North Rhine-Westph 0.2% 27-01-2051      | 183.591,32                 | 0,33                         |
| 583.959,00  | French Republic Government B 0.000000% 25-11-2031 | 572.863,31                 | 1,02                         | 522.000,00         | State of North Rhine-Westph 0.95% 10-01-2121     | 414.702,90                 | 0,74                         |
| 200.000,00  | French Republic Government B 0.5% 25-05-2040      | 195.380,00                 | 0,35                         |                    |  | <b>18.926.632,22</b>       | <b>33,72</b>                 |
| 499.574,00  | French Republic Government B 0.5% 25-05-2072      | 386.519,40                 | 0,69                         | <b>GBP</b>         |  |                            |                              |
| 200.000,00  | French Republic Government B 0.75% 25-05-2052     | 191.235,00                 | 0,34                         | 290.000,00         | Kuntarahoitus Oyj 0.875% 16-12-2024              | 343.227,53                 | 0,61                         |
| 125.000,00  | Iceland Government Internati 0.625% 03-06-2026    | 126.495,59                 | 0,23                         | 300.000,00         | UK Municipal Bonds Agency Fi 1.625% 26-08-2060   | 346.630,41                 | 0,62                         |
| 364.000,00  | Ireland Government Bond 0.000000% 18-10-2031      | 354.939,31                 | 0,63                         | 250.000,00         | United Kingdom Gilt 0.625% 31-07-2035            | 278.063,95                 | 0,50                         |
| 139.800,00  | Ireland Government Bond 1.5% 15-05-2050           | 160.839,90                 | 0,29                         | 350.000,00         | United Kingdom Gilt 0.875% 31-07-2033            | 409.211,98                 | 0,73                         |
| 200.000,00  | Italy Buoni Poliennali Del T 0.000000% 01-08-2026 | 196.142,00                 | 0,35                         | 657.012,55         | United Kingdom Gilt 3.75% 22-07-2052             | 1.310.029,96               | 2,33                         |
| 169.000,00  | Italy Buoni Poliennali Del T 0.4% 15-05-2030      | 193.240,68                 | 0,34                         |                    |  | <b>2.687.163,83</b>        | <b>4,79</b>                  |
| 1.178.000,00  | Italy Buoni Poliennali Del T 0.6% 01-08-2031      | 1.121.366,77               | 2,00                         | <b>JPY</b>         |  |                            |                              |
| 484.000,00  | Italy Buoni Poliennali Del T 0.95% 15-09-2027     | 494.037,19                 | 0,88                         | 60.650.000,00      | Japan Government Forty Year 1.4% 20-03-2055      | 559.905,13                 | 1,00                         |
| 775.000,00  | Italy Buoni Poliennali Del T 1.3% 15-05-2028      | 963.809,37                 | 1,72                         | 39.800.000,00      | Japan Government Forty Year 2.2% 20-03-2050      | 425.374,07                 | 0,76                         |
| 55.000,00   | Italy Buoni Poliennali Del T 1.5% 30-04-2045      | 51.604,99                  | 0,09                         | 113.050.000,00     | Japan Government Ten Year Bo 0.1% 20-09-2028     | 875.834,50                 | 1,56                         |
| 8.000,00  | Italy Buoni Poliennali Del T 2.15% 01-03-2072     | 7.648,97                   | 0,01                         | 260.550.000,00     | Japan Government Thirty Year 1.7% 20-09-2044     | 2.491.082,92               | 4,44                         |
| 300.000,00  | Italy Buoni Poliennali Del T 2.25% 01-09-2036     | 330.296,40                 | 0,59                         | 240.850.000,00     | Japan Government Thirty Year 2.3% 20-03-2035     | 2.342.109,83               | 4,17                         |
| 392.000,00  | Italy Buoni Poliennali Del T 2.45% 01-09-2050     | 431.154,53                 | 0,77                         |                    |  | <b>6.694.306,45</b>        | <b>11,93</b>                 |
| 834.000,00  | Italy Buoni Poliennali Del T 2.45% 01-10-2023     | 872.916,11                 | 1,56                         | <b>NZD</b>         |  |                            |                              |
| 238.000,00  | Italy Buoni Poliennali Del T 2.8% 01-03-2067      | 268.821,00                 | 0,48                         | 900.000,00         | Auckland Council 2.95% 28-09-2050                | 474.559,05                 | 0,85                         |
| 250.000,00  | Kingdom of Belgium Governmen 0.4% 22-06-2040      | 237.716,70                 | 0,42                         |                    |  | <b>474.559,05</b>          | <b>0,85</b>                  |
| 200.000,00  | Land Thueringen 0.25% 05-03-2040                  | 188.650,62                 | 0,34                         | <b>SEK</b>         |  |                            |                              |
| 453.000,00  | Lithuania Government Interna 0.25% 06-05-2025     | 456.793,42                 | 0,81                         | 11.000.000,00      | Oresundsbro Konsortiet 0.25% 15-10-2025          | 1.053.455,58               | 1,88                         |
| 100.000,00  | Mexico Government Internatio 1.35% 18-09-2027     | 101.878,00                 | 0,18                         |                    |  | <b>1.053.455,58</b>        | <b>1,88</b>                  |
| 171.260,00  | Netherlands Government Bond 0.000000% 15-07-2031  | 171.910,00                 | 0,31                         | <b>USD</b>         |  |                            |                              |
| 1.013.109,00  | Netherlands Government Bond 0.5% 15-01-2040       | 1.078.658,17               | 1,92                         | 400.000,00         | Chile Government Internation 3.1% 07-05-2041     | 345.208,14                 | 0,62                         |
| 600.000,00  | NIBC Bank NV 0.5% 19-03-2027                      | 612.435,60                 | 1,09                         | 600.000,00         | Finnvera Oyj 1.125% 27-10-2026                   | 523.396,65                 | 0,93                         |
| 900.000,00  | North Macedonia Government I 1.625% 10-03-2028    | 843.210,00                 | 1,50                         | 1.000.000,00       | International Bank for Recon 1.625% 03-11-2031   | 883.820,06                 | 1,57                         |
|   |   |                            |                              | 2.000.000,00       | Republic of Italy Government 1.25% 17-02-2026    | 1.719.386,89               | 3,06                         |
|   |   |                            |                              | 3.450.000,00       | United States Treasury Note/ 1.5% 15-08-2026     | 3.081.886,94               | 5,49                         |
|   |   |                            |                              | 1.455.000,00       | United States Treasury Note/ 2% 15-08-2051       | 1.309.286,44               | 2,33                         |
|   |   |                            |                              | 2.024.900,00       | United States Treasury Note/ 2.25% 15-08-2027    | 1.875.885,09               | 3,34                         |
|   |   |                            |                              | 800.000,00         | United States Treasury Note/ 2.25% 30-04-2024    | 729.566,72                 | 1,30                         |
|   |   |                            |                              | 1.453.100,00       | United States Treasury Note/ 2.375% 15-08-2024   | 1.332.383,19               | 2,37                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 2.463.300,00       | United States Treasury Note/<br>3.75% 15-11-2043  | 2.873.894,17               | 5,12                         |
| 1.619.900,00       | United States Treasury Note/ 4.5%<br>15-08-2039   | 2.019.411,25               | 3,60                         |
|                    |   | <b>16.694.125,54</b>       | <b>29,74</b>                 |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>50.810.951,24</b>       | <b>90,53</b>                 |
|                    | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>50.810.951,24</b>       | <b>90,53</b>                 |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>CAD</b>  |                            |                              |
| 170.000,00         | City of Vancouver 2.3% 05-11-2031   | 119.837,13                 | 0,21                         |
|                    |   | <b>119.837,13</b>          | <b>0,21</b>                  |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 201.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 0.95%<br>01-08-2030  | 200.306,95                 | 0,36                         |
| 200.000,00         | Italy Buoni Poliennali Del T 1.45%<br>01-03-2036  | 200.160,00                 | 0,36                         |
| 300.000,00         | Mexico Government Internatio<br>1.45% 25-10-2033  | 278.352,00                 | 0,50                         |
|                    |   | <b>678.818,95</b>          | <b>1,21</b>                  |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 2.000.000,00       | CDP Financial Inc 5.6% 25-11-2039   | 2.500.907,04               | 4,46                         |
| 300.000,00         | Mexico Government Internatio<br>3.75% 19-04-2071  | 237.054,69                 | 0,42                         |
|                    |   | <b>2.737.961,73</b>        | <b>4,88</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>3.536.617,81</b>        | <b>6,30</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>3.536.617,81</b>        | <b>6,30</b>                  |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>AUD</b>  |                            |                              |
| 500.000,00         | BNG Bank NV 3.25% 24-08-2026  | 340.603,39                 | 0,61                         |
|                    |   | <b>340.603,39</b>          | <b>0,61</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>340.603,39</b>          | <b>0,61</b>                  |
|                    | <b>Summe sonstige übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>340.603,39</b>          | <b>0,61</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>54.688.172,44</b>       | <b>97,43</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>1.196.089,72</b>        | <b>2,13</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>243.696,97</b>          | <b>0,43</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>56.127.959,13</b>       | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land   |              | Sektor               |              |
|--|--------------|----------------------|--------------|
| USA  | 23,56        | Staatsanleihen       | 88,19        |
| Italien                                      | 12,56        | Unternehmensanleihen | 9,24         |
| Japan  | 11,93        |                      |              |
| Kanada                                       | 7,53         | <b>Summe</b>         | <b>97,43</b> |
| Australien                                   | 4,77         |                      |              |
| Niederlande                                  | 4,18         |                      |              |
| Finnland                                     | 4,13         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich                       | 4,10         |                      |              |
| Frankreich                                   | 3,97         |                      |              |
| Deutschland                                  | 3,56         |                      |              |
| Länderübergreifend                           | 3,45         |                      |              |
| Mazedonien, ehemalige jugoslawische Republik | 2,45         |                      |              |
| Spanien                                      | 1,84         |                      |              |
| Irland                                       | 1,54         |                      |              |
| San Marino                                   | 1,47         |                      |              |
| Rumänien                                     | 1,25         |                      |              |
| Mexiko                                       | 1,10         |                      |              |
| Neuseeland                                   | 0,85         |                      |              |
| Litauen                                      | 0,81         |                      |              |
| Chile  | 0,62         |                      |              |
| Belgien                                      | 0,42         |                      |              |
| Norwegen                                     | 0,36         |                      |              |
| Slowakei                                     | 0,36         |                      |              |
| Österreich                                   | 0,26         |                      |              |
| Island                                       | 0,23         |                      |              |
| Portugal                                     | 0,16         |                      |              |
| <b>Summe</b>                                 | <b>97,43</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Global Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|--|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |                    |                   |                      |   |             |
| 199.516,76                                       | EUR                | 25.650.000,00     | JPY                  | 2.950,79  | 18.02.2022  |
| 1.152.411,00                                     | GBP                | 1.363.210,67      | EUR                  | 7.059,72  | 18.02.2022  |
| 6.159.103,00                                     | USD                | 5.408.679,37      | EUR                  | 23.797,22   | 18.02.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>33.807,73</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>    |                    |                   |                      |   |             |
| 1.470.000,00                                     | DKK                | 197.669,12        | EUR                  | 17,08   | 18.02.2022  |
| 578.881,34                                       | EUR                | 826.000,00        | CAD                  | 5.919,67  | 18.02.2022  |
| 163.621,81                                       | EUR                | 21.000.000,00     | JPY                  | 2.690,85  | 18.02.2022  |
| 941.692,01                                       | EUR                | 9.439.000,00      | SEK                  | 21.546,88   | 18.02.2022  |
| 216.669,63                                       | EUR                | 245.500,00        | USD                  | 133,72  | 18.02.2022  |
| 1.400.000,00                                     | USD                | 1.234.815,95      | EUR                  | 12,76   | 18.02.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>30.320,96</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                    |                   |                      |   |             |
| 2.063.910,10                                     | EUR                | 3.201.300,00      | AUD                  | 17.253,75   | 18.02.2022  |
| 88.440,54  | EUR                | 75.000,00         | GBP                  | (738,21)  | 18.02.2022  |
| 504.221,45                                       | EUR                | 818.600,00        | NZD                  | 11.589,47   | 18.02.2022  |
| 100.982,29                                       | EUR                | 114.000,00        | USD                  | 432,34  | 18.02.2022  |
| 514.572.520,00                                   | JPY                | 3.961.709,03      | EUR                  | (18.301,89)   | 18.02.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>10.235,46</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 258.673,95                                       | EUR                | 292.000,00        | USD                  | 1.124,98  | 18.02.2022  |
| 19.000,00  | NZD                | 11.375,95         | EUR                  | 58,51   | 18.02.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>1.183,49</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| 310.000,00                                       | USD                | 272.924,73        | EUR                  | 502,09  | 18.02.2022  |
|  |                    |                   |                      | <b>502,09</b>   |             |
|  |                    |                   |                      | <b>76.049,73</b>  |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Falligkeit | Wahrung | Erworbene/ Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) |
|--|-------------|----------|--------------------------------|---------------------------|--|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |             |          |                                |                           |  |  |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022  | AUD      | (26,00)                        | (2.555.150,00)            | 8.349,77   | (6.594,53)   |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022  | CAD      | 4,00                           | 569.000,00                | (333,31)   | 11.085,67  |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | 3,00                           | 399.720,00                | 0,00   | (3.134,39)   |
| Euro-BTP Future 3/2022                 | 10.03.2022  | EUR      | (37,00)                        | (5.441.035,00)            | (1.665,00)   | 79.003,30  |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022  | EUR      | (4,00)                         | (685.480,00)              | 0,00   | 10.971,55  |
| EURO-BUXL 30Y BND 3/2022               | 10.03.2022  | EUR      | (13,00)                        | (2.687.620,00)            | 0,00   | 130.681,02   |
| Euro-OAT Future 3/2022                 | 10.03.2022  | EUR      | (24,00)                        | (3.917.040,00)            | (1.440,00)   | 63.588,90  |
| EURO-SCHATZ FUT 3/2022                 | 10.03.2022  | EUR      | 18,00                          | 2.016.765,00              | 225,00   | (433,76)   |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022  | GBP      | 2,00                           | 249.860,00                | 357,12   | (4.501,62)   |
| Short Euro-BTP Fu 3/2022               | 10.03.2022  | EUR      | (23,00)                        | (2.597.275,00)            | (345,00)   | 488,43   |
| SW 5YR STDS FUT 3/2022                 | 16.03.2022  | SEK      | 10,00                          | 10.086.846,67             | (1.053,18)   | (3.816,57)   |
| SWEDISH 5YR FUT 3/2022                 | 16.03.2022  | SEK      | (11,00)                        | (11.496.334,55)           | 769,65   | 8.176,12   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022  | USD      | (20,00)                        | (2.609.687,60)            | (1.379,60)   | (24.053,15)  |
| US 2YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022  | USD      | 15,00                          | 3.273.281,34              | 620,84   | (4.211,65)   |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022  | USD      | (5,00)                         | (605.117,17)              | (206,90)   | (1.871,40)   |
| US LONG BOND(CBT) 3/2022               | 31.03.2022  | USD      | (16,00)                        | (2.563.000,00)            | (4.414,43)   | (24.681,83)  |
| US ULTRA BOND CBT 3/2022               | 31.03.2022  | USD      | 11,00                          | 2.174.562,50              | 5.462,85   | 16.222,49  |
|  |             |          |                                |                           | <b>4.947,81</b>  | <b>246.918,58</b>  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Zinsswaps

| Beschreibung                                 | Nominal      | Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) in der<br>Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|--|--------------|---------|--|------------|
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b> |              |         |  |            |
| Paying fixed rate 0.0920%                    | (300.000,00) | EUR     | 29.910,64  | 17.08.2071 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months     |              |         |  |            |
|  |              |         | <b>29.910,64</b>   |            |



# Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor                                    |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| USA                    | 55,30        | Anwendungssoftware                        | 11,31        |
| Japan                  | 6,41         | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen | 10,80        |
| Irland                 | 6,38         | Spezialchemikalien                        | 9,35         |
| Deutschland            | 6,13         | Industriemaschinen                        | 8,32         |
| Niederlande            | 4,33         | Hersteller von Elektronikausrüstung       | 7,97         |
| Frankreich             | 4,07         | Industriegase                             | 6,90         |
| Kanada                 | 3,43         | Papierverpackungen                        | 5,82         |
| Vereinigtes Königreich | 2,36         | Halbleiter-Ausrüstung                     | 4,97         |
| Australien             | 2,35         | Bauprodukte                               | 4,78         |
| Schweiz                | 1,57         | Halbleiter                                | 4,12         |
| Jersey                 | 1,44         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch       | 3,86         |
| Brasilien              | 1,20         | Autoteile und -zubehör                    | 3,43         |
| Finnland               | 1,05         | Stromversorger                            | 3,20         |
| Dänemark               | 0,83         | Mehrsparten-Versorger                     | 2,36         |
| Norwegen               | 0,72         | Industriekonglomerate                     | 1,84         |
| China                  | 0,62         | Bau- und Ingenieurwesen                   | 1,50         |
|                        |              | Freizeitartikel                           | 1,46         |
|                        |              | Landwirtschafts- und Landmaschinen        | 1,41         |
|                        |              | Wasserversorger                           | 1,20         |
|                        |              | Schienerverkehr                           | 1,18         |
|                        |              | Papierprodukte                            | 1,05         |
|                        |              | Elektrische Anlagen                       | 0,83         |
|                        |              | Sach- und Unfallversicherung              | 0,52         |
| <b>Summe</b>           | <b>98,18</b> | <b>Summe</b>                              | <b>98,18</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 102.028.206,32                                    | CHF               | 97.335.383,04      | EUR                | 1.457.368,95   | 28.01.2022 |
| 12.252.194,11                                     | EUR               | 12.778.639,51      | CHF                | (121.185,75)   | 28.01.2022 |
| 381.696,35  | EUR               | 324.107,95         | GBP                | (3.887,05)   | 28.01.2022 |
| 552,03  | EUR               | 5.629,85           | NOK                | (11,26)  | 28.01.2022 |
| 19.994.985,93                                     | EUR               | 22.571.619,05      | USD                | 77.920,29  | 28.01.2022 |
| 3.809.298,75                                      | GBP               | 4.515.525,36       | EUR                | 16.289,98  | 28.01.2022 |
| 65.489,51   | NOK               | 6.492,20           | EUR                | 60,39  | 28.01.2022 |
| 194.107.523,92                                    | USD               | 172.245.887,67     | EUR                | (966.687,78)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>459.867,77</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------------------|----------------------------|------------------------------|---|--------------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| <b>CAD</b>  |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| 95.100,00   | Fortis Inc/Canada                  | 4.566.325,86               | 2,14                         |   |                    |                            |                              |
| 72.700,00   | LifeWorks                          | 1.458.059,70               | 0,68                         |   |                    |                            |                              |
|   |                                    | <b>6.024.385,56</b>        | <b>2,82</b>                  |   |                    |                            |                              |
| <b>DKK</b>  |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| 61.720,00   | Vestas Wind Systems                | 1.880.159,57               | 0,88                         |   |                    |                            |                              |
|   |                                    | <b>1.880.159,57</b>        | <b>0,88</b>                  |   |                    |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| 33.827,00   | Air Liquide                        | 5.874.325,72               | 2,75                         |   |                    |                            |                              |
| 7.154,00  | ASML Holding                       | 5.726.374,62               | 2,68                         |   |                    |                            |                              |
| 78.082,00   | Infineon Technologies              | 3.604.797,17               | 1,69                         |   |                    |                            |                              |
| 22.244,00   | Kerry Group                        | 2.853.295,99               | 1,34                         |   |                    |                            |                              |
| 14.579,00   | Koninklijke DSM                    | 3.269.555,06               | 1,53                         |   |                    |                            |                              |
| 71.149,00   | Koninklijke Philips                | 2.640.430,27               | 1,24                         |   |                    |                            |                              |
| 20.131,00   | LEG Immobilien                     | 2.797.728,98               | 1,31                         |   |                    |                            |                              |
| 19.396,00   | Linde                              | 6.722.477,10               | 3,15                         |   |                    |                            |                              |
| 35.550,00   | Orpea                              | 3.547.408,83               | 1,66                         |   |                    |                            |                              |
| 70.771,00   | Valeo                              | 2.130.620,19               | 1,00                         |   |                    |                            |                              |
| 34.469,00   | Vinci                              | 3.627.328,38               | 1,70                         |   |                    |                            |                              |
| 35.220,00   | Wolters Kluwer                     | 4.132.804,26               | 1,94                         |   |                    |                            |                              |
|   |                                    | <b>46.927.146,57</b>       | <b>21,99</b>                 |   |                    |                            |                              |
| <b>GBP</b>  |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| 241.848,00  | Tate & Lyle                        | 2.156.717,31               | 1,01                         |   |                    |                            |                              |
|   |                                    | <b>2.156.717,31</b>        | <b>1,01</b>                  |   |                    |                            |                              |
| <b>HKD</b>  |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| 167.000,00  | Ping An Healthcare and Technology  | 607.043,04                 | 0,28                         |   |                    |                            |                              |
|   |                                    | <b>607.043,04</b>          | <b>0,28</b>                  |   |                    |                            |                              |
| <b>IDR</b>  |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| 15.140.920,00   | Bank Rakyat Indonesia Persero      | 4.366.194,09               | 2,05                         |   |                    |                            |                              |
|   |                                    | <b>4.366.194,09</b>        | <b>2,05</b>                  |   |                    |                            |                              |
| <b>JPY</b>  |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| 23.400,00   | Central Japan Railway              | 3.118.714,18               | 1,46                         |   |                    |                            |                              |
| 36.000,00   | Daifuku                            | 2.939.159,66               | 1,38                         |   |                    |                            |                              |
| 6.300,00  | Keyence                            | 3.955.045,81               | 1,85                         |   |                    |                            |                              |
| 11.900,00   | Shimano                            | 3.168.924,82               | 1,48                         |   |                    |                            |                              |
|   |                                    | <b>13.181.844,47</b>       | <b>6,18</b>                  |   |                    |                            |                              |
| <b>KES</b>  |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| 4.931.100,00  | Safaricom                          | 1.653.868,71               | 0,77                         |   |                    |                            |                              |
|   |                                    | <b>1.653.868,71</b>        | <b>0,77</b>                  |   |                    |                            |                              |
| <b>NOK</b>  |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| 213.952,00  | Kahoot!                            | 1.131.077,23               | 0,53                         |   |                    |                            |                              |
|   |                                    | <b>1.131.077,23</b>        | <b>0,53</b>                  |   |                    |                            |                              |
| <b>SEK</b>  |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| 258.280,00  | Electrolux Professional B          | 1.790.608,96               | 0,84                         |   |                    |                            |                              |
|   |                                    | <b>1.790.608,96</b>        | <b>0,84</b>                  |   |                    |                            |                              |
| <b>USD</b>  |                                    |                            |                              |   |                    |                            |                              |
| 24.739,00   | AGCO                               | 2.862.549,69               | 1,34                         |   |                    |                            |                              |
| 24.475,00   | Allegion                           | 3.218.707,25               | 1,51                         |   |                    |                            |                              |
| 10.783,00   | ANSYS                              | 4.364.203,59               | 2,04                         |   |                    |                            |                              |
| 19.243,00   | Aptiv                              | 3.155.852,00               | 1,48                         |   |                    |                            |                              |
| 24.084,00   | Aspen Technology                   | 3.678.349,32               | 1,72                         |   |                    |                            |                              |
| 13.879,00   | Autodesk                           | 3.917.347,75               | 1,84                         |   |                    |                            |                              |
| 109.685,00  | Avantor                            | 4.642.966,05               | 2,18                         |   |                    |                            |                              |
| 70.544,00   | Carrier Global                     | 3.769.871,36               | 1,77                         |   |                    |                            |                              |
| 12.664,00   | Chart Industries                   | 2.015.855,52               | 0,94                         |   |                    |                            |                              |
| 35.636,00   | Chegg                              | 1.108.635,96               | 0,52                         |   |                    |                            |                              |
| 39.178,00   | Cognex                             | 3.055.296,33               | 1,43                         |   |                    |                            |                              |
| 14.895,00   | Danaher                            | 4.914.605,25               | 2,30                         |   |                    |                            |                              |
| 6.527,00  | Dexcom                             | 3.556.170,68               | 1,67                         |   |                    |                            |                              |
| 17.077,00   | Ecolab                             | 3.987.821,04               | 1,87                         |   |                    |                            |                              |
| 73.668,00   | HDFC Bank ADR                      | 4.785.473,28               | 2,24                         |   |                    |                            |                              |
| 17.115,00   | IDEX                               | 4.026.817,20               | 1,89                         |   |                    |                            |                              |
| 34.598,00   | International Flavors & Fragrances | 5.158.215,82               | 2,42                         |   |                    |                            |                              |
| 10.484,00   | Intuitive Surgical                 | 3.821.313,16               | 1,79                         |   |                    |                            |                              |
| 30.028,00   | MasTec                             | 2.769.182,16               | 1,30                         |   |                    |                            |                              |
| 16.312,00   | Middleby                           | 3.217.215,76               | 1,51                         |   |                    |                            |                              |
| 15.849,00   | Motorola Solutions                 | 4.291.750,71               | 2,01                         |   |                    |                            |                              |
| 19.914,00   | Neurocrine Biosciences             | 1.695.477,96               | 0,79                         |   |                    |                            |                              |
| 51.975,00   | ON Semiconductor                   | 3.554.570,25               | 1,67                         |   |                    |                            |                              |
| 41.255,00   | Owens Corning                      | 3.714.600,20               | 1,74                         |   |                    |                            |                              |
| 23.769,00   | Packaging Corp of America          | 3.197.168,19               | 1,50                         |   |                    |                            |                              |
|   |                                    |                            |                              | 8.989,00  | Paycom Software    | 3.739.963,34               | 1,75                         |
|   |                                    |                            |                              | 38.630,00   | Progyny            | 1.977.856,00               | 0,93                         |
|   |                                    |                            |                              | 52.266,00   | Republic Services  | 7.222.115,88               | 3,38                         |
|   |                                    |                            |                              | 13.204,00   | Stryker            | 3.566.136,32               | 1,67                         |
|   |                                    |                            |                              | 16.231,00   | Synopsys           | 5.965.054,81               | 2,79                         |
|   |                                    |                            |                              | 23.761,00   | Teradyne           | 3.924.604,37               | 1,84                         |
|   |                                    |                            |                              | 38.278,00   | Trimble            | 3.360.425,62               | 1,57                         |
|   |                                    |                            |                              | 70.472,00   | UMH Properties     | 1.884.421,28               | 0,88                         |
|   |                                    |                            |                              | 40.696,00   | Waste Management   | 6.747.396,80               | 3,16                         |
|   |                                    |                            |                              | 42.862,00   | XP                 | 1.228.853,54               | 0,58                         |
|   |                                    |                            |                              | 5.335,00  | Zebra Technologies | 3.175.125,25               | 1,49                         |
|   |                                    |                            |                              |   |                    | <b>131.271.969,69</b>      | <b>61,50</b>                 |
|   |                                    |                            |                              | <b>Summe Aktien</b>   |                    | <b>210.991.015,20</b>      | <b>98,85</b>                 |
|   |                                    |                            |                              | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                    | <b>210.991.015,20</b>      | <b>98,85</b>                 |
|   |                                    |                            |                              | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  |                    | <b>210.991.015,20</b>      | <b>98,85</b>                 |
|   |                                    |                            |                              | <b>Bankguthaben</b>   |                    | <b>4.069.666,18</b>        | <b>1,91</b>                  |
|   |                                    |                            |                              | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  |                    | <b>(1.619.189,77)</b>      | <b>(0,76)</b>                |
|   |                                    |                            |                              | <b>Summe Nettovermögen</b>  |                    | <b>213.441.491,61</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor   |              |
|------------------------|--------------|--|--------------|
| USA                    | 55,70        | Anwendungssoftware                             | 10,15        |
| Niederlande            | 7,39         | Industriemaschinen                             | 6,55         |
| Frankreich             | 7,11         | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen      | 6,54         |
| Japan                  | 6,18         | Gesundheitswesen: Ausstattung                  | 6,36         |
| Irland                 | 5,99         | Hersteller von Elektronikausrüstung            | 6,35         |
| Deutschland            | 3,00         | Industriegase                                  | 5,90         |
| Kanada                 | 2,82         | Spezialchemikalien                             | 5,82         |
| Indien                 | 2,24         | Bauprodukte                                    | 5,01         |
| Indonesien             | 2,05         | Halbleiter-Ausrüstung                          | 4,52         |
| Jersey                 | 1,48         | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen | 4,48         |
| Vereinigtes Königreich | 1,01         | Verschiedene Banken                            | 4,29         |
| Dänemark               | 0,88         | Halbleiter                                     | 3,35         |
| Kaimaninseln           | 0,86         | Bau- und Ingenieurwesen                        | 3,00         |
| Schweden               | 0,84         | Autoteile und -zubehör                         | 2,48         |
| Kenia                  | 0,77         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch            | 2,35         |
| Norwegen               | 0,53         | Stromversorger                                 | 2,14         |
| <b>Summe</b>           | <b>98,85</b> | Kommunikationsanlagen                          | 2,01         |
|                        |              | Forschungs- und Beratungsleistungen            | 1,94         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Einrichtungen                | 1,66         |
|                        |              | Papierverpackungen                             | 1,50         |
|                        |              | Freizeitartikel                                | 1,48         |
|                        |              | Schienerverkehr                                | 1,46         |
|                        |              | Landwirtschafts- und Landmaschinen             | 1,34         |
|                        |              | Immobilien: REOC                               | 1,31         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Managed Health Care          | 0,93         |
|                        |              | Elektrische Anlagen                            | 0,88         |
|                        |              | Immobilien: REITs (Wohnimmobilien)             | 0,88         |
|                        |              | Biotechnologie                                 | 0,79         |
|                        |              | Drahtlose Telekommunikationsdienste            | 0,77         |
|                        |              | Personalwesen und Personaldienstleistungen     | 0,68         |
|                        |              | Investmentbanken und Broker                    | 0,58         |
|                        |              | Interaktives Home Entertainment                | 0,53         |
|                        |              | Bildungsdienstleistungen                       | 0,52         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Dienstleistungen             | 0,28         |
|                        |              | <b>Summe</b>                                   | <b>98,85</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 5.817.884,02                                      | EUR               | 6.555.576,24       | USD                | 37.702,61  | 28.01.2022 |
| 654.392,37  | USD               | 580.207,96         | EUR                | (3.144,50)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>34.558,11</b>   |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Global Disruption Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
|                    | <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                            |                              | 56.482,00          | Tradeweb Markets  | 5.640.857,34               | 2,26                         |
|                    | <b>Aktien</b>   |                            |                              | 115.727,00         | XP  | 3.317.893,09               | 1,33                         |
|                    | <b>AUD</b>  |                            |                              | 40.373,00          | Yandex  | 2.468.001,49               | 0,99                         |
| 118.248,00         | Altium  | 3.872.793,76               | 1,55                         |                    |   | <b>159.430.866,29</b>      | <b>63,85</b>                 |
|                    | <b>CAD</b>  |                            |                              |                    | <b>Summe Aktien</b>   | <b>247.792.951,39</b>      | <b>99,24</b>                 |
| 111.200,00         | Fortis Inc/Canada   | 5.339.384,18               | 2,14                         |                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>247.792.951,39</b>      | <b>99,24</b>                 |
|                    | <b>CHF</b>  |                            |                              |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>247.792.951,39</b>      | <b>99,24</b>                 |
| 7.180,00           | Zur Rose Group  | 1.854.147,71               | 0,74                         |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>3.128.018,02</b>        | <b>1,25</b>                  |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |                    | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(1.238.990,62)</b>      | <b>(0,50)</b>                |
| 5.514,00           | ASML Holding  | 4.413.646,87               | 1,77                         |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>249.681.978,79</b>      | <b>100,00</b>                |
| 93.026,00          | Cellnex Telecom   | 5.392.626,71               | 2,16                         |                    |   |                            |                              |
| 26.337,00          | Delivery Hero   | 2.923.399,10               | 1,17                         |                    |   |                            |                              |
| 287.794,00         | FinecoBank Banca Fineco   | 5.031.345,01               | 2,02                         |                    |   |                            |                              |
| 84.900,00          | Infineon Technologies   | 3.919.562,51               | 1,57                         |                    |   |                            |                              |
| 50.771,00          | Kerry Group   | 6.512.528,81               | 2,61                         |                    |   |                            |                              |
| 33.036,00          | KION Group  | 3.610.110,39               | 1,45                         |                    |   |                            |                              |
| 34.305,00          | Orpea   | 3.423.174,68               | 1,37                         |                    |   |                            |                              |
| 3.164,00           | Rational  | 3.226.767,62               | 1,29                         |                    |   |                            |                              |
| 34.762,00          | Symrise   | 5.130.325,26               | 2,05                         |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>GBP</b>  | <b>43.583.486,96</b>       | <b>17,46</b>                 |                    |   |                            |                              |
| 78.816,00          | AVEVA Group   | 3.617.349,54               | 1,45                         |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>HKD</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 260.488,00         | Alibaba Group Holding   | 3.971.179,54               | 1,59                         |                    |   |                            |                              |
| 65.800,00          | Meituan   | 1.901.646,34               | 0,76                         |                    |   |                            |                              |
| 97.700,00          | Tencent Holdings  | 5.722.299,78               | 2,29                         |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>INR</b>  | <b>11.595.125,66</b>       | <b>4,64</b>                  |                    |   |                            |                              |
| 216.300,00         | ICICI Lombard General Insurance   | 4.077.321,92               | 1,63                         |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>JPY</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 92.000,00          | Nabtesco  | 2.720.807,20               | 1,09                         |                    |   |                            |                              |
| 301.600,00         | Pan Pacific International Holdings  | 4.157.201,63               | 1,66                         |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>NZD</b>  | <b>6.878.008,83</b>        | <b>2,75</b>                  |                    |   |                            |                              |
| 257.797,00         | Ryman Healthcare  | 2.156.133,55               | 0,86                         |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>SEK</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 37.186,00          | Vitrolife   | 2.300.719,83               | 0,92                         |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>TWD</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 17.000,00          | Silergy   | 3.087.613,16               | 1,24                         |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 21.012,00          | Advanced Drainage Systems   | 2.839.141,44               | 1,14                         |                    |   |                            |                              |
| 6.713,00           | Align Technology  | 4.495.293,32               | 1,80                         |                    |   |                            |                              |
| 49.675,00          | Allergion   | 6.532.759,25               | 2,62                         |                    |   |                            |                              |
| 4.396,00           | Alphabet  | 12.804.097,32              | 5,13                         |                    |   |                            |                              |
| 3.177,00           | Amazon.com  | 10.700.231,31              | 4,29                         |                    |   |                            |                              |
| 8.271,00           | ANSYS   | 3.347.521,83               | 1,34                         |                    |   |                            |                              |
| 7.351,00           | Atlassian Corp  | 2.829.914,47               | 1,13                         |                    |   |                            |                              |
| 10.950,00          | Autodesk  | 3.090.637,50               | 1,24                         |                    |   |                            |                              |
| 47.424,00          | Cognex  | 3.698.360,64               | 1,48                         |                    |   |                            |                              |
| 47.005,00          | Globus Medical  | 3.420.083,80               | 1,37                         |                    |   |                            |                              |
| 80.064,00          | HDFC Bank ADR   | 5.200.957,44               | 2,08                         |                    |   |                            |                              |
| 60.575,00          | Hexcel  | 3.143.842,50               | 1,26                         |                    |   |                            |                              |
| 29.852,00          | International Flavors & Fragrances  | 4.450.634,68               | 1,78                         |                    |   |                            |                              |
| 11.931,00          | Intuitive Surgical  | 4.348.730,19               | 1,74                         |                    |   |                            |                              |
| 41.100,00          | Jack Henry & Associates   | 6.886.305,00               | 2,76                         |                    |   |                            |                              |
| 18.706,00          | Marvell Technology  | 1.649.495,08               | 0,66                         |                    |   |                            |                              |
| 87.935,00          | NextEra Energy  | 8.160.368,00               | 3,27                         |                    |   |                            |                              |
| 14.809,00          | NVIDIA  | 4.404.937,05               | 1,76                         |                    |   |                            |                              |
| 8.781,00           | Paycom Software   | 3.653.422,86               | 1,46                         |                    |   |                            |                              |
| 38.652,00          | PayPal Holdings   | 7.375.188,12               | 2,95                         |                    |   |                            |                              |
| 39.369,00          | Planet Fitness  | 3.588.090,66               | 1,44                         |                    |   |                            |                              |
| 56.186,00          | Progyny   | 2.876.723,20               | 1,15                         |                    |   |                            |                              |
| 25.345,00          | salesforce.com  | 6.462.214,65               | 2,59                         |                    |   |                            |                              |
| 229.343,00         | Sberbank of Russia PJSC ADR   | 3.600.765,37               | 1,44                         |                    |   |                            |                              |
| 1.959,00           | Shopify   | 2.735.958,99               | 1,10                         |                    |   |                            |                              |
| 7.298,00           | SVB Financial   | 4.957.312,46               | 1,99                         |                    |   |                            |                              |
| 67.972,00          | Taiwan Semiconductor Manufacturing ADR  | 8.214.416,20               | 3,29                         |                    |   |                            |                              |
| 9.987,00           | Thermo Fisher Scientific  | 6.666.522,24               | 2,67                         |                    |   |                            |                              |
| 77.648,00          | TJX Cos   | 5.870.188,80               | 2,35                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Disruption Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| USA                    | 49,88        | Anwendungssoftware                                  | 10,76        |
| Deutschland            | 7,53         | Halbleiter  | 8,52         |
| Kaimaninseln           | 7,21         | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 8,41         |
| Irland                 | 5,22         | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 7,81         |
| Indien                 | 3,72         | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 5,71         |
| Taiwan, Provinz Chinas | 3,29         | Verschiedene Banken                                 | 5,54         |
| Kanada                 | 3,23         | Stromversorger                                      | 5,41         |
| Niederlande            | 2,76         | Spezialchemikalien                                  | 3,84         |
| Japan                  | 2,75         | Bauprodukte   | 3,75         |
| Vereinigtes Königreich | 2,58         | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 3,11         |
| Spanien                | 2,16         | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen      | 2,67         |
| Italien                | 2,02         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 2,61         |
| Australien             | 1,55         | Industriemaschinen                                  | 2,38         |
| Russische Föderation   | 1,44         | Bekleidung-Einzelhandel                             | 2,35         |
| Frankreich             | 1,37         | Börsen und Finanzdaten                              | 2,26         |
| Schweden               | 0,92         | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 2,23         |
| Neuseeland             | 0,86         | Integrierte Telekommunikationsdienste               | 2,16         |
| Schweiz                | 0,74         | Regionale Banken                                    | 1,99         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Produkte                          | 1,80         |
| <b>Summe</b>           | <b>99,24</b> | Halbleiter-Ausrüstung                               | 1,77         |
|                        |              | Warenhäuser   | 1,66         |
|                        |              | Sach- und Unfallversicherung                        | 1,63         |
|                        |              | Hersteller von Elektronikausrüstung                 | 1,48         |
|                        |              | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 1,45         |
|                        |              | Freizeiteinrichtungen                               | 1,44         |
|                        |              | Investmentbanken und Broker                         | 1,33         |
|                        |              | Luftfahrt und Verteidigung                          | 1,26         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Managed Health Care               | 1,15         |
|                        |              | Internet-Dienste und -Infrastruktur                 | 1,10         |
|                        |              | Biotechnologie                                      | 0,92         |
|                        |              | Arzneimittel-Einzelhandel                           | 0,74         |
|                        |              | <b>Summe</b>  | <b>99,24</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|---|-------------------------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |   |                               |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |   |                               |                            |                              |
| <b>CAD</b>  |   |                            |                              |   |                               |                            |                              |
| 10.000,00   | Dye & Durham                                  | 315.254,17                 | 1,14                         | 1.974,00  | South Jersey Industries       | 45.644,34                  | 0,17                         |
| 45.341,00   | TELLUS - Non-Canadian customer                | 935.402,94                 | 3,40                         | 824,00  | Southwest Gas Holdings        | 50.612,00                  | 0,18                         |
|   |   | <b>1.250.657,11</b>        | <b>4,54</b>                  | 18.164,00   | Switch                        | 457.367,48                 | 1,66                         |
| <b>CHF</b>  |   |                            |                              |   |                               |                            |                              |
| 225,00  | Comet Holding                                 | 73.299,47                  | 0,27                         | 2.987,00  | Tanger Factory Outlet Centers | 50.844,80                  | 0,18                         |
| 201,00  | VAT Group                                     | 88.423,48                  | 0,32                         | 3.529,00  | TechTarget                    | 298.640,05                 | 1,08                         |
|   |   | <b>161.722,95</b>          | <b>0,59</b>                  | 2.260,00  | Teleflex                      | 665.140,16                 | 2,41                         |
| <b>DKK</b>  |   |                            |                              |   |                               |                            |                              |
| 18,00   | A.P. Møller - Mærsk B                         | 56.762,10                  | 0,21                         | 16.223,00   | Terminix Global Holdings      | 646.255,91                 | 2,35                         |
| 549,00  | ChemoMetec                                    | 61.497,92                  | 0,22                         | 1.112,00  | Triton International          | 58.533,03                  | 0,21                         |
| 840,00  | Novo Nordisk B                                | 83.025,16                  | 0,30                         | 4.100,00  | Visa                          | 785.720,21                 | 2,85                         |
| 658,00  | Pandora                                       | 72.150,55                  | 0,26                         | 2.314,00  | Western Union                 | 37.202,97                  | 0,14                         |
|   |   | <b>273.435,73</b>          | <b>0,99</b>                  | 2.294,00  | Xerox Holdings                | 46.461,27                  | 0,17                         |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |   |                               |                            |                              |
| 5.946,00  | Deutsche Boerse                               | 874.656,60                 | 3,17                         | 3.900,00  | Ziff Davis                    | 382.700,31                 | 1,39                         |
| 11.855,00   | Deutsche Post                                 | 670.281,70                 | 2,43                         |   |                               | <b>11.803.178,92</b>       | <b>42,84</b>                 |
| 618,00  | Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik | 58.153,80                  | 0,21                         | <b>Summe Aktien</b>   |                               | <b>19.731.104,65</b>       | <b>71,62</b>                 |
| 24.311,00   | Freinet                                       | 565.716,97                 | 2,05                         | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                               | <b>19.731.104,65</b>       | <b>71,62</b>                 |
| 17.768,00   | Fresenius                                     | 628.987,20                 | 2,28                         | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  |                               | <b>19.731.104,65</b>       | <b>71,62</b>                 |
| 387,00  | Hapag-Lloyd                                   | 107.199,00                 | 0,39                         | <b>Bankguthaben</b>   |                               | <b>8.352.691,49</b>        | <b>30,32</b>                 |
| 18.899,00   | Koninklijke Philips                           | 619.225,74                 | 2,25                         | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  |                               | <b>(534.112,29)</b>        | <b>(1,94)</b>                |
| 19.500,00   | Koninklijke Vopak                             | 600.600,00                 | 2,18                         | <b>Summe Nettovermögen</b>  |                               | <b>27.549.683,85</b>       | <b>100,00</b>                |
| 475,00  | Qt Group Plc                                  | 63.460,00                  | 0,23                         |   |                               |                            |                              |
|   |   | <b>4.188.281,01</b>        | <b>15,20</b>                 |   |                               |                            |                              |
| <b>NOK</b>  |   |                            |                              |   |                               |                            |                              |
| 10.984,00   | Kahoot!                                       | 51.267,33                  | 0,19                         |   |                               |                            |                              |
| 2.729,00  | Nordic Semiconductor                          | 81.344,98                  | 0,30                         |   |                               |                            |                              |
|   |   | <b>132.612,31</b>          | <b>0,48</b>                  |   |                               |                            |                              |
| <b>SEK</b>  |   |                            |                              |   |                               |                            |                              |
| 2.236,00  | AddLife B                                     | 83.186,53                  | 0,30                         |   |                               |                            |                              |
| 1.366,00  | BICO Group                                    | 37.015,49                  | 0,13                         |   |                               |                            |                              |
| 1.599,00  | Bure Equity                                   | 68.347,30                  | 0,25                         |   |                               |                            |                              |
| 530,00  | Evolution                                     | 66.494,37                  | 0,24                         |   |                               |                            |                              |
| 1.381,00  | Fortnox AB                                    | 78.804,33                  | 0,29                         |   |                               |                            |                              |
| 1.794,00  | Instalco                                      | 76.017,36                  | 0,28                         |   |                               |                            |                              |
| 5.823,00  | Kindred Group SDB                             | 61.173,46                  | 0,22                         |   |                               |                            |                              |
| 3.074,00  | Lifco B                                       | 81.169,46                  | 0,29                         |   |                               |                            |                              |
| 829,00  | MIPS  | 95.985,53                  | 0,35                         |   |                               |                            |                              |
| 6.576,00  | NIBE Industrier B                             | 87.718,19                  | 0,32                         |   |                               |                            |                              |
| 1.531,00  | Sdijptech B                                   | 70.413,74                  | 0,26                         |   |                               |                            |                              |
| 46.000,00   | Securitas B                                   | 559.307,48                 | 2,03                         |   |                               |                            |                              |
| 66.862,00   | Swedish Match                                 | 469.713,45                 | 1,70                         |   |                               |                            |                              |
| 1.572,00  | Vitrolife                                     | 85.869,93                  | 0,31                         |   |                               |                            |                              |
|   |   | <b>1.921.216,62</b>        | <b>6,97</b>                  |   |                               |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |   |                               |                            |                              |
| 472,00  | AbbVie  | 56.436,64                  | 0,20                         |   |                               |                            |                              |
| 9.630,00  | Alcon   | 745.641,64                 | 2,71                         |   |                               |                            |                              |
| 1.157,00  | Altria Group                                  | 48.276,01                  | 0,18                         |   |                               |                            |                              |
| 5.000,00  | AMN Healthcare Services                       | 540.060,92                 | 1,96                         |   |                               |                            |                              |
| 1.887,00  | AT&T  | 41.083,67                  | 0,15                         |   |                               |                            |                              |
| 18.032,00   | Avantor                                       | 673.901,52                 | 2,45                         |   |                               |                            |                              |
| 1.621,00  | B&G Foods                                     | 44.136,88                  | 0,16                         |   |                               |                            |                              |
| 830,00  | Big Lots                                      | 33.195,60                  | 0,12                         |   |                               |                            |                              |
| 1.960,00  | Clearway Energy                               | 62.123,34                  | 0,23                         |   |                               |                            |                              |
| 2.085,00  | Clearway Energy                               | 61.409,61                  | 0,22                         |   |                               |                            |                              |
| 15.299,00   | Comcast                                       | 683.737,59                 | 2,48                         |   |                               |                            |                              |
| 2.700,00  | FleetCor Technologies                         | 539.237,19                 | 1,96                         |   |                               |                            |                              |
| 8.941,00  | GoDaddy                                       | 665.138,09                 | 2,41                         |   |                               |                            |                              |
| 2.332,00  | H&R Block                                     | 48.651,53                  | 0,18                         |   |                               |                            |                              |
| 13.454,00   | Invesco Mortgage Capital                      | 34.090,83                  | 0,12                         |   |                               |                            |                              |
| 417,00  | Kimberly-Clark                                | 52.257,08                  | 0,19                         |   |                               |                            |                              |
| 2.848,00  | Linde   | 865.350,46                 | 3,14                         |   |                               |                            |                              |
| 4.114,00  | McKesson                                      | 907.248,42                 | 3,29                         |   |                               |                            |                              |
| 720,00  | NextEra Energy Partners                       | 52.913,79                  | 0,19                         |   |                               |                            |                              |
| 849,00  | NorthWestern                                  | 42.905,36                  | 0,16                         |   |                               |                            |                              |
| 1.571,00  | OGE Energy                                    | 53.247,42                  | 0,19                         |   |                               |                            |                              |
| 542,00  | Philip Morris International                   | 45.091,30                  | 0,16                         |   |                               |                            |                              |
| 1.895,00  | PPL   | 50.158,57                  | 0,18                         |   |                               |                            |                              |
| 2.600,00  | Public Storage                                | 856.291,00                 | 3,11                         |   |                               |                            |                              |
| 480,00  | Quidel  | 57.410,14                  | 0,21                         |   |                               |                            |                              |
| 9.085,00  | Ritchie Bros Auctioneers                      | 489.201,56                 | 1,78                         |   |                               |                            |                              |
| 4.800,00  | Seagate Technology Holdings                   | 484.894,72                 | 1,76                         |   |                               |                            |                              |
| 683,00  | SL Green Realty                               | 43.965,51                  | 0,16                         |   |                               |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land         |              | Sektor  |              |
|--------------|--------------|---|--------------|
| USA          | 33,25        | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 4,94         |
| Deutschland  | 10,54        | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 4,87         |
| Schweden     | 6,75         | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  | 4,24         |
| Kanada       | 6,32         | Internet-Dienste und -Infrastruktur                 | 4,07         |
| Irland       | 4,90         | Integrierte Telekommunikationsdienste               | 3,54         |
| Niederlande  | 4,43         | Gesundheitswesen: Vertrieb                          | 3,29         |
| Schweiz      | 3,29         | Börsen und Finanzdaten                              | 3,17         |
| Dänemark     | 0,99         | Industriegase                                       | 3,14         |
| Norwegen     | 0,48         | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen      | 3,11         |
| Finnland     | 0,23         | Immobilien: Spezialisierte REITs                    | 3,11         |
| Malta        | 0,22         | Gesundheitswesen: Produkte                          | 2,91         |
| Bermuda      | 0,21         | Spezialisierte Verbraucherdienste                   | 2,52         |
| <b>Summe</b> | <b>71,62</b> | Kabel und Satellitenübertragung                     | 2,48         |
|              |              | Luffracht und Logistik                              | 2,43         |
|              |              | Öl- und Gaslagerung und Transport                   | 2,18         |
|              |              | Drahtlose Telekommunikationsdienste                 | 2,05         |
|              |              | Tabak   | 2,04         |
|              |              | Sicherheits- und Alarmdienste                       | 2,03         |
|              |              | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie    | 1,93         |
|              |              | Verschiedene Support-Leistungen                     | 1,78         |
|              |              | Anwendungssoftware                                  | 1,66         |
|              |              | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 1,39         |
|              |              | Werbung   | 1,08         |
|              |              | Schifffahrt   | 0,60         |
|              |              | Biotechnologie                                      | 0,52         |
|              |              | Casinos und Glücksspiel                             | 0,46         |
|              |              | Unabhängige Energieerzeuger und -händler            | 0,45         |
|              |              | Stromversorger                                      | 0,38         |
|              |              | Gasversorger  | 0,35         |
|              |              | Freizeitartikel                                     | 0,35         |
|              |              | Bauprodukte   | 0,32         |
|              |              | Industriemaschinen                                  | 0,32         |
|              |              | Pharmazeutika                                       | 0,30         |
|              |              | Halbleiter  | 0,30         |
|              |              | Industriekonglomerate                               | 0,29         |
|              |              | Bau- und Ingenieurwesen                             | 0,28         |
|              |              | Hersteller von Elektronikausrüstung                 | 0,27         |
|              |              | Bekleidung, Accessoires und Luxusgüter              | 0,26         |
|              |              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 0,26         |
|              |              | Vermögensverwaltung und Depotbanken                 | 0,25         |
|              |              | Handelsgesellschaften und Großhändler               | 0,21         |
|              |              | Haushaltsprodukte                                   | 0,19         |
|              |              | Interaktives Home Entertainment                     | 0,19         |
|              |              | Erneuerbare Elektrizität                            | 0,19         |
|              |              | Immobilien: REITs (Einzelhandel)                    | 0,18         |
|              |              | Mehrsparren-Versorger                               | 0,16         |
|              |              | Immobilien: REITs (Bürogebäude)                     | 0,16         |
|              |              | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 0,16         |
|              |              | Warenhäuser   | 0,12         |
|              |              | Immobilien: Hypotheken-REITs                        | 0,12         |
|              |              | <b>Summe</b>  | <b>71,62</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|--|-------------------|--------------------|--------------------|---|------------|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>           |                   |                    |                    |   |            |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>    |                   |                    |                    |   |            |
| 10.925,25  | EUR               | 11.382,00          | CHF                | (96,86)   | 14.02.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>(96,86)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |                   |                    |                    |   |            |
| 1.070.000,00                                     | CAD               | 735.683,95         | EUR                | 6.610,97  | 14.02.2022 |
| 245.000,00                                       | DKK               | 32.943,76          | EUR                | 3,85  | 14.02.2022 |
| 256.235,10                                       | EUR               | 370.000,00         | CAD                | (444,80)  | 14.02.2022 |
| 22.926,76  | EUR               | 170.500,00         | DKK                | (2,09)  | 14.02.2022 |
| 438.021,98                                       | EUR               | 4.375.000,00       | SEK                | 11.509,85   | 14.02.2022 |
| 2.702.000,00                                     | SEK               | 270.952,13         | EUR                | (7.538,60)  | 14.02.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>10.139,18</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>    |                   |                    |                    |   |            |
| 1.633.652,39                                     | EUR               | 2.361.108,00       | CAD                | (4.318,96)  | 14.02.2022 |
| 182.241,84                                       | EUR               | 192.800,00         | CHF                | (4.464,24)  | 14.02.2022 |
| 373.459,68                                       | EUR               | 2.777.600,00       | DKK                | (72,12)   | 14.02.2022 |
| 131.490,64                                       | EUR               | 1.298.000,00       | NOK                | 1.705,49  | 14.02.2022 |
| 11.958.599,66                                    | EUR               | 13.900.400,00      | USD                | (303.065,72)  | 14.02.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>(310.215,55)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                   |                    |                    |   |            |
| 2.510.593,00                                     | DKK               | 337.564,80         | EUR                | 59,88   | 14.02.2022 |
| 1.685.248,76                                     | EUR               | 16.728.000,00      | SEK                | 54.470,03   | 14.02.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>54.529,91</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                   |                    |                    |   |            |
| 33.771,00  | CHF               | 32.217,87          | EUR                | 485,47  | 14.02.2022 |
| 368.628,00                                       | DKK               | 49.564,89          | EUR                | 8,22  | 14.02.2022 |
| 52.478,04  | EUR               | 55.000,00          | CHF                | (783,14)  | 14.02.2022 |
| 61.179,94  | EUR               | 455.000,00         | DKK                | (8,49)  | 14.02.2022 |
| 12.425,20  | EUR               | 124.000,00         | NOK                | 26,51   | 14.02.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>(271,43)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |                   |                    |                    |   |            |
| 520.635,00                                       | DKK               | 70.004,96          | EUR                | 10,06   | 14.02.2022 |
| 93.194,93  | EUR               | 135.000,00         | CAD                | (458,80)  | 14.02.2022 |
| 20.324,78  | EUR               | 21.400,00          | CHF                | (398,73)  | 14.02.2022 |
| 61.941,96  | EUR               | 460.756,00         | DKK                | (20,54)   | 14.02.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>(868,01)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>              |                   |                    |                    |   |            |
| 64.962,98  | EUR               | 651.000,00         | SEK                | 1.497,79  | 14.02.2022 |
| 239.000,00                                       | NOK               | 23.756,65          | EUR                | 140,99  | 14.02.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>1.638,78</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>          |                   |                    |                    |   |            |
| 24.500,00  | CHF               | 23.527,01          | EUR                | 198,30  | 14.02.2022 |
| 155.000,00                                       | DKK               | 20.843,05          | EUR                | 1,35  | 14.02.2022 |
| 194.051,54                                       | EUR               | 1.443.000,00       | DKK                | (3,15)  | 14.02.2022 |
| 11.275,30  | EUR               | 112.000,00         | NOK                | 76,52   | 14.02.2022 |
| 93.438,01  | EUR               | 957.000,00         | SEK                | 139,55  | 14.02.2022 |
| 1.075.000,00                                     | SEK               | 106.048,82         | EUR                | (1.247,38)  | 14.02.2022 |
|  |                   |                    |                    | <b>(834,81)</b>   |            |
|  |                   |                    |                    | <b>(245.978,79)</b>   |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>vom 30.12.2021 bis 31.12.2021<br>in der Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                      |                             |   |  |
| EURO STOXX 50 3/2022                   | 18.03.2022 | EUR     | (24,00)                              | (1.027.200,00)              | 1.800,00  | (21.628,05)  |
| NASDAQ 100 E-MINI 3/2022               | 18.03.2022 | USD     | (5,00)                               | (1.639.650,00)              | 2.979,74  | (8.621,40)   |
| S&P MID 400 EMINI 3/2022               | 18.03.2022 | USD     | (1,00)                               | (284.080,00)                | (370,81)  | (5.480,40)   |
|  |            |         |                                      |                             | <b>4.408,93</b>   | <b>(35.729,85)</b>   |

### Equity Swaps

| Basiswert                                     | Währung | Stückzahl<br>der zugrunde<br>liegenden Aktien | Verpflichtung<br>in der<br>Basiswährung<br>des Teilfonds<br>(EUR) | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/<br>(-minderung) in der<br>Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|---------|---|---|--|--|------------|
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |         |   |   |  |  |            |
| 10X Genomics                                  | USD     | (273,00)                                      | (37.026,67)   | (3.179,16)   | 4.246,67   | 15.12.2022 |
| Accolade                                      | USD     | (1.016,00)                                    | (23.564,49)   | (1.928,57)   | 9.696,75   | 15.12.2022 |
| Alnylam Pharmaceuticals                       | USD     | (315,00)                                      | (48.504,97)   | 4.630,51   | (4.950,20)   | 15.12.2022 |
| Alstom  | EUR     | (2.271,00)                                    | (70.900,62)   | (3.996,96)   | 8.130,18   | 17.10.2022 |
| Amadeus IT Group                              | EUR     | 6.500,00                                      | 387.660,00  | 33.540,00  | (11.202,33)  | 16.01.2023 |
| ams   | CHF     | (4.578,00)                                    | (73.550,61)   | (1.706,36)   | 10.818,25  | 15.12.2022 |
| Apellis Pharmaceuticals                       | USD     | (896,00)                                      | (38.580,25)   | (3.512,33)   | (1.784,86)   | 15.12.2022 |
| Apple   | USD     | (4.629,00)                                    | (726.973,49)  | 5.803,36   | (120.079,42)   | 15.12.2022 |
| Atos  | EUR     | (1.584,00)                                    | (59.225,76)   | (3.215,52)   | 10.517,76  | 29.07.2022 |
| Avanza  | SEK     | (11.052,00)                                   | (358.130,26)  | (22.423,57)  | 61.877,05  | 15.11.2022 |
| Axfood  | SEK     | (38.825,00)                                   | (986.172,67)  | (61.351,76)  | (60.863,68)  | 15.11.2022 |
| Biohaven Pharmaceutical Holding               | USD     | (575,00)                                      | (70.569,68)   | (12.138,13)  | 1.476,32   | 15.12.2022 |
| bpost   | EUR     | (9.103,00)                                    | (69.820,01)   | (3.186,05)   | 2.730,90   | 15.11.2022 |
| CarMax  | USD     | (3.944,00)                                    | (448.111,39)  | 46.311,92  | 26.642,51  | 15.12.2022 |
| Carnival                                      | USD     | (1.908,00)                                    | (34.583,71)   | (4.447,20)   | 7.449,56   | 15.12.2022 |
| Carrefour                                     | EUR     | (4.474,00)                                    | (72.053,77)   | (4.026,60)   | 4.675,33   | 15.11.2022 |
| Casino Guichard Perrachon                     | EUR     | (2.995,00)                                    | (69.334,25)   | (3.144,75)   | (1.707,15)   | 15.11.2022 |
| Cellnex Telecom                               | EUR     | 10.454,00                                     | 535.035,72  | (11.081,24)  | (20.280,76)  | 17.10.2022 |
| Cerner  | USD     | (4.062,00)                                    | (333.524,04)  | (50.494,82)  | (17.539,99)  | 15.12.2022 |
| Clorox  | USD     | (4.400,00)                                    | (670.032,23)  | 14.179,14  | (24.347,06)  | 15.12.2022 |
| CTS Eventim                                   | EUR     | (5.500,00)                                    | (353.980,00)  | (23.760,00)  | 34.210,00  | 17.10.2022 |
| Danone  | EUR     | (13.000,00)                                   | (709.670,00)  | (19.370,00)  | 59.020,00  | 15.11.2022 |
| DCC   | GBP     | 7.500,00                                      | 540.141,37  | 4.463,98   | (8.100,40)   | 15.12.2022 |
| De'Longhi                                     | EUR     | 15.000,00                                     | 472.800,00  | 16.800,00  | (1.800,00)   | 15.11.2022 |
| Delta Air Lines                               | USD     | (1.216,00)                                    | (42.073,93)   | (2.769,86)   | 6.211,88   | 15.12.2022 |
| Demant A/S                                    | DKK     | (10.500,00)                                   | (473.158,66)  | (33.464,22)  | 35.718,04  | 15.11.2022 |
| Derwent London                                | GBP     | (10.236,00)                                   | (416.113,49)  | (7.554,62)   | 12.257,10  | 15.12.2022 |
| Domino's Pizza Group                          | GBP     | (96.565,00)                                   | (527.622,41)  | (129.893,97)   | 22.672,90  | 15.12.2022 |
| Enagas  | EUR     | (33.719,00)                                   | (687.867,60)  | 13.487,60  | (24.277,68)  | 15.11.2022 |
| Euronav                                       | EUR     | (8.178,00)                                    | (63.788,40)   | (2.338,91)   | 10.974,88  | 15.11.2022 |
| Eutelsat Communications                       | EUR     | (5.870,00)                                    | (63.014,45)   | (440,25)   | 16.025,10  | 15.11.2022 |
| Fresenius Medical Care                        | EUR     | (4.500,00)                                    | (257.130,00)  | (18.630,00)  | 22.950,00  | 31.08.2022 |
| Galapagos                                     | EUR     | (1.631,00)                                    | (80.277,82)   | (6.320,13)   | 1.900,12   | 29.07.2022 |
| General Mills                                 | USD     | (14.931,00)                                   | (882.031,71)  | 5.668,41   | (48.117,61)  | 15.12.2022 |
| Genuine Parts                                 | USD     | (5.913,00)                                    | (725.492,97)  | (31.061,98)  | 20.887,89  | 15.12.2022 |
| Getlink                                       | EUR     | (5.151,00)                                    | (74.998,56)   | (3.785,97)   | 618,12   | 15.11.2022 |
| Grifols                                       | EUR     | 34.996,00                                     | 590.557,50  | 33.771,14  | (57.797,31)  | 29.07.2022 |
| HelloFresh                                    | EUR     | (3.500,00)                                    | (236.390,00)  | 5.110,00   | 64.750,00  | 30.06.2022 |
| Iberdrola                                     | EUR     | (8.058,00)                                    | (83.883,78)   | (5.060,42)   | 3.327,95   | 29.07.2022 |
| iHeartMedia                                   | USD     | (4.500,00)                                    | (83.909,42)   | (7.111,64)   | 12.151,39  | 15.12.2022 |
| ImmunityBio                                   | USD     | (3.900,00)                                    | (22.467,22)   | (2.840,68)   | 4.972,11   | 15.12.2022 |
| Informa                                       | GBP     | 60.000,00                                     | 368.974,59  | 28.212,34  | (35.853,07)  | 15.12.2022 |
| Intel   | USD     | (12.156,00)                                   | (555.613,93)  | (11.805,59)  | (4.060,89)   | 15.12.2022 |
| JDE Peet's                                    | EUR     | (2.825,00)                                    | (76.557,50)   | (3.813,75)   | 2.683,75   | 17.10.2022 |
| Johnson Matthey                               | GBP     | (17.000,00)                                   | (414.042,91)  | (17.605,93)  | 73.643,19  | 15.12.2022 |
| JUMBO   | EUR     | (5.023,00)                                    | (63.289,80)   | (1.908,74)   | 6.128,06   | 15.11.2022 |
| Kerry Group                                   | EUR     | 5.500,00                                      | 622.875,00  | (5.225,00)   | 2.475,00   | 17.10.2022 |
| Koninklijke Ahold Delhaize                    | EUR     | (2.406,00)                                    | (72.504,81)   | (372,93)   | 2.057,13   | 15.11.2022 |
| Korian  | EUR     | 20.000,00                                     | 556.800,00  | 23.200,00  | (23.600,00)  | 15.11.2022 |
| Las Vegas Sands                               | USD     | (1.001,00)                                    | (33.432,95)   | (1.608,46)   | 4.723,62   | 15.12.2022 |
| Live Nation Entertainment                     | USD     | (635,00)                                      | (67.225,40)   | (7.562,93)   | 5.352,10   | 15.12.2022 |
| London Stock Exchange Group                   | GBP     | 5.500,00                                      | 453.718,75  | 12.439,62  | (4.145,76)   | 16.01.2023 |
| Lumen Technologies                            | USD     | (29.280,00)                                   | (328.564,69)  | (19.388,16)  | 55.993,63  | 15.12.2022 |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Equity Swaps (Fortsetzung)

| Basiswert                      | Währung | Stückzahl<br>der zugrunde<br>liegenden Aktien | Verpflichtung<br>in der<br>Basiswährung<br>des Teilfonds<br>(EUR) | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/<br>(-minderung) in der<br>Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|--------------------------------|---------|---|---|--|--|------------|
| Meltwater N.V.                 | NOK     | (19.184,00)                                   | (48.805,32)   | (1.710,11)   | 24.450,19  | 15.11.2022 |
| MorphoSys                      | EUR     | (1.695,00)                                    | (56.528,25)   | (1.542,45)   | 9.695,40   | 15.11.2022 |
| Natera                         | USD     | (525,00)                                      | (43.922,66)   | (797,25)   | 10.602,26  | 15.12.2022 |
| Netcompany Group A/S           | DKK     | (5.102,00)                                    | (483.353,12)  | (22.298,05)  | 61.053,17  | 17.10.2022 |
| Netflix                        | USD     | (900,00)                                      | (483.313,47)  | (2.550,66)   | 59.195,22  | 15.12.2022 |
| Novozymes B                    | DKK     | (11.032,00)                                   | (796.954,13)  | (20.472,76)  | (10.383,17)  | 17.10.2022 |
| Oak Street Health              | USD     | (961,00)                                      | (29.568,58)   | (1.696,91)   | 5.955,73   | 15.12.2022 |
| Open Lending                   | USD     | (1.341,00)                                    | (26.792,77)   | (1.231,31)   | 10.744,62  | 15.12.2022 |
| Orange                         | EUR     | (7.530,00)                                    | (70.879,89)   | (1.799,67)   | 5.067,69   | 29.07.2022 |
| Orpea                          | EUR     | (741,00)                                      | (65.282,10)   | (3.897,66)   | 5.928,00   | 29.07.2022 |
| Palantir Technologies          | USD     | (11.288,00)                                   | (187.261,31)  | 697,62   | 45.471,80  | 15.12.2022 |
| Paychex                        | USD     | (8.481,00)                                    | (1.019.606,91)  | (81.541,60)  | (6.006,91)   | 15.12.2022 |
| Proximus SADP                  | EUR     | (40.000,00)                                   | (685.600,00)  | (2.462,95)   | (1.256,82)   | 16.01.2023 |
| Reach                          | GBP     | 10.243,00                                     | 34.445,82   | 3.901,81   | (9.499,74)   | 15.12.2022 |
| Reckitt Benckiser Group        | GBP     | (1.082,00)                                    | (81.685,37)   | (2.524,49)   | 1.003,49   | 15.12.2022 |
| Redfin                         | USD     | (4.548,00)                                    | (159.088,65)  | 2.449,37   | 22.790,33  | 15.12.2022 |
| S&T                            | EUR     | (3.363,00)                                    | (49.301,58)   | 13.721,04  | 4.170,12   | 15.11.2022 |
| Sage Group                     | GBP     | (63.000,00)                                   | (639.405,97)  | (25.348,25)  | (51.476,27)  | 15.12.2022 |
| SAP                            | EUR     | (4.521,00)                                    | (564.672,90)  | (16.998,96)  | 16.185,18  | 17.10.2022 |
| Scientific Games               | USD     | (717,00)                                      | (42.172,37)   | (4.279,27)   | 6.824,04   | 15.12.2022 |
| Sherwin-Williams               | USD     | (3.490,00)                                    | (1.077.211,85)  | (12.201,83)  | (39.519,34)  | 15.12.2022 |
| Shockwave Medical              | USD     | (288,00)                                      | (46.188,32)   | (269,53)   | 6.349,00   | 15.12.2022 |
| Snap                           | USD     | (870,00)                                      | (36.969,14)   | (1.321,15)   | 7.024,70   | 15.12.2022 |
| STERIS                         | USD     | (4.087,00)                                    | (879.355,41)  | (52.826,27)  | 12.013,14  | 15.12.2022 |
| Surgery Partners               | USD     | (820,00)                                      | (39.195,51)   | (3.677,75)   | 1.437,45   | 15.12.2022 |
| Tate & Lyle                    | GBP     | 68.750,00                                     | 541.287,13  | 12.275,94  | (30.669,99)  | 15.12.2022 |
| Telefonica Deutschland Holding | EUR     | (160.359,00)                                  | (391.436,32)  | (8.499,02)   | 21.808,82  | 31.05.2022 |
| Telenet Group Holding          | EUR     | (2.198,00)                                    | (70.467,88)   | (3.956,40)   | 3.956,40   | 15.11.2022 |
| Telia Company                  | SEK     | (265.000,00)                                  | (915.189,42)  | (14.604,77)  | (1.806,20)   | 15.12.2022 |
| TietoEVRY Corporation          | EUR     | (19.000,00)                                   | (522.120,00)  | (26.600,00)  | 13.680,00  | 15.12.2022 |
| Uber Technologies              | USD     | (1.091,00)                                    | (41.168,36)   | (4.729,45)   | 5.582,98   | 15.12.2022 |
| Ubisoft Entertainment          | EUR     | (1.336,00)                                    | (57.541,52)   | (2.765,52)   | 7.762,16   | 29.07.2022 |
| Union Pacific                  | USD     | (4.442,00)                                    | (978.208,68)  | (9.059,30)   | (22.259,16)  | 15.12.2022 |
| United Airlines Holdings       | USD     | (1.000,00)                                    | (39.182,45)   | (2.542,71)   | 7.950,42   | 15.12.2022 |
| Valeo                          | EUR     | (2.960,00)                                    | (78.676,80)   | (799,20)   | 5.979,20   | 29.07.2022 |
| Veolia Environnement           | EUR     | 22.100,00                                     | 712.946,00  | 17.680,00  | 32.708,00  | 31.03.2022 |
| Verallia                       | EUR     | 16.910,00                                     | 523.533,60  | 26.041,40  | (40.245,80)  | 17.10.2022 |
| Vimeo                          | USD     | (1.213,00)                                    | (19.201,95)   | 53,55  | 5.294,46   | 15.12.2022 |
| Vivint Smart Home              | USD     | (3.557,00)                                    | (31.184,40)   | (3.171,83)   | 7.809,97   | 15.12.2022 |
| Walgreens Boots Alliance       | USD     | (14.000,00)                                   | (641.319,03)  | (27.501,88)  | (43.335,64)  | 17.01.2023 |
| Walt Disney                    | USD     | (310,00)                                      | (42.581,38)   | (1.417,74)   | 2.203,90   | 15.12.2022 |
|                                |         | <b>(792.673,00)</b>                           | <b>(16.686.379,57)</b>  | <b>(596.185,11)</b>  | <b>333.695,87</b>  |            |

BoFA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Equity Swaps 2.050.000,00 EUR erhalten.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Gender Diversity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                         | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------------------|----------------------------|------------------------------|---|--------------------------------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| <b>AUD</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 79.859,00   | BlueScope Steel                    | 1.209.646,23               | 0,51                         | 54.224,00   | Citigroup                            | 3.278.925,28               | 1,37                         |
| 270.741,00  | CSR                                | 1.153.770,89               | 0,48                         | 16.208,00   | Cummins                              | 3.531.236,96               | 1,48                         |
| 156.766,00  | Qantas Airways                     | 569.216,95                 | 0,24                         | 26.688,00   | CVS Health                           | 2.757.404,16               | 1,15                         |
| 41.968,00   | Sonic Healthcare                   | 1.418.312,44               | 0,59                         | 13.413,00   | DaVita                               | 1.533.776,55               | 0,64                         |
| 216.521,00  | Stockland                          | 665.356,04                 | 0,28                         | 4.422,00  | DocuSign                             | 686.780,82                 | 0,29                         |
|   |                                    | <b>5.016.302,55</b>        | <b>2,10</b>                  | 34.156,00   | eBay                                 | 2.261.810,32               | 0,95                         |
| <b>CAD</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 25.500,00   | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2.952.219,91               | 1,24                         | 7.914,00  | Ecolab                               | 1.848.077,28               | 0,77                         |
| 79.500,00   | Great-West Lifeco                  | 2.359.145,08               | 0,99                         | 18.586,00   | Eli Lilly                            | 5.167.651,44               | 2,16                         |
| 40.800,00   | Sun Life Financial                 | 2.252.351,26               | 0,94                         | 17.816,00   | Entergy                              | 1.995.213,84               | 0,84                         |
| 57.900,00   | Torex Gold Resources               | 602.475,13                 | 0,25                         | 4.434,00  | Estee Lauder Cos                     | 1.632.997,86               | 0,68                         |
|   |                                    | <b>8.166.191,38</b>        | <b>3,42</b>                  | 14.014,00   | Eversource Energy                    | 1.274.573,30               | 0,53                         |
| <b>CHF</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 6.041,00  | Sonova Holding                     | 2.370.162,63               | 0,99                         | 18.843,00   | Hershey                              | 3.602.781,60               | 1,51                         |
| 3.375,00  | Swisscom                           | 1.904.462,97               | 0,80                         | 43.033,00   | HNI                                  | 1.807.386,00               | 0,76                         |
|   |                                    | <b>4.274.625,60</b>        | <b>1,79</b>                  | 12.261,00   | Home Depot                           | 5.039.025,78               | 2,11                         |
| <b>DKK</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 39.680,00   | Novo Nordisk B                     | 4.442.196,85               | 1,86                         | 9.793,00  | Jones Lang LaSalle                   | 2.659.485,01               | 1,11                         |
| 14.861,00   | Novozymes B                        | 1.215.969,93               | 0,51                         | 4.779,00  | Lam Research                         | 3.442.887,18               | 1,44                         |
|   |                                    | <b>5.658.166,78</b>        | <b>2,37</b>                  | 10.107,00   | Mastercard                           | 3.655.095,48               | 1,53                         |
| <b>EUR</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 11.375,00   | Air Liquide                        | 1.975.358,59               | 0,83                         | 30.359,00   | Merck                                | 2.345.839,93               | 0,98                         |
| 3.997,00  | ASML Holding                       | 3.199.373,69               | 1,34                         | 40.702,00   | Microsoft                            | 13.732.040,76              | 5,75                         |
| 75.711,00   | AXA                                | 2.245.470,18               | 0,94                         | 5.194,00  | Netflix                              | 3.159.250,50               | 1,32                         |
| 20.607,00   | Eiffage                            | 2.111.383,31               | 0,88                         | 27.434,00   | NVIDIA                               | 8.160.243,30               | 3,42                         |
| 37.458,00   | Infineon Technologies              | 1.729.316,52               | 0,72                         | 9.159,00  | Oracle                               | 803.427,48                 | 0,34                         |
| 75.333,00   | L'Oreal                            | 3.557.522,66               | 1,49                         | 21.396,00   | Quest Diagnostics                    | 3.687.600,60               | 1,54                         |
| 84.079,00   | Red Electrica Corp                 | 1.811.790,32               | 0,76                         | 84.592,00   | Regions Financial                    | 1.846.643,36               | 0,77                         |
| 23.418,00   | Schneider Electric                 | 4.574.397,63               | 1,91                         | 8.654,00  | Renewable Energy Group               | 372.554,70                 | 0,16                         |
| 37.794,00   | Unilever                           | 2.014.300,99               | 0,84                         | 10.167,00   | S&P Global                           | 4.783.573,50               | 2,00                         |
|   |                                    | <b>23.218.913,89</b>       | <b>9,72</b>                  | 11.183,00   | salesforce.com                       | 2.851.329,51               | 1,19                         |
| <b>GBP</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 19.168,00   | Next                               | 2.106.303,47               | 0,88                         | 18.054,00   | Target                               | 4.151.697,84               | 1,74                         |
|   |                                    | <b>2.106.303,47</b>        | <b>0,88</b>                  | 48.315,00   | Taylor Morrison Home                 | 1.669.283,25               | 0,70                         |
| <b>HKD</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 1.521.000,00  | China CITIC Bank                   | 659.167,61                 | 0,28                         | 89.601,00   | TEGNA                                | 1.667.474,61               | 0,70                         |
| 1.031.000,00  | Dali Foods Group                   | 539.347,63                 | 0,23                         | 22.841,00   | Tractor Supply                       | 5.378.141,86               | 2,25                         |
| 439.000,00  | Great Wall Motor                   | 1.508.513,71               | 0,63                         | 15.402,00   | United Rentals                       | 5.035.067,82               | 2,11                         |
| 1.288.000,00  | Zhejiang Expressway                | 1.147.758,76               | 0,48                         | 48.316,00   | Verizon Communications               | 2.523.544,68               | 1,06                         |
|   |                                    | <b>3.854.787,71</b>        | <b>1,61</b>                  | 15.449,00   | Visa                                 | 3.353.359,94               | 1,40                         |
| <b>JPY</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 46.000,00   | DeNA                               | 707.569,68                 | 0,30                         | 17.773,00   | Walmart                              | 2.540.650,35               | 1,06                         |
| 23.700,00   | Itochu Techno-Solutions            | 761.627,99                 | 0,32                         | 7.812,00  | Walt Disney                          | 1.215.390,96               | 0,51                         |
| 30.700,00   | Sony Group                         | 3.859.666,43               | 1,62                         | 7.411,00  | Waste Management                     | 1.228.743,80               | 0,51                         |
|   |                                    | <b>5.328.864,10</b>        | <b>2,23</b>                  | 22.201,00   | Zoetis                               | 5.463.000,07               | 2,29                         |
| <b>NOK</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 84.858,00   | DNB Bank                           | 1.944.617,33               | 0,81                         | 86.116,00   | Zynga                                | 570.518,50                 | 0,24                         |
|   |                                    | <b>1.944.617,33</b>        | <b>0,81</b>                  |   |                                      | <b>153.523.973,07</b>      | <b>64,25</b>                 |
| <b>PHP</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 29.870,00   | Globe Telecom                      | 1.945.935,97               | 0,81                         | <b>ZAR</b>  |                                      |                            |                              |
|   |                                    | <b>1.945.935,97</b>        | <b>0,81</b>                  | 113.220,00  | Standard Bank Group                  | 993.851,55                 | 0,42                         |
| <b>SEK</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 79.254,00   | Castellum                          | 2.134.770,22               | 0,89                         | 254.124,00  | Telkom SA SOC                        | 861.631,72                 | 0,36                         |
| 208.626,00  | Husqvarna B                        | 3.338.744,42               | 1,40                         |   |                                      | <b>1.855.483,27</b>        | <b>0,78</b>                  |
| 147.948,00  | SEB A                              | 2.057.114,96               | 0,86                         | <b>Summe Aktien</b>   |                                      |                            |                              |
| 26.757,00   | Volvo B                            | 619.767,12                 | 0,26                         |   |                                      | <b>228.947.063,37</b>      | <b>95,82</b>                 |
|   |                                    | <b>8.150.396,72</b>        | <b>3,41</b>                  | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   |                                      |                            |                              |
| <b>SGD</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 903.500,00  | ComfortDelGro                      | 937.240,66                 | 0,39                         |   |                                      | <b>228.947.063,37</b>      | <b>95,82</b>                 |
| 67.858,00   | DBS Group Holdings                 | 1.642.147,50               | 0,69                         | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                                      |                            |                              |
|   |                                    | <b>2.579.388,16</b>        | <b>1,08</b>                  | <b>Aktien</b>   |                                      |                            |                              |
| <b>THB</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 2.097.400,00  | Home Product Center                | 910.411,66                 | 0,38                         | <b>TWD</b>  |                                      |                            |                              |
| 365.200,00  | Thanachart Capital                 | 412.701,71                 | 0,17                         | 423.000,00  | Sino-American Silicon Products       | 3.608.197,21               | 1,51                         |
|   |                                    | <b>1.323.113,37</b>        | <b>0,55</b>                  | 351.000,00  | Vanguard International Semiconductor | 2.004.481,72               | 0,84                         |
| <b>USD</b>  |                                    |                            |                              |   |                                      |                            |                              |
| 27.990,00   | AbbVie                             | 3.790.685,70               | 1,59                         |   |                                      | <b>5.612.678,93</b>        | <b>2,35</b>                  |
| 9.093,00  | Accenture                          | 3.754.681,56               | 1,57                         | <b>Summe Aktien</b>   |                                      |                            |                              |
| 13.687,00   | Alibaba Group Holding ADR          | 1.656.127,00               | 0,69                         |   |                                      | <b>5.612.678,93</b>        | <b>2,35</b>                  |
| 18.527,00   | Allstate                           | 2.184.148,03               | 0,91                         | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |                                      |                            |                              |
| 12.250,00   | American Express                   | 2.009.367,50               | 0,84                         |   |                                      | <b>5.612.678,93</b>        | <b>2,35</b>                  |
| 4.815,00  | American Tower                     | 1.399.624,20               | 0,59                         | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  |                                      |                            |                              |
| 48.420,00   | Apple                              | 8.612.949,60               | 3,60                         |   |                                      | <b>234.559.742,30</b>      | <b>98,17</b>                 |
| 49.512,00   | Bank of America                    | 2.202.788,88               | 0,92                         | <b>Bankguthaben</b>   |                                      |                            |                              |
| 12.641,00   | Check Point Software Technologies  | 1.475.710,34               | 0,62                         |   |                                      | <b>3.996.402,02</b>        | <b>1,67</b>                  |
| 58.664,00   | Cisco Systems                      | 3.723.404,08               | 1,56                         | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   |                                      |                            |                              |
|   |                                    |                            |                              |   |                                      | <b>376.142,06</b>          | <b>0,16</b>                  |
|   |                                    |                            |                              | <b>Summe Nettovermögen</b>  |                                      |                            |                              |
|   |                                    |                            |                              |   |                                      | <b>238.932.286,38</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Gender Diversity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor   |              |
|------------------------|--------------|--|--------------|
| USA                    | 61,37        | Pharmazeutika  | 7,29         |
| Frankreich             | 6,05         | Verschiedene Banken                                  | 6,76         |
| Kanada                 | 3,42         | Systemsoftware                                       | 6,70         |
| Schweden               | 3,41         | Halbleiter   | 4,98         |
| Dänemark               | 2,37         | Halbleiter-Ausrüstung                                | 4,29         |
| Taiwan, Provinz Chinas | 2,35         | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                   | 3,93         |
| Japan                  | 2,23         | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie     | 3,60         |
| Australien             | 2,10         | Produkte für den persönlichen Gebrauch               | 3,02         |
| Schweiz                | 1,79         | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen  | 2,93         |
| Vereinigtes Königreich | 1,72         | Einzelhandel: Heimwerker und Garten                  | 2,49         |
| Irland                 | 1,57         | Spezialgeschäfte                                     | 2,25         |
| China                  | 1,39         | Integrierte Telekommunikationsdienste                | 2,21         |
| Niederlande            | 1,34         | Stromversorger                                       | 2,13         |
| Singapur               | 1,08         | Handelsgesellschaften und Großhändler                | 2,11         |
| Kaimaninseln           | 0,92         | Börsen und Finanzdaten                               | 2,00         |
| Norwegen               | 0,81         | Lebens- und Krankenversicherung                      | 1,93         |
| Philippinen            | 0,81         | Elektrische Komponenten und Ausrüstung               | 1,91         |
| Südafrika              | 0,78         | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen            | 1,89         |
| Spanien                | 0,76         | Filme und Entertainment                              | 1,83         |
| Deutschland            | 0,72         | Baummaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 1,74         |
| Israel                 | 0,62         | Warenhäuser  | 1,74         |
| Thailand               | 0,55         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                  | 1,73         |
|                        |              | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)          | 1,64         |
| <b>Summe</b>           | <b>98,17</b> | Unterhaltungselektronik                              | 1,62         |
|                        |              | Biotechnologie                                       | 1,59         |
|                        |              | Kommunikationsanlagen                                | 1,56         |
|                        |              | Anwendungssoftware                                   | 1,48         |
|                        |              | Landwirtschafts- und Landmaschinen                   | 1,40         |
|                        |              | Spezialchemikalien                                   | 1,28         |
|                        |              | Immobiliendienste                                    | 1,11         |
|                        |              | Großmärkte   | 1,06         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Ausstattung                        | 0,99         |
|                        |              | Mehrspartenversicherungen                            | 0,94         |
|                        |              | Sach- und Unfallversicherung                         | 0,91         |
|                        |              | Immobilien: REOC                                     | 0,89         |
|                        |              | Bau- und Ingenieurwesen                              | 0,88         |
|                        |              | Kaufhäuser   | 0,88         |
|                        |              | Konsumfinanzierungen                                 | 0,84         |
|                        |              | Industriegase  | 0,83         |
|                        |              | Drahtlose Telekommunikationsdienste                  | 0,81         |
|                        |              | Regionale Banken                                     | 0,77         |
|                        |              | Bürodienstleistungen und Bürobedarf                  | 0,76         |
|                        |              | Rundfunk   | 0,70         |
|                        |              | Hausbau  | 0,70         |
|                        |              | Automobilhersteller                                  | 0,63         |
|                        |              | Immobilien: Spezialisierte REITs                     | 0,59         |
|                        |              | Interaktives Home Entertainment                      | 0,53         |
|                        |              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen            | 0,51         |
|                        |              | Stahl  | 0,51         |
|                        |              | Baumaterialien                                       | 0,48         |
|                        |              | Straßen- und Schienennetze                           | 0,48         |
|                        |              | Spedition/Transport                                  | 0,39         |
|                        |              | Immobilien: Verschiedene REITs                       | 0,28         |
|                        |              | Gold   | 0,25         |
|                        |              | Fluggesellschaften                                   | 0,24         |
|                        |              | Öl- und Gasraffinerien und -marketing                | 0,16         |
|                        |              | <b>Summe</b>   | <b>98,17</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Global Green Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal   | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|----------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                      |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                      |   |                            |                              |
| <b>AUD</b>  |   |                            |                              |                      |   |                            |                              |
| 300.000,00  | European Investment Bank 3.3% 03-02-2028          | 206.959,27                 | 0,33                         | 600.000,00           | Spain Government Bond 1% 30-07-2042             | 584.187,00                 | 0,94                         |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |                      |   |                            |                              |
| 500.000,00  | ABN AMRO Bank NV 0.5% 15-04-2026                  | 508.022,00                 | 0,82                         | 800.000,00           | SpareBank 1 Boligkredditt AS 0.5% 30-01-2025    | 815.936,00                 | 1,32                         |
| 300.000,00  | ABN AMRO Bank NV 0.5% 23-09-2029                  | 296.190,00                 | 0,48                         | 500.000,00           | SpareBank 1 SMN 0.125% 11-09-2026               | 496.095,00                 | 0,80                         |
| 1.000.000,00  | AP Moller - Maersk A/S 0.75% 25-11-2031           | 990.842,00                 | 1,60                         | 600.000,00           | SpareBank 1 SR-Bank ASA 0.25% 09-11-2026        | 596.570,40                 | 0,96                         |
| 1.000.000,00  | BNP Paribas SA 0.500% MULTI 04-06-2026            | 1.008.486,00               | 1,63                         | 600.000,00           | SpareBank 1 SR-Bank ASA 0.375% MULTI 15-07-2027 | 593.618,40                 | 0,96                         |
| 2.361.000,00  | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2031 | 2.409.683,82               | 3,89                         | 930.000,00           | Sparebanken Vest Boligkredit 0.01% 11-11-2026   | 929.880,96                 | 1,50                         |
| 800.000,00  | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-08-2050 | 774.972,80                 | 1,25                         | 800.000,00           | SR-Boligkredditt AS 0.01% 08-10-2026            | 799.568,00                 | 1,29                         |
| 400.000,00  | Ceska sporitelna AS 0.500% MULTI 13-09-2028       | 391.017,60                 | 0,63                         | 300.000,00           | State of Hesse 0.01% 18-06-2031                 | 295.370,40                 | 0,48                         |
| 500.000,00  | Chile Government Internation 0.83% 02-07-2031     | 498.232,00                 | 0,80                         | 600.000,00           | Storebrand Livsforsikri 1.875% MULTI 30-09-2051 | 579.146,40                 | 0,93                         |
| 1.000.000,00  | Citycon Treasury BV 1.625% 12-03-2028             | 994.510,00                 | 1,60                         | 1.800.000,00         | Swedbank AB 0.300% MULTI 20-05-2027             | 1.785.776,40               | 2,88                         |
| 700.000,00  | Danske Bank A/S 0.750% MULTI 09-06-2029           | 693.337,40                 | 1,12                         | 900.000,00           | TenneT Holding BV 2% 05-06-2034                 | 1.015.983,00               | 1,64                         |
| 500.000,00  | de Volksbank NV 0.25% 22-06-2026                  | 496.162,00                 | 0,80                         | 400.000,00           | Transmission Finance DAC 0.375% 18-06-2028      | 395.214,40                 | 0,64                         |
| 300.000,00  | DNB Boligkredditt AS 0.01% 21-01-2031             | 293.313,00                 | 0,47                         | 410.000,00           | UniCredit Bank AG 0.01% 28-09-2026              | 411.026,64                 | 0,66                         |
| 200.000,00  | E.ON International Finance B 1.25% 19-10-2027     | 210.598,00                 | 0,34                         | 1.000.000,00         | Vattenfall AB 0.05% 15-10-2025                  | 997.474,00                 | 1,61                         |
| 500.000,00  | E.ON SE 0.875% 20-08-2031                         | 515.205,00                 | 0,83                         | 1.000.000,00         | Vattenfall AB 0.5% 24-06-2026                   | 1.013.260,00               | 1,63                         |
| 1.500.000,00  | Enel Finance International N 1.125% 16-09-2026    | 1.553.190,00               | 2,51                         | <b>44.559.949,53</b> |   |                            | <b>71,87</b>                 |
| 800.000,00  | EQT AB 0.875% 14-05-2031                          | 784.016,00                 | 1,26                         | <b>GBP</b>           |   |                            |                              |
| 200.000,00  | European Investment Bank 1% 14-11-2042            | 220.096,80                 | 0,35                         | 365.000,00           | Kuntarahoitus Oyj 0.875% 16-12-2024             | 431.993,26                 | 0,70                         |
| 200.000,00  | European Investment Bank 1.25% 13-11-2026         | 214.176,80                 | 0,35                         | <b>SEK</b>           |   |                            |                              |
| 200.000,00  | European Investment Bank 1.5% 15-11-2047          | 245.002,46                 | 0,40                         | 2.000.000,00         | Nibe Industrier AB FRN 03-06-2026               | 195.534,73                 | 0,32                         |
| 630.000,00  | European Union 0.4% 04-02-2037                    | 636.075,72                 | 1,03                         | 2.000.000,00         | SSAB AB FRN 16-06-2026                          | 198.045,51                 | 0,32                         |
| 1.400.000,00  | French Republic Government B 0.5% 25-06-2044      | 1.336.798,40               | 2,16                         | 2.000.000,00         | SSAB AB FRN 26-06-2024                          | 201.672,20                 | 0,33                         |
| 3.050.000,00  | French Republic Government B 1.75% 25-06-2039     | 3.683.478,90               | 5,94                         | <b>595.252,44</b>    |   |                            | <b>0,96</b>                  |
| 1.400.000,00  | Ireland Government Bond 1.35% 18-03-2031          | 1.558.950,40               | 2,51                         | <b>USD</b>           |   |                            |                              |
| 1.340.000,00  | Italy Buoni Poliennali Del T 1.5% 30-04-2045      | 1.257.285,28               | 2,03                         | 900.000,00           | Antofagasta PLC 2.375% 14-10-2030               | 755.868,10                 | 1,22                         |
| 1.000.000,00  | Kemira Oyj 1% 30-03-2028                          | 998.499,39                 | 1,61                         | 300.000,00           | Apple Inc 2.85% 23-02-2023                      | 270.407,65                 | 0,44                         |
| 700.000,00  | Kojamo Oyj 0.875% 28-05-2029                      | 690.215,40                 | 1,11                         | 200.000,00           | Azure Power Energy Ltd 3.575% 19-08-2026        | 177.989,67                 | 0,29                         |
| 1.400.000,00  | Kreditanstalt fuer Wiederauf 0.000000% 15-06-2029 | 1.402.780,40               | 2,26                         | 700.000,00           | Banco General SA 4.125% 07-08-2027              | 662.053,59                 | 1,07                         |
| 900.000,00  | Kreditanstalt fuer Wiederauf 0.25% 30-06-2025     | 918.394,20                 | 1,48                         | 750.000,00           | Bancolombia SA 3% 29-01-2025                    | 664.642,65                 | 1,07                         |
| 400.000,00  | LeasePlan Corp NV 0.25% 07-09-2026                | 394.597,60                 | 0,64                         | 300.000,00           | Bank of America Corp 2.456% MULTI 22-10-2025    | 272.093,19                 | 0,44                         |
| 200.000,00  | Muenchener Rueckversich 1.000% MULTI 26-05-2042   | 190.845,41                 | 0,31                         | 700.000,00           | BBVA Bancomer SA/Texas 5.875% MULTI 13-09-2034  | 675.347,20                 | 1,09                         |
| 500.000,00  | Nationale-Niederlanden Bank N 0.5% 21-09-2028     | 494.433,00                 | 0,80                         | 700.000,00           | CAS Capital No 1 Ltd 4.000% MULTI Perp FC2026   | 619.317,53                 | 1,00                         |
| 1.700.000,00  | Neste Oyj 0.75% 25-03-2028                        | 1.689.970,00               | 2,73                         | 600.000,00           | Chile Government Internation 3.5% 25-01-2050    | 549.617,27                 | 0,89                         |
| 2.350.000,00  | Netherlands Government Bond 0.5% 15-01-2040       | 2.502.047,35               | 4,04                         | 300.000,00           | Citigroup Inc 1.678% MULTI 15-05-2024           | 267.567,40                 | 0,43                         |
| 500.000,00  | SFIL SA 0.25% 01-12-2031                          | 493.316,00                 | 0,80                         | 500.000,00           | Colbun SA 3.15% 19-01-2032                      | 436.807,49                 | 0,70                         |
| 500.000,00  | Societe Du Grand Paris EPIC 0.000000% 25-11-2030  | 486.509,00                 | 0,78                         | 200.000,00           | Consolidated Edison Co of Ne 3.95% 01-04-2050   | 201.056,65                 | 0,32                         |
| 500.000,00  | Societe Du Grand Paris EPIC 0.7% 15-10-2060       | 423.149,00                 | 0,68                         | 300.000,00           | European Investment Bank 2.5% 15-10-2024        | 275.823,83                 | 0,44                         |
| 300.000,00  | Societe Du Grand Paris EPIC 1% 18-02-2070         | 270.109,80                 | 0,44                         | 400.000,00           | Greenko Power II Ltd 4.3% 13-12-2028            | 358.451,42                 | 0,58                         |
| 300.000,00  | Societe Du Grand Paris EPIC 1% 26-11-2051         | 289.876,80                 | 0,47                         | 700.000,00           | Grupo Energia Bogota SA ESP 4.875% 15-05-2030   | 665.916,21                 | 1,07                         |
| 200.000,00  | Societe Du Grand Paris EPIC 1.7% 25-05-2050       | 231.420,80                 | 0,37                         | 300.000,00           | Klabn Austria GmbH 7% 03-04-2049                | 305.588,66                 | 0,49                         |
| 200.000,00  | Societe Nationale SNCF SA 0.625% 17-04-2030       | 205.036,00                 | 0,33                         | 600.000,00           | Klabn Finance SA 4.875% 19-09-2027              | 562.839,36                 | 0,91                         |
|   |   |                            |                              | 200.000,00           | Kreditanstalt fuer Wiederauf 0.75% 30-09-2030   | 164.930,31                 | 0,27                         |
|   |   |                            |                              | 300.000,00           | Kreditanstalt fuer Wiederauf 1.75% 14-09-2029   | 269.305,86                 | 0,43                         |
|   |   |                            |                              | 700.000,00           | Lenovo Group Ltd 3.421% 02-11-2030              | 625.756,60                 | 1,01                         |
|   |   |                            |                              | 800.000,00           | MidAmerican Energy Co 3.1% 01-05-2027           | 752.225,31                 | 1,21                         |
|   |   |                            |                              | 100.000,00           | MidAmerican Energy Co 4.25% 15-07-2049          | 108.974,48                 | 0,18                         |
|   |   |                            |                              | 700.000,00           | Network i2i Ltd 5.650% MULTI Perp FC2025        | 648.920,67                 | 1,05                         |
|   |   |                            |                              | 850.000,00           | ReNew Power Pvt Ltd 5.875% 05-03-2027           | 779.147,53                 | 1,26                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Green Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 900.000,00         | Rumo Luxembourg Sarl 5.25%<br>10-01-2028  | 817.640,05                 | 1,32                         |
| 800.000,00         | UltraTech Cement Ltd 2.8%<br>16-02-2031   | 682.208,98                 | 1,10                         |
| 300.000,00         | Verizon Communications Inc<br>3.875% 08-02-2029   | 293.700,83                 | 0,47                         |
|                    |   | <b>12.864.198,49</b>       | <b>20,75</b>                 |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>58.658.352,99</b>       | <b>94,61</b>                 |
|                    | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>58.658.352,99</b>       | <b>94,61</b>                 |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 300.000,00         | EEW Energy from Waste GmbH<br>0.361% 30-06-2026   | 299.559,00                 | 0,48                         |
|                    |   | <b>299.559,00</b>          | <b>0,48</b>                  |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 400.000,00         | Empresa Nacional de Telecomu<br>3.05% 14-09-2032  | 346.977,44                 | 0,56                         |
| 900.000,00         | Natura Cosméticos SA 4.125%<br>03-05-2028   | 778.704,81                 | 1,26                         |
|                    |   | <b>1.125.682,25</b>        | <b>1,82</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>1.425.241,25</b>        | <b>2,30</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>1.425.241,25</b>        | <b>2,30</b>                  |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
|                    | <b>CAD</b>  |                            |                              |
| 300.000,00         | CPPIB Capital Inc 3% 15-06-2028   | 224.323,20                 | 0,36                         |
|                    |   | <b>224.323,20</b>          | <b>0,36</b>                  |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>224.323,20</b>          | <b>0,36</b>                  |
|                    | <b>Summe sonstige übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b>   | <b>224.323,20</b>          | <b>0,36</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>60.307.917,44</b>       | <b>97,27</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>1.487.446,47</b>        | <b>2,40</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>207.031,50</b>          | <b>0,33</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>62.002.395,41</b>       | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Green Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                     |              | Sektor               |              |
|--------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| Niederlande              | 13,65        | Unternehmensanleihen | 63,16        |
| Frankreich               | 13,59        | Staatsanleihen       | 31,95        |
| Deutschland              | 12,34        | Hypothekenanleihen   | 2,16         |
| Schweden                 | 8,35         |                      |              |
| Norwegen                 | 8,23         | <b>Summe</b>         | <b>97,27</b> |
| Finnland                 | 6,15         |                      |              |
| USA                      | 3,49         |                      |              |
| Irland                   | 3,15         |                      |              |
| Chile                    | 2,95         |                      |              |
| Länderübergreifend       | 2,90         |                      |              |
| Dänemark                 | 2,72         |                      |              |
| Indien                   | 2,36         |                      |              |
| Luxemburg                | 2,23         |                      |              |
| Kolumbien                | 2,15         |                      |              |
| Italien                  | 2,03         |                      |              |
| Mauritius                | 1,91         |                      |              |
| Brasilien                | 1,26         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich   | 1,22         |                      |              |
| Mexiko                   | 1,09         |                      |              |
| Panama                   | 1,07         |                      |              |
| Hongkong                 | 1,01         |                      |              |
| Britische Jungferninseln | 1,00         |                      |              |
| Spanien                  | 0,94         |                      |              |
| Tschechische Republik    | 0,63         |                      |              |
| Österreich               | 0,49         |                      |              |
| Kanada                   | 0,36         |                      |              |
| <b>Summe</b>             | <b>97,27</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - Global Green Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 1.340,64  | EUR                | 13.467,53         | NOK                  | (6,86)  | 28.01.2022  |
| 24.021,95   | EUR                | 246.012,14        | SEK                  | 33,16   | 28.01.2022  |
| 706.602,37  | NOK                | 70.016,37         | EUR                  | 683,09  | 28.01.2022  |
| 9.330.953,87                                      | SEK                | 921.001,20        | EUR                  | (11.139,83)   | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(10.430,44)</b>  |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 27.000,00   | CAD                | 18.863,93         | EUR                  | (125,42)  | 26.01.2022  |
| 549.149,45  | EUR                | 465.000,00        | GBP                  | (4.074,64)  | 26.01.2022  |
| 32.000,00   | GBP                | 37.372,64         | EUR                  | 698,90  | 26.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(3.501,16)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 18.000,00   | CAD                | 12.609,20         | EUR                  | (116,88)  | 26.01.2022  |
| 282.739,70  | EUR                | 407.000,00        | CAD                  | 273,33  | 26.01.2022  |
| 103.823,58  | EUR                | 88.500,00         | GBP                  | (1.467,79)  | 26.01.2022  |
| 14.294.821,37                                     | EUR                | 16.683.000,00     | USD                  | (427.002,55)  | 26.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(428.313,89)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                    |                   |                      |   |             |
| 34.561,72   | EUR                | 50.000,00         | CAD                  | (139,39)  | 26.01.2022  |
| 46.842,70   | EUR                | 40.000,00         | GBP                  | (746,65)  | 26.01.2022  |
| 43.000,00   | GBP                | 51.076,00         | EUR                  | 82,21   | 26.01.2022  |
| 222.004,78  | EUR                | 345.000,00        | AUD                  | 1.351,65  | 27.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>547,82</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| 20.000,00   | CAD                | 13.882,47         | EUR                  | (2,05)  | 26.01.2022  |
| 32.602,62   | EUR                | 47.000,00         | CAD                  | (16,37)   | 26.01.2022  |
| 30.251,60   | EUR                | 26.000,00         | GBP                  | (681,58)  | 26.01.2022  |
| 164.461,32  | EUR                | 191.000,00        | USD                  | (4.085,22)  | 26.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(4.785,22)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 4.727,43  | EUR                | 4.000,00          | GBP                  | (31,52)   | 26.01.2022  |
| 668.452,55  | EUR                | 6.679.000,00      | SEK                  | 17.172,37   | 26.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>17.140,85</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(418.911,60)</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(429.342,04)</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Credit Default Swaps

| Basiswert                                     | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal      | Wahrung | Kosten (EUR)      | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)   | Falligkeit |
|---|--------------|-----------------|--------------|----------|-------------------|--|-------------------|-------------|
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |              |                 |              |          |                   |  |                   |             |
| Brazilian Government Interna 4.25% 07-01-2025 | Kauf         | 1,00%           | 3.400.000,00 | USD      | 198.688,01        | (53.871,99)  | 144.816,02        | 20.12.2026  |
|   |              |                 |              |          | <b>198.688,01</b> | <b>(53.871,99)</b>                                   | <b>144.816,02</b> |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Green Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in<br>der Basiswährung des Teilfonds<br>(EUR) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                      |                             |   |  |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022 | AUD     | 4,00                                 | 393.100,00                  | (1.284,58)  | 1.296,39   |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | 15,00                                | 2.133.750,00                | (1.249,91)  | 41.571,29  |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (4,00)                               | (532.960,00)                | 0,00  | 4.080,88   |
| Euro-BTP Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (8,00)                               | (1.176.440,00)              | (360,00)  | 20.237,42  |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (7,00)                               | (1.199.590,00)              | 0,00  | 21.455,46  |
| EURO-BUXL 30Y BND 3/2022               | 10.03.2022 | EUR     | (7,00)                               | (1.447.180,00)              | 0,00  | 73.640,59  |
| Euro-OAT Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (9,00)                               | (1.468.890,00)              | (540,00)  | 25.920,00  |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022 | GBP     | 35,00                                | 4.372.550,00                | 6.249,57  | 5.246,20   |
| SWEDISH 5YR FUT 3/2022                 | 16.03.2022 | SEK     | 7,00                                 | 7.315.849,26                | (489,78)  | (5.202,98)   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (11,00)                              | (1.435.328,18)              | (758,78)  | (13.229,21)  |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (29,00)                              | (3.509.679,56)              | (1.200,04)  | (10.854,23)  |
| US ULTRA BOND CBT 3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 10,00                                | 1.976.875,00                | 4.966,23  | 24.004,61  |
|  |            |         |                                      |                             | <b>5.332,71</b>   | <b>188.166,42</b>  |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              | <b>USD</b>         |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 2.525.000,00  | Adient Global Holdings Ltd 3.5% 15-08-2024     | 2.892.390,14               | 0,42                         | 1.090.000,00       | Ahlstrom-Munksjo Holding 3 O 4.875% 04-02-2028  | 1.070.925,00               | 0,15                         |
| 2.965.000,00  | Altice Financing SA 3% 15-01-2028              | 3.179.544,56               | 0,46                         | 3.890.000,00       | Altice France Holding SA 6% 15-02-2028          | 3.724.324,90               | 0,54                         |
| 1.600.000,00  | Altice France Holding SA 8% 15-05-2027         | 1.914.772,91               | 0,28                         | 2.125.000,00       | Altice France SA/France 5.125% 15-07-2029       | 2.070.175,00               | 0,30                         |
| 1.005.000,00  | Altice France SA/France 3.375% 15-01-2028      | 1.106.838,89               | 0,16                         | 1.180.000,00       | Avis Budget Car Rental LLC / 5.375% 01-03-2029  | 1.244.687,60               | 0,18                         |
| 3.661.000,00  | Altice France SA/France 5.875% 01-02-2027      | 4.328.046,78               | 0,62                         | 3.250.000,00       | Bath & Body Works Inc 7.5% 15-06-2029           | 3.680.625,00               | 0,53                         |
| 2.255.000,00  | ARD Finance SA 5% P-I-K 30-06-2027             | 2.617.978,89               | 0,38                         | 365.000,00         | Bausch Health Cos Inc 7% 15-01-2028             | 363.175,00                 | 0,05                         |
| 1.095.000,00  | BCP V Modular Services Finan 4.75% 30-11-2028  | 1.250.104,31               | 0,18                         | 2.400.000,00       | Bausch Health Cos Inc 7.25% 30-05-2029          | 2.358.000,00               | 0,34                         |
| 2.475.000,00  | Boxer Parent Co Inc 6.5% 02-10-2025            | 2.939.269,22               | 0,42                         | 1.155.000,00       | Bombardier Inc 7.125% 15-06-2026                | 1.200.518,55               | 0,17                         |
| 550.000,00  | Catalent Pharma Solutions In 2.375% 01-03-2028 | 621.400,11                 | 0,09                         | 2.570.000,00       | Bombardier Inc 7.875% 15-04-2027                | 2.653.525,00               | 0,38                         |
| 1.300.000,00  | Clarios Global LP / Clarios 4.375% 15-05-2026  | 1.508.590,58               | 0,22                         | 545.000,00         | Calpine Corp 3.75% 01-03-2031                   | 528.650,00                 | 0,08                         |
| 350.000,00  | Darling Global Finance BV 3.625% 15-05-2026    | 402.013,16                 | 0,06                         | 1.160.000,00       | Catalent Pharma Solutions In 3.5% 01-04-2030    | 1.149.420,80               | 0,17                         |
| 455.000,00  | Diebold Nixdorf Dutch Holdin 9% 15-07-2025     | 548.853,87                 | 0,08                         | 1.820.000,00       | Dana Inc 4.5% 15-02-2032                        | 1.815.450,00               | 0,26                         |
| 2.750.000,00  | DKT Finance ApS 7% 17-06-2023                  | 3.150.296,08               | 0,45                         | 1.040.000,00       | DCP Midstream Operating LP 3.25% 15-02-2032     | 1.050.400,00               | 0,15                         |
| 600.000,00  | Energizer Gamma Acquisition 3.5% 30-06-2029    | 655.804,35                 | 0,09                         | 812.000,00         | DCP Midstream Operating LP 5.125% 15-05-2029    | 917.560,00                 | 0,13                         |
| 950.000,00  | Iliad Holding SASU 5.625% 15-10-2028           | 1.132.798,94               | 0,16                         | 1.980.000,00       | Deutsche Bank AG/New Yo 3.729% MULTI 14-01-2032 | 2.025.790,61               | 0,29                         |
| 1.300.000,00  | INEOS Quattro Finance 1 Plc 3.75% 15-07-2026   | 1.479.807,23               | 0,21                         | 1.360.000,00       | Edison International 5.000% MULTI Perp FC2026   | 1.385.500,00               | 0,20                         |
| 2.840.000,00  | International Game Technolog 2.375% 15-04-2028 | 3.152.391,48               | 0,45                         | 525.000,00         | Embarq Corp 7.995% 01-06-2036                   | 594.709,50                 | 0,09                         |
| 800.000,00  | IPD 3 BV 5.5% 01-12-2025                       | 930.313,40                 | 0,13                         | 975.000,00         | EnLink Midstream LLC 5.375% 01-06-2029          | 996.937,50                 | 0,14                         |
| 750.000,00  | IQVIA Inc 1.75% 15-03-2026                     | 856.037,05                 | 0,12                         | 1.073.000,00       | EQM Midstream Partners LP 5.5% 15-07-2028       | 1.172.252,50               | 0,17                         |
| 1.300.000,00  | IQVIA Inc 2.25% 15-03-2029                     | 1.466.481,60               | 0,21                         | 1.085.000,00       | FirstEnergy Corp 4.4% 15-07-2027                | 1.173.466,78               | 0,17                         |
| 1.300.000,00  | IQVIA Inc 2.875% 15-06-2028                    | 1.509.138,33               | 0,22                         | 1.500.000,00       | Ford Motor Co 4.346% 08-12-2026                 | 1.636.125,00               | 0,24                         |
| 1.015.000,00  | Kleopatra Holdings 2 SCA 6.5% 01-09-2026       | 1.049.230,21               | 0,15                         | 310.000,00         | Ford Motor Credit Co LLC 3.339% 28-03-2022      | 310.403,00                 | 0,04                         |
| 1.734.000,00  | Loxam SAS 3.25% 14-01-2025                     | 1.966.882,56               | 0,28                         | 400.000,00         | Ford Motor Credit Co LLC 4% 13-11-2030          | 429.500,00                 | 0,06                         |
| 1.026.000,00  | Loxam SAS 3.75% 15-07-2026                     | 1.179.530,38               | 0,17                         | 2.330.000,00       | Ford Motor Credit Co LLC 4.125% 17-08-2027      | 2.510.575,00               | 0,36                         |
| 1.115.000,00  | Nobian Finance BV 3.625% 15-07-2026            | 1.248.697,07               | 0,18                         | 990.000,00         | Ford Motor Credit Co LLC 4.25% 20-09-2022       | 1.004.899,50               | 0,15                         |
| 1.765.000,00  | OI European Group BV 2.875% 15-02-2025         | 2.014.120,70               | 0,29                         | 2.500.000,00       | Ford Motor Credit Co LLC 4.687% 09-06-2025      | 2.687.500,00               | 0,39                         |
| 1.300.000,00  | PVH Corp 3.125% 15-12-2027                     | 1.636.440,03               | 0,24                         | 1.200.000,00       | Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 03-05-2029      | 1.363.500,00               | 0,20                         |
| 1.800.000,00  | Quatrim SASU 5.875% 15-01-2024                 | 2.091.423,27               | 0,30                         | 900.000,00         | Freeport-McMoRan Inc 5.25% 01-09-2029           | 983.250,00                 | 0,14                         |
| 1.300.000,00  | Scientific Games Internation 5.5% 15-02-2026   | 1.501.893,90               | 0,22                         | 785.000,00         | Graphic Packaging Internatio 3.75% 01-02-2030   | 793.399,50                 | 0,11                         |
| 2.826.000,00  | Telecom Italia Finance SA 7.75% 24-01-2033     | 4.252.674,42               | 0,61                         | 1.415.000,00       | HCA Inc 3.5% 01-09-2030                         | 1.488.933,75               | 0,21                         |
| 700.000,00  | TI Automotive Finance PLC 3.75% 15-04-2029     | 799.792,48                 | 0,12                         | 4.570.000,00       | Howmet Aerospace Inc 3% 15-01-2029              | 4.564.287,50               | 0,66                         |
| 1.683.000,00  | TK Elevator Holdco GmbH 6.625% 15-07-2028      | 1.807.181,00               | 0,26                         | 14.000,00          | Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-05-2025          | 16.096,23                  | 0,00                         |
| 3.360.000,00  | TK Elevator Midco GmbH 4.375% 15-07-2027       | 3.928.963,14               | 0,57                         | 885.000,00         | Icahn Enterprises LP / Icahn 5.25% 15-05-2027   | 904.912,50                 | 0,13                         |
| 2.881.000,00  | United Group BV 3.625% 15-02-2028              | 3.165.269,71               | 0,46                         | 1.260.000,00       | Kraft Heinz Foods Co 4.375% 01-06-2046          | 1.472.680,74               | 0,21                         |
| 1.400.000,00  | United Group BV 4% 15-11-2027                  | 1.569.852,90               | 0,23                         | 1.822.000,00       | Kraft Heinz Foods Co 5% 15-07-2035              | 2.229.312,60               | 0,32                         |
| 660.000,00  | Verisure Midholding AB 5.25% 15-02-2029        | 757.205,84                 | 0,11                         | 485.000,00         | Laredo Petroleum Inc 10.125% 15-01-2028         | 508.554,03                 | 0,07                         |
| 3.000.000,00  | VZ Vendor Financing II BV 2.875% 15-01-2029    | 3.283.269,19               | 0,47                         | 550.000,00         | Lumen Technologies Inc 7.6% 15-09-2039          | 591.250,00                 | 0,09                         |
|   |  | <b>69.895.298,68</b>       | <b>10,09</b>                 | 340.000,00         | Macy's Retail Holdings LLC 2.875% 15-02-2023    | 343.485,00                 | 0,05                         |
| <b>GBP</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 2.330.000,00  | Aviva PLC 6.125% MULTI 14-11-2036              | 3.667.369,80               | 0,53                         | 1.160.000,00       | Macy's Retail Holdings LLC 3.625% 01-06-2024    | 1.192.120,40               | 0,17                         |
| 1.886.000,00  | Phoenix Group Holdings PLC 6.625% 18-12-2025   | 2.945.371,31               | 0,43                         | 1.400.000,00       | Newell Brands Inc 4.7% 01-04-2026               | 1.526.350,00               | 0,22                         |
| 1.300.000,00  | Virgin Media Vendor Financin 4.875% 15-07-2028 | 1.752.790,00               | 0,25                         | 600.000,00         | Newell Brands Inc 5.875% 01-04-2036             | 739.500,00                 | 0,11                         |
| 1.600.000,00  | Vmed O2 UK Financing I PLC 4.5% 15-07-2031     | 2.149.190,20               | 0,31                         | 700.000,00         | Nordstrom Inc 4.375% 01-04-2030                 | 701.750,00                 | 0,10                         |
|   |  | <b>10.514.721,31</b>       | <b>1,52</b>                  | 1.120.000,00       | NOVA Chemicals Corp 4.25% 15-05-2029            | 1.124.547,20               | 0,16                         |
|   |  |                            |                              | 2.480.000,00       | Occidental Petroleum Corp 6.125% 01-01-2031     | 3.013.200,00               | 0,43                         |
|   |  |                            |                              | 1.460.000,00       | Occidental Petroleum Corp 6.625% 01-09-2030     | 1.806.750,00               | 0,26                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 2.170.000,00       | Occidental Petroleum Corp 8.5% 15-07-2027   | 2.690.800,00               | 0,39                         | 2.850.000,00       | Affinity Gaming 6.875% 15-12-2027                  | 2.985.916,50               | 0,43                         |
| 515.000,00         | OneMain Finance Corp 3.5% 15-01-2027  | 510.332,81                 | 0,07                         | 2.295.000,00       | Air Canada 2020-1 Class C Pa 10.5% 15-07-2026      | 2.817.424,14               | 0,41                         |
| 1.983.000,00       | OneMain Finance Corp 5.375% 15-11-2029  | 2.131.725,00               | 0,31                         | 710.000,00         | Air Canada 3.875% 15-08-2026                       | 724.200,00                 | 0,10                         |
| 1.155.000,00       | PBF Logistics LP / PBF Logis 6.875% 15-05-2023  | 1.123.237,50               | 0,16                         | 3.765.000,00       | Albertsons Cos Inc / Safeway 3.5% 15-03-2029       | 3.768.576,75               | 0,54                         |
| 3.400.000,00       | Primo Water Holdings Inc 4.375% 30-04-2029  | 3.366.000,00               | 0,49                         | 575.000,00         | Allied Universal Holdco LLC 6% 01-06-2029          | 559.187,50                 | 0,08                         |
| 1.990.000,00       | QVC Inc 4.375% 01-09-2028   | 1.975.075,00               | 0,29                         | 1.625.000,00       | Allied Universal Holdco LLC 6.625% 15-07-2026      | 1.706.250,00               | 0,25                         |
| 1.820.000,00       | Scotts Miracle-Gro Co/The 5.25% 15-12-2026  | 1.867.775,00               | 0,27                         | 2.555.000,00       | Allied Universal Holdco LLC 9.75% 15-07-2027       | 2.733.747,80               | 0,39                         |
| 2.075.000,00       | Service Corp International/U 3.375% 15-08-2030  | 2.038.998,75               | 0,29                         | 3.275.000,00       | American Airlines 2013-2 Cla 4.95% 15-01-2023      | 610.032,25                 | 0,09                         |
| 1.450.000,00       | Service Corp International/U 5.125% 01-06-2029  | 1.555.125,00               | 0,22                         | 2.085.000,00       | American Airlines Group Inc 3.75% 01-03-2025       | 1.923.412,50               | 0,28                         |
| 665.000,00         | Service Properties Trust 4.95% 01-10-2029   | 631.750,00                 | 0,09                         | 1.275.000,00       | American Airlines Inc 11.75% 15-07-2025            | 1.571.437,50               | 0,23                         |
| 540.000,00         | Service Properties Trust 5.25% 15-02-2026   | 533.250,00                 | 0,08                         | 1.380.000,00       | American Airlines Inc/AAAdvn 5.5% 20-04-2026       | 1.428.300,00               | 0,21                         |
| 935.000,00         | SM Energy Co 6.5% 15-07-2028  | 967.725,00                 | 0,14                         | 934.000,00         | Amsted Industries Inc 4.625% 15-05-2030            | 955.015,00                 | 0,14                         |
| 1.370.000,00       | Southwestern Energy Co 4.75% 01-02-2032   | 1.447.411,85               | 0,21                         | 825.000,00         | Amsted Industries Inc 5.625% 01-07-2027            | 858.000,01                 | 0,12                         |
| 2.720.000,00       | Southwestern Energy Co 5.375% 15-03-2030  | 2.910.400,05               | 0,42                         | 795.000,00         | APX Group Inc 6.75% 15-02-2027                     | 838.725,00                 | 0,12                         |
| 670.000,00         | Southwestern Energy Co 8.375% 15-09-2028  | 747.887,50                 | 0,11                         | 575.000,00         | Aramark Services Inc 5% 01-02-2028                 | 594.406,25                 | 0,09                         |
| 3.390.000,00       | SPCM SA 3.375% 15-03-2030   | 3.262.875,00               | 0,47                         | 1.025.000,00       | Arches Buyer Inc 4.25% 01-06-2028                  | 1.024.077,50               | 0,15                         |
| 216.000,00         | Spectrum Brands Inc 5.75% 15-07-2025  | 220.320,00                 | 0,03                         | 2.320.000,00       | Arches Buyer Inc 6.125% 01-12-2028                 | 2.334.488,40               | 0,34                         |
| 5.015.000,00       | Sprint Corp 7.625% 01-03-2026   | 6.021.009,00               | 0,87                         | 2.163.000,00       | Archrock Partners LP / Archr 6.25% 01-04-2028      | 2.255.403,36               | 0,33                         |
| 660.000,00         | Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-11-2033   | 710.688,00                 | 0,10                         | 1.525.000,00       | Ardagh Metal Packaging Finan 3.25% 01-09-2028      | 1.507.881,88               | 0,22                         |
| 1.500.000,00       | Telecom Italia SpA/Milano 5.303% 30-05-2024   | 1.578.690,00               | 0,23                         | 355.000,00         | Ardagh Packaging Finance PLC 5.25% 30-04-2025      | 366.537,50                 | 0,05                         |
| 2.850.000,00       | Teleflex Inc 4.625% 15-11-2027  | 2.964.000,00               | 0,43                         | 1.800.000,00       | Arko Corp 5.125% 15-11-2029                        | 1.739.250,00               | 0,25                         |
| 1.630.000,00       | T-Mobile USA Inc 3.375% 15-04-2029  | 1.661.344,85               | 0,24                         | 336.000,00         | Asbury Automotive Group Inc 4.5% 01-03-2028        | 341.880,00                 | 0,05                         |
| 656.000,00         | TRI Pointe Group Inc / TRI P 5.875% 15-06-2024  | 714.220,00                 | 0,10                         | 1.052.000,00       | Asbury Automotive Group Inc 4.625% 15-11-2029      | 1.071.725,00               | 0,15                         |
| 490.000,00         | Tri Pointe Homes Inc 5.25% 01-06-2027   | 527.975,00                 | 0,08                         | 393.000,00         | Asbury Automotive Group Inc 4.75% 01-03-2030       | 399.386,25                 | 0,06                         |
| 750.000,00         | United Airlines Inc 4.625% 15-04-2029   | 773.437,50                 | 0,11                         | 1.667.000,00       | Ascent Resources Utica Holdi 5.875% 30-06-2029     | 1.603.970,73               | 0,23                         |
| 2.805.000,00       | United Rentals North America 3.75% 15-01-2032   | 2.824.642,01               | 0,41                         | 1.290.000,00       | Ascent Resources Utica Holdi 7% 01-11-2026         | 1.307.737,50               | 0,19                         |
| 1.075.000,00       | Vistra Operations Co LLC 4.375% 01-05-2029  | 1.076.752,25               | 0,16                         | 805.000,00         | Ascent Resources Utica Holdi 8.25% 31-12-2028      | 839.212,50                 | 0,12                         |
| 855.000,00         | Western Midstream Operating 4.5% 01-03-2028   | 929.812,50                 | 0,13                         | 330.000,00         | At Home Group Inc 4.875% 15-07-2028                | 325.050,00                 | 0,05                         |
| 2.610.000,00       | Western Midstream Operating 5.3% 01-02-2030   | 2.873.662,20               | 0,41                         | 2.600.000,00       | Avantor Funding Inc 3.875% 01-11-2029              | 2.628.366,00               | 0,38                         |
| 650.000,00         | Yum! Brands Inc 3.625% 15-03-2031   | 647.562,50                 | 0,09                         | 375.000,00         | Avient Corp 5.75% 15-05-2025                       | 390.937,50                 | 0,06                         |
| 1.300.000,00       | Ziggo Bond Co BV 5.125% 28-02-2030  | 1.306.500,00               | 0,19                         | 2.300.000,00       | Bath & Body Works Inc 6.625% 01-10-2030            | 2.604.750,00               | 0,38                         |
|                    |   | <b>117.709.959,96</b>      | <b>16,99</b>                 | 682.000,00         | Bath & Body Works Inc 9.375% 01-07-2025            | 832.040,00                 | 0,12                         |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>198.119.979,95</b>      | <b>28,59</b>                 | 5.410.000,00       | Bausch Health Americas Inc 8.5% 31-01-2027         | 5.680.500,00               | 0,82                         |
|                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>198.119.979,95</b>      | <b>28,59</b>                 | 1.700.000,00       | Bausch Health Cos Inc 9% 15-12-2025                | 1.776.500,00               | 0,26                         |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              | 1.150.000,00       | BCPE Ulysses Intermediate In 7.75% P-I-K 01-04-202 | 1.135.625,00               | 0,16                         |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              | 2.196.000,00       | Berry Global Inc 4.5% 15-02-2026                   | 2.229.489,09               | 0,32                         |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              | 490.000,00         | Boyd Gaming Corp 8.625% 01-06-2025                 | 524.300,00                 | 0,08                         |
| 1.150.000,00       | Crown European Holdings SA 3.375% 15-05-2025  | 1.385.918,36               | 0,20                         | 1.110.000,00       | Brink's Co/The 5.5% 15-07-2025                     | 1.154.400,00               | 0,17                         |
|                    |   | <b>1.385.918,36</b>        | <b>0,20</b>                  | 1.540.000,00       | Brundage-Bone Concrete Pumpi 6% 01-02-2026         | 1.601.600,02               | 0,23                         |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              | 530.000,00         | Builders FirstSource Inc 4.25% 01-02-2032          | 551.200,00                 | 0,08                         |
| 1.200.000,00       | 1011778 BC ULC / New Red Fin 3.5% 15-02-2029  | 1.187.640,00               | 0,17                         | 1.424.000,00       | Builders FirstSource Inc 6.75% 01-06-2027          | 1.502.320,00               | 0,22                         |
| 1.665.000,00       | 1011778 BC ULC / New Red Fin 3.875% 15-01-2028  | 1.685.812,50               | 0,24                         | 1.090.000,00       | Cable One Inc 4% 15-11-2030                        | 1.068.200,00               | 0,15                         |
| 1.000.000,00       | Aethon United BR LP / Aethon 8.25% 15-02-2026   | 1.074.200,00               | 0,16                         | 1.075.000,00       | Caesars Entertainment Inc 6.25% 01-07-2025         | 1.127.406,25               | 0,16                         |
|                    |   |                            |                              | 860.000,00         | Caesars Resort Collection LL 5.75% 01-07-2025      | 900.974,70                 | 0,13                         |
|                    |   |                            |                              | 705.000,00         | Calpine Corp 4.5% 15-02-2028                       | 729.675,00                 | 0,11                         |
|                    |   |                            |                              | 515.000,00         | Calpine Corp 5.25% 01-06-2026                      | 528.518,76                 | 0,08                         |
|                    |   |                            |                              | 2.355.000,00       | Carnival Corp 6% 01-05-2029                        | 2.343.225,00               | 0,34                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 2.350.000,00       | Carriage Services Inc 4.25%<br>15-05-2029         | 2.338.250,00               | 0,34                         | 245.000,00         | Diamond Sports Group LLC / D<br>6.625% 15-08-2027 | 68.600,00                  | 0,01                         |
| 1.305.000,00       | Cascades Inc/Cascades USA In<br>5.375% 15-01-2028 | 1.337.625,00               | 0,19                         | 2.180.000,00       | Directv Financing LLC / Dire<br>5.875% 15-08-2027 | 2.236.854,40               | 0,32                         |
| 3.120.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi<br>4.25% 01-02-2031  | 3.151.200,00               | 0,45                         | 3.080.000,00       | DISH DBS Corp 5.75% 01-12-2028                    | 3.103.100,00               | 0,45                         |
| 9.539.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi<br>4.75% 01-03-2030  | 9.920.560,00               | 1,43                         | 3.915.000,00       | DISH DBS Corp 7.375% 01-07-<br>2028               | 3.963.937,50               | 0,57                         |
| 2.130.000,00       | CD&R Smokey Buyer Inc 6.75%<br>15-07-2025         | 2.236.500,00               | 0,32                         | 2.571.000,00       | DISH DBS Corp 7.75% 01-07-2026                    | 2.712.405,00               | 0,39                         |
| 625.000,00         | CDW LLC / CDW Finance Corp<br>3.25% 15-02-2029    | 630.806,25                 | 0,09                         | 1.835.000,00       | Dornoch Debt Merger Sub Inc<br>6.625% 15-10-2029  | 1.812.062,50               | 0,26                         |
| 1.370.000,00       | CDW LLC / CDW Finance Corp<br>4.25% 01-04-2028    | 1.414.525,00               | 0,20                         | 2.110.000,00       | Dycom Industries Inc 4.5% 15-<br>04-2029          | 2.149.562,50               | 0,31                         |
| 2.300.000,00       | CDW LLC / CDW Finance Corp<br>5.5% 01-12-2024     | 2.517.120,00               | 0,36                         | 1.707.000,00       | Edgewell Personal Care Co 5.5%<br>01-06-2028      | 1.805.152,50               | 0,26                         |
| 3.385.000,00       | Centene Corp 4.625% 15-12-2029                    | 3.634.643,75               | 0,52                         | 1.205.000,00       | Endeavor Energy Resources LP<br>5.75% 30-01-2028  | 1.276.420,35               | 0,18                         |
| 2.081.000,00       | Centennial Resource Producti<br>6.875% 01-04-2027 | 2.122.620,00               | 0,31                         | 744.000,00         | Endeavor Energy Resources LP<br>6.625% 15-07-2025 | 784.920,00                 | 0,11                         |
| 640.000,00         | Cheniere Energy Inc 4.625%<br>15-10-2028          | 675.200,00                 | 0,10                         | 1.045.000,00       | Endo Luxembourg Finance Co I<br>6.125% 01-04-2029 | 1.018.875,00               | 0,15                         |
| 685.000,00         | Cheniere Energy Partners LP 4.5%<br>01-10-2029    | 726.100,00                 | 0,10                         | 675.000,00         | Endure Digital Inc 6% 15-02-2029                  | 627.750,00                 | 0,09                         |
| 545.000,00         | Chobani LLC / Chobani Financ<br>4.625% 15-11-2028 | 559.962,98                 | 0,08                         | 1.400.000,00       | Energizer Holdings Inc 4.375%<br>31-03-2029       | 1.368.500,00               | 0,20                         |
| 1.864.000,00       | Chobani LLC / Chobani Financ<br>7.5% 15-04-2025   | 1.919.920,00               | 0,28                         | 1.340.000,00       | EnerSys 4.375% 15-12-2027                         | 1.390.250,00               | 0,20                         |
| 460.000,00         | CHS/Community Health Systems<br>5.625% 15-03-2027 | 486.831,80                 | 0,07                         | 510.000,00         | EnLink Midstream LLC 5.625%<br>15-01-2028         | 530.400,00                 | 0,08                         |
| 885.000,00         | CHS/Community Health Systems<br>6% 15-01-2029     | 943.631,25                 | 0,14                         | 1.670.000,00       | Entegris Inc 4.375% 15-04-2028                    | 1.715.925,00               | 0,25                         |
| 630.000,00         | CHS/Community Health Systems<br>6.625% 15-02-2025 | 652.050,01                 | 0,09                         | 3.050.000,00       | EQM Midstream Partners LP<br>4.75% 15-01-2031     | 3.202.500,00               | 0,46                         |
| 1.970.000,00       | CHS/Community Health Systems<br>6.875% 15-04-2029 | 2.006.937,50               | 0,29                         | 1.035.000,00       | EQM Midstream Partners LP 6%<br>01-07-2025        | 1.117.800,00               | 0,16                         |
| 2.995.000,00       | CHS/Community Health Systems<br>8% 15-03-2026     | 3.148.493,75               | 0,45                         | 1.285.000,00       | EQM Midstream Partners LP 6.5%<br>01-07-2027      | 1.439.200,00               | 0,21                         |
| 1.550.000,00       | Clarios Global LP / Clarios 8.5%<br>15-05-2027    | 1.643.000,00               | 0,24                         | 1.015.000,00       | Everi Holdings Inc 5% 15-07-2029                  | 1.027.687,50               | 0,15                         |
| 815.000,00         | Clarios Global LP 6.75% 15-05-<br>2025            | 855.750,00                 | 0,12                         | 3.515.000,00       | Fair Isaac Corp 4% 15-06-2028                     | 3.606.600,90               | 0,52                         |
| 1.280.000,00       | Clarivate Science Holdings C<br>3.875% 01-07-2028 | 1.286.400,00               | 0,19                         | 850.000,00         | Fair Isaac Corp 5.25% 15-05-2026                  | 933.937,50                 | 0,13                         |
| 2.925.000,00       | Clean Harbors Inc 4.875% 15-<br>07-2027           | 3.012.750,00               | 0,43                         | 650.000,00         | First Student Bidco Inc / Fi 4%<br>31-07-2029     | 631.800,00                 | 0,09                         |
| 1.285.000,00       | Clear Channel Worldwide Hold<br>5.125% 15-08-2027 | 1.323.550,00               | 0,19                         | 1.750.000,00       | Foot Locker Inc 4% 01-10-2029                     | 1.752.931,25               | 0,25                         |
| 1.450.000,00       | Clearway Energy Operating LL<br>3.75% 15-01-2032  | 1.439.125,00               | 0,21                         | 2.205.000,00       | Fortress Transportation and 5.5%<br>01-05-2028    | 2.246.828,85               | 0,32                         |
| 400.000,00         | Clearway Energy Operating LL<br>3.75% 15-02-2031  | 400.384,00                 | 0,06                         | 970.000,00         | Foundation Building Material 6%<br>01-03-2029     | 953.025,00                 | 0,14                         |
| 1.600.000,00       | Clearway Energy Operating LL<br>4.75% 15-03-2028  | 1.682.000,00               | 0,24                         | 2.850.000,00       | Garda World Security Corp 9.5%<br>01-11-2027      | 3.049.500,00               | 0,44                         |
| 2.600.000,00       | CNX Midstream Partners LP<br>4.75% 15-04-2030     | 2.590.250,00               | 0,37                         | 1.395.000,00       | GFL Environmental Inc 4% 01-<br>08-2028           | 1.367.100,00               | 0,20                         |
| 396.000,00         | CNX Resources Corp 6% 15-01-<br>2029              | 411.840,00                 | 0,06                         | 545.000,00         | GFL Environmental Inc 4.75%<br>15-06-2029         | 547.043,75                 | 0,08                         |
| 1.600.000,00       | CNX Resources Corp 7.25% 14-<br>03-2027           | 1.697.168,00               | 0,24                         | 449.000,00         | GFL Environmental Inc 5.125%<br>15-12-2026        | 467.521,25                 | 0,07                         |
| 2.085.000,00       | Coeur Mining Inc 5.125% 15-02-<br>2029            | 1.915.593,75               | 0,28                         | 1.665.000,00       | Go Daddy Operating Co LLC /<br>5.25% 01-12-2027   | 1.721.193,75               | 0,25                         |
| 1.835.000,00       | CommScope Inc 6% 01-03-2026                       | 1.890.050,00               | 0,27                         | 755.000,00         | Great Lakes Dredge & Dock Co<br>5.25% 01-06-2029  | 777.650,00                 | 0,11                         |
| 2.155.000,00       | CommScope Inc 8.25% 01-03-<br>2027                | 2.203.487,50               | 0,32                         | 470.000,00         | Group 1 Automotive Inc 4% 15-<br>08-2028          | 468.237,50                 | 0,07                         |
| 1.600.000,00       | CoreLogic Inc 4.5% 01-05-2028                     | 1.584.000,00               | 0,23                         | 2.530.000,00       | H&E Equipment Services Inc<br>3.875% 15-12-2028   | 2.511.025,00               | 0,36                         |
| 2.615.000,00       | Cornerstone Building Brands<br>6.125% 15-01-2029  | 2.804.587,50               | 0,40                         | 1.488.000,00       | Hanesbrands Inc 4.625% 15-05-<br>2024             | 1.558.144,32               | 0,22                         |
| 545.000,00         | Covert Mergeco Inc 4.875%<br>01-12-2029           | 553.175,00                 | 0,08                         | 3.185.000,00       | Hartford Financial Services FRN<br>12-02-2047     | 3.034.417,31               | 0,44                         |
| 610.000,00         | CP Atlas Buyer Inc 7% 01-12-2028                  | 604.662,50                 | 0,09                         | 1.400.000,00       | HealthEquity Inc 4.5% 01-10-2029                  | 1.386.000,00               | 0,20                         |
| 855.000,00         | CrownRock LP / CrownRock Fin<br>5% 01-05-2029     | 887.062,50                 | 0,13                         | 3.650.000,00       | Herc Holdings Inc 5.5% 15-07-<br>2027             | 3.796.000,00               | 0,55                         |
| 4.845.000,00       | CSC Holdings LLC 4.625% 01-<br>12-2030            | 4.584.581,25               | 0,66                         | 605.000,00         | Hertz Corp/The 4.625% 01-12-<br>2026              | 608.781,25                 | 0,09                         |
| 2.225.000,00       | CSC Holdings LLC 5.5% 15-04-<br>2027              | 2.300.093,75               | 0,33                         | 865.000,00         | Hess Midstream Operations LP<br>4.25% 15-02-2030  | 858.512,50                 | 0,12                         |
| 1.245.000,00       | Darling Ingredients Inc 5.25%<br>15-04-2027       | 1.283.906,30               | 0,19                         | 47.000,00          | Hess Midstream Operations LP<br>5.125% 15-06-2028 | 48.938,75                  | 0,01                         |
| 2.210.000,00       | Delek Logistics Partners LP<br>7.125% 01-06-2028  | 2.298.400,00               | 0,33                         | 516.000,00         | Hess Midstream Operations LP<br>5.625% 15-02-2026 | 531.480,00                 | 0,08                         |
| 500.000,00         | Diamond Sports Group LLC / D<br>5.375% 15-08-2026 | 253.850,00                 | 0,04                         | 1.470.000,00       | Hilcorp Energy I LP / Hilcor 5.75%<br>01-02-2029  | 1.508.587,50               | 0,22                         |
|                    |   |                            |                              | 1.305.000,00       | Hilcorp Energy I LP / Hilcor 6%<br>01-02-2031     | 1.344.150,00               | 0,19                         |
|                    |   |                            |                              | 775.000,00         | Hill-Rom Holdings Inc 4.375%<br>15-09-2027        | 808.557,50                 | 0,12                         |
|                    |   |                            |                              | 1.390.000,00       | Hilton Domestic Operating Co<br>4.875% 15-01-2030 | 1.485.562,50               | 0,21                         |
|                    |   |                            |                              | 3.350.000,00       | Hologic Inc 3.25% 15-02-2029                      | 3.350.000,00               | 0,48                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 700.000,00         | iHeartCommunications Inc 4.75% 15-01-2028     | 708.750,00                 | 0,10                         | 1.145.000,00       | NESCO Holdings II Inc 5.5% 15-04-2029          | 1.182.212,50               | 0,17                         |
| 1.275.000,00       | iHeartCommunications Inc 5.25% 15-08-2027     | 1.327.514,08               | 0,19                         | 360.000,00         | Newell Brands Inc 4.875% 01-06-2025            | 392.400,00                 | 0,06                         |
| 610.000,00         | Imola Merger Corp 4.75% 15-05-2029            | 625.323,20                 | 0,09                         | 745.000,00         | News Corp 3.875% 15-05-2029                    | 752.450,00                 | 0,11                         |
| 1.625.000,00       | Intertape Polymer Group Inc 4.375% 15-06-2029 | 1.625.000,00               | 0,23                         | 3.045.000,00       | Nexstar Media Inc 5.625% 15-07-2027            | 3.197.250,00               | 0,46                         |
| 1.600.000,00       | Intesa Sanpaolo SpA 4.198% MULTI 01-06-2032   | 1.615.204,50               | 0,23                         | 600.000,00         | Nielsen Finance LLC / Nielse 4.5% 15-07-2029   | 590.244,00                 | 0,09                         |
| 1.230.000,00       | Iron Mountain Inc 4.5% 15-02-2031             | 1.243.148,70               | 0,18                         | 430.000,00         | NMI Holdings Inc 7.375% 01-06-2025             | 488.265,00                 | 0,07                         |
| 740.000,00         | Iron Mountain Inc 4.875% 15-09-2027           | 767.365,20                 | 0,11                         | 950.000,00         | Novelis Corp 3.25% 15-11-2026                  | 958.312,50                 | 0,14                         |
| 525.000,00         | Iron Mountain Inc 5.25% 15-03-2028            | 546.000,00                 | 0,08                         | 750.000,00         | Novelis Corp 3.875% 15-08-2031                 | 745.312,50                 | 0,11                         |
| 1.370.000,00       | Iron Mountain Inc 5.25% 15-07-2030            | 1.434.102,30               | 0,21                         | 1.350.000,00       | OI European Group BV 4.75% 15-02-2030          | 1.368.198,00               | 0,20                         |
| 770.000,00         | Iron Mountain Inc 5.625% 15-07-2032           | 825.165,88                 | 0,12                         | 392.000,00         | Olympus Water US Holding Cor 4.25% 01-10-2028  | 389.796,96                 | 0,06                         |
| 730.000,00         | JetBlue 2020-1 Class B Pass 7.75% 15-11-2028  | 758.250,67                 | 0,11                         | 1.410.000,00       | Open Text Corp 3.875% 01-12-2029               | 1.427.625,00               | 0,21                         |
| 1.550.000,00       | Kronos Acquisition Holdings 5% 31-12-2026     | 1.531.136,50               | 0,22                         | 3.250.000,00       | Open Text Corp 3.875% 15-02-2028               | 3.312.562,50               | 0,48                         |
| 2.820.000,00       | Kronos Acquisition Holdings 7% 31-12-2027     | 2.657.850,00               | 0,38                         | 1.135.000,00       | Open Text Holdings Inc 4.125% 15-02-2030       | 1.169.050,00               | 0,17                         |
| 735.000,00         | Ladder Capital Finance Holdi 4.75% 15-06-2029 | 747.862,50                 | 0,11                         | 642.000,00         | Ortho-Clinical Diagnostics I 7.375% 01-06-2025 | 677.310,02                 | 0,10                         |
| 1.785.000,00       | Lamar Media Corp 4% 15-02-2030                | 1.810.882,50               | 0,26                         | 1.198.000,00       | Owens-Brockway Glass Contain 5.875% 15-08-2023 | 1.254.905,00               | 0,18                         |
| 1.160.000,00       | Laredo Petroleum Inc 7.75% 31-07-2029         | 1.131.000,00               | 0,16                         | 1.017.000,00       | Owens-Brockway Glass Contain 6.375% 15-08-2025 | 1.095.817,50               | 0,16                         |
| 465.000,00         | LBM Acquisition LLC 6.25% 15-01-2029          | 459.768,75                 | 0,07                         | 2.460.000,00       | Owens-Brockway Glass Contain 6.625% 13-05-2027 | 2.595.300,00               | 0,37                         |
| 840.000,00         | LCM Investments Holdings II 4.875% 01-05-2029 | 863.251,20                 | 0,12                         | 1.615.000,00       | Par Pharmaceutical Inc 7.5% 01-04-2027         | 1.649.318,75               | 0,24                         |
| 465.000,00         | LD Holdings Group LLC 6.125% 01-04-2028       | 434.775,00                 | 0,06                         | 2.735.000,00       | Park Intermediate Holdings L 4.875% 15-05-2029 | 2.810.212,50               | 0,41                         |
| 1.735.000,00       | Level 3 Financing Inc 3.625% 15-01-2029       | 1.648.250,00               | 0,24                         | 1.000.000,00       | Park Intermediate Holdings L 5.875% 01-10-2028 | 1.045.800,00               | 0,15                         |
| 1.190.000,00       | Level 3 Financing Inc 3.75% 15-07-2029        | 1.130.500,00               | 0,16                         | 660.000,00         | Park River Holdings Inc 5.625% 01-02-2029      | 630.300,00                 | 0,09                         |
| 1.530.000,00       | LGI Homes Inc 4% 15-07-2029                   | 1.526.175,00               | 0,22                         | 545.000,00         | Pattern Energy Operations LP 4.5% 15-08-2028   | 566.047,90                 | 0,08                         |
| 3.375.000,00       | Lincoln National Corp FRN 17-05-2066          | 2.995.312,50               | 0,43                         | 1.950.000,00       | PBF Holding Co LLC / PBF Fin 9.25% 15-05-2025  | 1.854.937,50               | 0,27                         |
| 1.545.000,00       | LPL Holdings Inc 4.625% 15-11-2027            | 1.599.075,00               | 0,23                         | 1.695.000,00       | Penn National Gaming Inc 4.125% 01-07-2029     | 1.644.150,00               | 0,24                         |
| 1.420.000,00       | Lumen Technologies Inc 5.375% 15-06-2029      | 1.420.000,00               | 0,20                         | 1.110.000,00       | PennyMac Financial Services 5.375% 15-10-2025  | 1.140.525,00               | 0,16                         |
| 2.105.000,00       | Macy's Retail Holdings LLC 5.875% 01-04-2029  | 2.244.456,25               | 0,32                         | 1.371.000,00       | Picasso Finance Sub Inc 6.125% 15-06-2025      | 1.430.981,26               | 0,21                         |
| 605.000,00         | Match Group Holdings II LLC 3.625% 01-10-2031 | 586.850,00                 | 0,08                         | 1.975.000,00       | Post Holdings Inc 4.625% 15-04-2030            | 2.011.537,50               | 0,29                         |
| 3.305.000,00       | Match Group Holdings II LLC 4.625% 01-06-2028 | 3.420.675,00               | 0,49                         | 1.055.000,00       | Post Holdings Inc 5.5% 15-12-2029              | 1.106.431,25               | 0,16                         |
| 3.465.000,00       | Match Group Holdings II LLC 5% 15-12-2027     | 3.603.600,00               | 0,52                         | 1.000.000,00       | Post Holdings Inc 5.625% 15-01-2028            | 1.052.500,00               | 0,15                         |
| 1.070.000,00       | Mattel Inc 3.375% 01-04-2026                  | 1.099.425,00               | 0,16                         | 745.000,00         | PRA Health Sciences Inc 2.875% 15-07-2026      | 745.931,25                 | 0,11                         |
| 2.940.000,00       | Mattel Inc 5.875% 15-12-2027                  | 3.160.382,40               | 0,46                         | 620.000,00         | Presidio Holdings Inc 8.25% 01-02-2028         | 660.300,00                 | 0,10                         |
| 1.225.000,00       | Mauser Packaging Solutions H 5.5% 15-04-2024  | 1.236.233,25               | 0,18                         | 835.000,00         | Prestige Brands Inc 3.75% 01-04-2031           | 809.950,00                 | 0,12                         |
| 1.722.000,00       | Mauser Packaging Solutions H 7.25% 15-04-2025 | 1.726.365,27               | 0,25                         | 2.290.000,00       | Prestige Brands Inc 5.125% 15-01-2028          | 2.384.462,50               | 0,34                         |
| 900.000,00         | MGM Growth Properties Operat 5.75% 01-02-2027 | 1.014.750,00               | 0,15                         | 2.410.000,00       | Prime Security Services Borr 3.375% 31-08-2027 | 2.324.396,80               | 0,34                         |
| 1.595.000,00       | Michaels Cos Inc/The 5.25% 01-05-2028         | 1.591.012,50               | 0,23                         | 715.000,00         | Qorvo Inc 4.375% 15-10-2029                    | 758.793,75                 | 0,11                         |
| 1.365.000,00       | Michaels Cos Inc/The 7.875% 01-05-2029        | 1.337.700,00               | 0,19                         | 2.215.000,00       | Realogy Group LLC / Realogy 5.75% 15-01-2029   | 2.275.912,50               | 0,33                         |
| 1.485.000,00       | Midcap Financial Issuer Trus 6.5% 01-05-2028  | 1.548.869,85               | 0,22                         | 851.000,00         | Realogy Group LLC / Realogy 7.625% 15-06-2025  | 904.187,50                 | 0,13                         |
| 1.385.000,00       | Mileage Plus Holdings LLC / 6.5% 20-06-2027   | 1.478.487,50               | 0,21                         | 4.040.000,00       | Ritchie Bros Auctioneers Inc 5.375% 15-01-2025 | 4.080.884,80               | 0,59                         |
| 2.370.000,00       | Mohegan Gaming & Entertainme 8% 01-02-2026    | 2.488.500,00               | 0,36                         | 700.000,00         | Ritchie Bros Holdings Inc 4.75% 15-12-2031     | 729.750,00                 | 0,11                         |
| 2.341.000,00       | Mozart Debt Merger Sub Inc 3.875% 01-04-2029  | 2.329.295,00               | 0,34                         | 580.000,00         | Rockcliff Energy II LLC 5.5% 15-10-2029        | 594.500,00                 | 0,09                         |
| 623.000,00         | Mozart Debt Merger Sub Inc 5.25% 01-10-2029   | 629.230,00                 | 0,09                         | 2.665.000,00       | Rocket Mortgage LLC / Rocket 3.625% 01-03-2029 | 2.674.993,75               | 0,39                         |
| 540.000,00         | MSCI Inc 3.875% 15-02-2031                    | 562.950,00                 | 0,08                         | 1.615.000,00       | Royal Caribbean Cruises Ltd 4.25% 01-07-2026   | 1.554.437,50               | 0,22                         |
| 400.000,00         | MSCI Inc 4% 15-11-2029                        | 417.500,00                 | 0,06                         | 1.460.000,00       | SBA Communications Corp 3.125% 01-02-2029      | 1.401.600,00               | 0,20                         |
| 915.000,00         | Nabors Industries Inc 7.375% 15-05-2027       | 942.450,00                 | 0,14                         | 1.600.000,00       | SBA Communications Corp 3.875% 15-02-2027      | 1.648.000,00               | 0,24                         |
| 1.865.000,00       | NCR Corp 5.125% 15-04-2029                    | 1.925.612,50               | 0,28                         |                    |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 1.230.000,00       | Scientific Games Internation 7% 15-05-2028     | 1.312.520,70               | 0,19                         | 2.525.000,00       | WASH Multifamily Acquisition 5.75% 15-04-2026   | 2.653.648,75               | 0,38                         |
| 460.000,00         | Seagate HDD Cayman 4.125% 15-01-2031           | 478.584,00                 | 0,07                         | 2.570.000,00       | Waste Pro USA Inc 5.5% 15-02-2026   | 2.570.000,00               | 0,37                         |
| 1.750.000,00       | Sealed Air Corp 4% 01-12-2027                  | 1.823.727,50               | 0,26                         | 1.530.000,00       | Weekley Homes LLC / Weekley 4.875% 15-09-2028   | 1.575.900,00               | 0,23                         |
| 577.000,00         | Service Properties Trust 4.95% 15-02-2027      | 555.362,50                 | 0,08                         | 795.000,00         | WESCO Distribution Inc 7.125% 15-06-2025  | 845.244,00                 | 0,12                         |
| 2.268.000,00       | Service Properties Trust 7.5% 15-09-2025       | 2.458.215,71               | 0,35                         | 2.165.000,00       | WESCO Distribution Inc 7.25% 15-06-2028   | 2.362.556,25               | 0,34                         |
| 850.000,00         | Simmons Foods Inc/Simmons Pr 4.625% 01-03-2029 | 835.125,00                 | 0,12                         | 460.000,00         | White Cap Buyer LLC 6.875% 15-10-2028   | 479.550,00                 | 0,07                         |
| 1.830.000,00       | Sirius XM Radio Inc 4.125% 01-07-2030          | 1.830.000,02               | 0,26                         | 865.000,00         | White Cap Parent LLC 8.25% P-I-K 15-03-2026   | 884.462,50                 | 0,13                         |
| 2.370.000,00       | Sonic Automotive Inc 4.625% 15-11-2029         | 2.392.515,00               | 0,35                         | 1.713.000,00       | Williams Scotsman Internatio 4.625% 15-08-2028  | 1.760.107,50               | 0,25                         |
| 2.100.000,00       | Sotheby's 7.375% 15-10-2027                    | 2.236.500,00               | 0,32                         | 1.200.000,00       | WMG Acquisition Corp 3.75% 01-12-2029   | 1.197.000,00               | 0,17                         |
| 1.700.000,00       | Sotheby's/Bidfair Holdings I 5.875% 01-06-2029 | 1.734.000,00               | 0,25                         | 1.190.000,00       | Wynn Resorts Finance LLC / W 5.125% 01-10-2029  | 1.204.875,00               | 0,17                         |
| 880.000,00         | Spectrum Brands Inc 5% 01-10-2029              | 922.900,01                 | 0,13                         | 2.860.000,00       | XHR LP 4.875% 01-06-2029  | 2.910.050,00               | 0,42                         |
| 1.405.000,00       | Standard Industries Inc/NJ 4.375% 15-07-2030   | 1.431.343,75               | 0,21                         | 869.000,00         | XPO Logistics Inc 6.25% 01-05-2025  | 909.191,25                 | 0,13                         |
| 385.000,00         | Staples Inc 10.75% 15-04-2027                  | 362.381,25                 | 0,05                         | 650.000,00         | Yum! Brands Inc 4.75% 15-01-2030  | 703.625,00                 | 0,10                         |
| 1.854.000,00       | Staples Inc 7.5% 15-04-2026                    | 1.895.715,00               | 0,27                         | 1.250.000,00       | Yum! Brands Inc 7.75% 01-04-2025  | 1.318.750,18               | 0,19                         |
| 1.710.000,00       | Station Casinos LLC 4.5% 15-02-2028            | 1.727.100,00               | 0,25                         | 1.535.000,00       | ZoomInfo Technologies LLC/Zo 3.875% 01-02-2029  | 1.521.799,00               | 0,22                         |
| 600.000,00         | Station Casinos LLC 4.625% 01-12-2031          | 604.920,00                 | 0,09                         |                    |   | <b>455.735.517,37</b>      | <b>65,78</b>                 |
| 355.000,00         | Stericycle Inc 3.875% 15-01-2029               | 347.900,00                 | 0,05                         |                    |   | <b>457.121.435,73</b>      | <b>65,98</b>                 |
| 711.000,00         | Sunoco LP / Sunoco Finance C 6% 15-04-2027     | 737.662,51                 | 0,11                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>457.121.435,73</b>      | <b>65,98</b>                 |
| 510.000,00         | Syneos Health Inc 3.625% 15-01-2029            | 503.625,00                 | 0,07                         |                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>457.121.435,73</b>      | <b>65,98</b>                 |
| 770.000,00         | Tap Rock Resources LLC 7% 01-10-2026           | 800.800,00                 | 0,12                         |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
| 3.130.000,00       | Targa Resources Partners LP 5% 15-01-2028      | 3.286.500,00               | 0,47                         |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
| 655.000,00         | Targa Resources Partners LP 5.5% 01-03-2030    | 715.587,50                 | 0,10                         |                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 940.000,00         | TEGNA Inc 4.625% 15-03-2028                    | 950.142,60                 | 0,14                         | 2.050.000,00       | Darling Global Finance BV 3.625% 15-05-2026   | 2.354.648,53               | 0,34                         |
| 1.670.000,00       | Teleflex Inc 4.25% 01-06-2028                  | 1.720.417,30               | 0,25                         |                    |   | <b>2.354.648,53</b>        | <b>0,34</b>                  |
| 1.835.000,00       | Tenet Healthcare Corp 4.375% 15-01-2030        | 1.863.442,32               | 0,27                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>2.354.648,53</b>        | <b>0,34</b>                  |
| 4.400.000,00       | Tenet Healthcare Corp 6.125% 01-10-2028        | 4.647.324,00               | 0,67                         |                    | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                     | <b>2.354.648,53</b>        | <b>0,34</b>                  |
| 2.365.000,00       | Thor Industries Inc 4% 15-10-2029              | 2.341.350,00               | 0,34                         |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>657.596.064,21</b>      | <b>94,91</b>                 |
| 4.020.000,00       | Titan Acquisition Ltd / Tita 7.75% 15-04-2026  | 4.080.300,00               | 0,59                         |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>24.677.586,71</b>       | <b>3,56</b>                  |
| 1.750.000,00       | TopBuild Corp 3.625% 15-03-2029                | 1.763.125,00               | 0,25                         |                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>10.585.424,69</b>       | <b>1,53</b>                  |
| 315.000,00         | TopBuild Corp 4.125% 15-02-2032                | 322.481,25                 | 0,05                         |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>692.859.075,61</b>      | <b>100,00</b>                |
| 2.085.000,00       | TriMas Corp 4.125% 15-04-2029                  | 2.090.212,50               | 0,30                         |                    |   |                            |                              |
| 2.010.000,00       | TripAdvisor Inc 7% 15-07-2025                  | 2.120.550,00               | 0,31                         |                    |   |                            |                              |
| 625.000,00         | Triton Water Holdings Inc 6.25% 01-04-2029     | 603.125,00                 | 0,09                         |                    |   |                            |                              |
| 1.385.000,00       | Triumph Group Inc 6.25% 15-09-2024             | 1.393.656,25               | 0,20                         |                    |   |                            |                              |
| 841.000,00         | Triumph Group Inc 8.875% 01-06-2024            | 920.154,92                 | 0,13                         |                    |   |                            |                              |
| 2.205.000,00       | Uber Technologies Inc 6.25% 15-01-2028         | 2.359.350,00               | 0,34                         |                    |   |                            |                              |
| 2.300.000,00       | Uber Technologies Inc 7.5% 15-09-2027          | 2.495.707,00               | 0,36                         |                    |   |                            |                              |
| 565.000,00         | United Airlines Inc 4.375% 15-04-2026          | 586.893,75                 | 0,08                         |                    |   |                            |                              |
| 745.000,00         | Univision Communications Inc 4.5% 01-05-2029   | 752.450,00                 | 0,11                         |                    |   |                            |                              |
| 970.000,00         | Urban One Inc 7.375% 01-02-2028                | 999.100,00                 | 0,14                         |                    |   |                            |                              |
| 540.000,00         | US Foods Inc 4.625% 01-06-2030                 | 545.400,00                 | 0,08                         |                    |   |                            |                              |
| 1.035.000,00       | USA Compression Partners LP 6.875% 01-09-2027  | 1.093.218,75               | 0,16                         |                    |   |                            |                              |
| 730.000,00         | Venture Global Calcasieu Pas 3.875% 01-11-2033 | 771.062,50                 | 0,11                         |                    |   |                            |                              |
| 1.390.000,00       | Venture Global Calcasieu Pas 3.875% 15-08-2029 | 1.445.600,00               | 0,21                         |                    |   |                            |                              |
| 2.240.000,00       | Venture Global Calcasieu Pas 4.125% 15-08-2031 | 2.391.200,00               | 0,35                         |                    |   |                            |                              |
| 1.975.000,00       | Viavi Solutions Inc 3.75% 01-10-2029           | 1.974.901,25               | 0,29                         |                    |   |                            |                              |
| 825.000,00         | VICI Properties LP / VICI No 4.625% 01-12-2029 | 882.799,50                 | 0,13                         |                    |   |                            |                              |
| 3.405.000,00       | Victoria's Secret & Co 4.625% 15-07-2029       | 3.481.612,50               | 0,50                         |                    |   |                            |                              |
| 5.330.000,00       | Virgin Media Finance PLC 5% 15-07-2030         | 5.303.350,00               | 0,77                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| USA                    | 73,83        | Unternehmensanleihen | 94,91        |
| Kanada                 | 4,71         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich | 2,99         |                      |              |
| Niederlande            | 2,72         |                      |              |
| Frankreich             | 2,67         |                      |              |
| Luxemburg              | 2,67         |                      |              |
| Länderübergreifend     | 1,71         |                      |              |
| Deutschland            | 1,12         |                      |              |
| Italien                | 0,46         |                      |              |
| Dänemark               | 0,45         |                      |              |
| Jersey                 | 0,42         |                      |              |
| Panama                 | 0,34         |                      |              |
| Irland                 | 0,25         |                      |              |
| Liberia                | 0,22         |                      |              |
| Finnland               | 0,15         |                      |              |
| Schweden               | 0,11         |                      |              |
| Kaimaninseln           | 0,07         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>94,91</b> | <b>Summe</b>         | <b>94,91</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 334.427,60  | EUR               | 376.750,02         | USD                | 2.249,10   | 28.01.2022 |
| 3.278.557,16                                      | GBP               | 4.379.554,27       | USD                | 40.681,77  | 28.01.2022 |
| 509.760.706,57                                    | NOK               | 56.915.024,33      | USD                | 886.747,38   | 28.01.2022 |
| 14.181.919,95                                     | PLN               | 3.374.167,95       | USD                | 114.188,56   | 28.01.2022 |
| 162.009.294,10                                    | SEK               | 18.016.665,48      | USD                | (113.569,67)   | 28.01.2022 |
| 5.201,12  | USD               | 4.609,84           | EUR                | (23,10)  | 28.01.2022 |
| 59.389,33   | USD               | 44.537,40          | GBP                | (657,15)   | 28.01.2022 |
| 1.519.598,66                                      | USD               | 13.689.678,68      | NOK                | (32.673,79)  | 28.01.2022 |
| 133.816,17  | USD               | 553.412,66         | PLN                | (2.308,01)   | 28.01.2022 |
| 4.329.894,92                                      | USD               | 39.220.809,57      | SEK                | (4.261,98)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>890.373,11</b>  |            |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                   |                    |                    |  |            |
| 73.615.531,52                                     | EUR               | 83.092.000,00      | USD                | 387.268,71   | 28.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>387.268,71</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                   |                    |                    |  |            |
| 6.311.297,66                                      | GBP               | 8.444.000,00       | USD                | 63.581,81  | 28.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>63.581,81</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                   |                    |                    |  |            |
| 6.250.300,00                                      | CAD               | 4.936.400,88       | USD                | (20.991,13)  | 28.02.2022 |
| 2.135.677,14                                      | USD               | 1.900.000,00       | EUR                | (18.902,82)  | 28.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(39.893,95)</b>   |            |
|   |                   |                    |                    | <b>410.956,57</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>1.301.329,68</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.



# Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor                                   |              |
|------------------------|--------------|--|--------------|
| USA                    | 48,71        | Stromversorger                           | 25,23        |
| Frankreich             | 10,49        | Mehrsparten-Versorger                    | 22,60        |
| Australien             | 8,97         | Schienenverkehr                          | 12,28        |
| Spanien                | 7,26         | Straßen- und Schienennetze               | 9,58         |
| Italien                | 6,12         | Bau- und Ingenieurwesen                  | 7,90         |
| Vereinigtes Königreich | 3,92         | Immobilien: Spezialisierte REITs         | 7,44         |
| Kanada                 | 3,65         | Integrierte Telekommunikationsdienste    | 5,61         |
| Portugal               | 2,97         | Flughafendienste                         | 3,64         |
| Japan                  | 1,87         | Unabhängige Energieerzeuger und -händler | 3,24         |
| Deutschland            | 1,44         | Wasserversorger                          | 1,33         |
| Hongkong               | 1,33         | Internet-Dienste und -Infrastruktur      | 0,83         |
| Neuseeland             | 1,03         |  |              |
| Dänemark               | 0,98         |  |              |
| Mexiko                 | 0,92         |  |              |
| <b>Summe</b>           | <b>99,67</b> | <b>Summe</b>                             | <b>99,67</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 4.833.902,49                                      | CHF               | 5.201.056,83       | USD                | 103.334,64   | 28.01.2022 |
| 3.534.051,70                                      | EUR               | 3.981.988,67       | USD                | 23.073,71  | 28.01.2022 |
| 240.654,61  | USD               | 221.530,19         | CHF                | (2.437,46)   | 28.01.2022 |
| 155.930,39  | USD               | 137.861,58         | EUR                | (305,10)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>123.665,79</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Global Opportunity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |
| <b>CAD</b>  |   |                            |                              |
| 72.421,00   | Canada Goose Holdings   | 2.371.610,14               | 0,48                         |
| 54.629,00   | Descartes Systems Group   | 3.997.481,19               | 0,81                         |
|   |   | <b>6.369.091,33</b>        | <b>1,30</b>                  |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |
| 33.416,00   | ASML Holding  | 23.615.087,20              | 4,81                         |
| 99.742,00   | Dassault Systemes   | 5.217.504,02               | 1,06                         |
| 14.057,00   | LVMH Moet Hennessy Louis<br>Vuitton   | 10.219.439,00              | 2,08                         |
|   |   | <b>39.052.030,22</b>       | <b>7,95</b>                  |
| <b>GBP</b>  |   |                            |                              |
| 131.076,00  | Halma   | 4.993.027,57               | 1,02                         |
|   |   | <b>4.993.027,57</b>        | <b>1,02</b>                  |
| <b>HKD</b>  |   |                            |                              |
| 551.800,00  | AIA Group   | 4.909.739,58               | 1,00                         |
|   |   | <b>4.909.739,58</b>        | <b>1,00</b>                  |
| <b>JPY</b>  |   |                            |                              |
| 88.400,00   | Mercari   | 3.972.342,72               | 0,81                         |
| 257.200,00  | Nomura Research Institute   | 9.733.184,39               | 1,98                         |
|   |   | <b>13.705.527,11</b>       | <b>2,79</b>                  |
| <b>SEK</b>  |   |                            |                              |
| 178.605,00  | Atlas Copco A   | 10.902.590,18              | 2,22                         |
|   |   | <b>10.902.590,18</b>       | <b>2,22</b>                  |
| <b>TWD</b>  |   |                            |                              |
| 764.000,00  | Taiwan Semiconductor<br>Manufacturing   | 14.993.763,54              | 3,05                         |
|   |   | <b>14.993.763,54</b>       | <b>3,05</b>                  |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |
| 45.651,00   | Accenture   | 16.642.573,56              | 3,39                         |
| 138.118,00  | Airbnb  | 20.492.411,53              | 4,17                         |
| 1.058,00  | Alphabet  | 2.723.496,48               | 0,55                         |
| 7.292,00  | Alphabet  | 18.751.767,68              | 3,82                         |
| 6.962,00  | Amazon.com  | 20.702.092,34              | 4,22                         |
| 39.940,00   | Copart  | 5.336.264,69               | 1,09                         |
| 31.923,00   | Costco Wholesale  | 15.793.944,08              | 3,22                         |
| 75.926,00   | Cummins   | 14.604.686,04              | 2,97                         |
| 72.366,00   | Danaher   | 21.080.794,35              | 4,29                         |
| 191.770,00  | Dropbox   | 4.185.365,65               | 0,85                         |
| 42.722,00   | Estee Lauder Cos  | 13.891.392,22              | 2,83                         |
| 13.799,00   | Goldman Sachs Group   | 4.687.140,14               | 0,95                         |
| 125.465,00  | HDFC Bank ADR   | 7.195.697,18               | 1,47                         |
| 36.896,00   | Home Depot  | 13.387.646,75              | 2,73                         |
| 81.791,00   | IQVIA Holdings  | 20.445.403,13              | 4,16                         |
| 58.051,00   | Linde   | 17.638.504,10              | 3,59                         |
| 65.911,00   | Mastercard  | 21.044.501,01              | 4,29                         |
| 48.828,00   | Meta Platforms  | 14.719.315,18              | 3,00                         |
| 7.140,00  | Mettler-Toledo International  | 10.776.788,78              | 2,19                         |
| 65.864,00   | NVIDIA  | 17.296.823,22              | 3,52                         |
| 71.773,00   | PayPal Holdings   | 12.091.119,18              | 2,46                         |
| 33.982,00   | Roper Technologies  | 14.648.577,69              | 2,98                         |
| 42.793,00   | S&P Global  | 17.776.106,05              | 3,62                         |
| 76.230,00   | salesforce.com  | 17.160.078,68              | 3,50                         |
| 44.877,00   | Sherwin-Williams  | 13.851.586,29              | 2,82                         |
| 46.771,00   | Texas Instruments   | 7.811.477,58               | 1,59                         |
| 40.711,00   | UnitedHealth Group  | 18.126.486,06              | 3,69                         |
| 14.475,00   | Vail Resorts  | 4.176.682,56               | 0,85                         |
| 19.829,00   | VeriSign  | 4.438.481,77               | 0,90                         |
|   |   | <b>391.477.203,97</b>      | <b>79,74</b>                 |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>486.402.973,50</b>      | <b>99,07</b>                 |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>486.402.973,50</b>      | <b>99,07</b>                 |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>486.402.973,50</b>      | <b>99,07</b>                 |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>5.661.354,33</b>        | <b>1,15</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(1.091.635,30)</b>      | <b>(0,22)</b>                |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>490.972.692,53</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Global Opportunity Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 110.129,33  | EUR                | 1.124.229,14      | NOK                  | (2.356,45)  | 28.01.2022  |
| 11.465.283,02                                     | NOK                | 1.136.549,37      | EUR                  | 10.613,07   | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>8.256,62</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Global Portfolio Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung         | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|---|----------------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                      |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              | <b>Aktien</b>   |                      |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              | <b>USD</b>  |                      |                            |                              |
| 17.533,00   | ASML Holding  | 12.390.571,10              | 2,62                         | 86.188,00   | Tencent Holdings ADR | 4.470.148,82               | 0,94                         |
| 1.151.490,00  | ING Groep   | 14.096.540,58              | 2,98                         |   |                      | <b>4.470.148,82</b>        | <b>0,94</b>                  |
| 66.126,00   | Kerry Group   | 7.488.769,50               | 1,58                         |   |                      |                            |                              |
| 155.780,00  | Koninklijke Philips   | 5.104.131,70               | 1,08                         |   |                      |                            |                              |
|   |   | <b>39.080.012,88</b>       | <b>8,26</b>                  |   |                      |                            |                              |
| <b>GBP</b>  |   |                            |                              | <b>Summe Aktien</b>   |                      |                            |                              |
| 1.909.843,00  | Rotork  | 8.120.820,73               | 1,72                         |   |                      | <b>4.470.148,82</b>        | <b>0,94</b>                  |
|   |   | <b>8.120.820,73</b>        | <b>1,72</b>                  |   |                      |                            |                              |
| <b>JPY</b>  |   |                            |                              | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b> |                      |                            |                              |
| 183.400,00  | Nabtesco  | 4.788.652,00               | 1,01                         |   |                      | <b>4.470.148,82</b>        | <b>0,94</b>                  |
| 405.400,00  | Pan Pacific International Holdings  | 4.933.526,90               | 1,04                         |   |                      |                            |                              |
| 17.800,00   | Shimano   | 4.184.937,56               | 0,88                         |   |                      |                            |                              |
|   |   | <b>13.907.116,46</b>       | <b>2,94</b>                  |   |                      |                            |                              |
| <b>SEK</b>  |   |                            |                              | <b>Bankguthaben</b>   |                      |                            |                              |
| 482.474,00  | Epiroc A  | 10.786.711,03              | 2,28                         |   |                      | <b>2.756.153,85</b>        | <b>0,58</b>                  |
|   |   | <b>10.786.711,03</b>       | <b>2,28</b>                  |   |                      |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   |                      |                            |                              |
| 80.880,00   | AbbVie  | 9.670.753,02               | 2,04                         |   |                      | <b>4.281.664,47</b>        | <b>0,90</b>                  |
| 105.163,00  | Activision Blizzard   | 6.254.164,74               | 1,32                         |   |                      |                            |                              |
| 77.796,00   | Allegion  | 9.032.756,78               | 1,91                         |   |                      |                            |                              |
| 12.936,00   | Alphabet  | 33.299.764,09              | 7,04                         |   |                      |                            |                              |
| 7.050,00  | Amazon.com  | 20.963.767,74              | 4,43                         |   |                      |                            |                              |
| 13.242,00   | ANSYS   | 4.731.765,92               | 1,00                         |   |                      |                            |                              |
| 19.318,00   | Atlassian Corp  | 6.565.885,73               | 1,39                         |   |                      |                            |                              |
| 100.743,00  | Autoliv   | 9.158.616,27               | 1,94                         |   |                      |                            |                              |
| 80.096,00   | Chubb   | 13.692.657,48              | 2,89                         |   |                      |                            |                              |
| 23.199,00   | Cintas  | 9.008.622,42               | 1,90                         |   |                      |                            |                              |
| 132.482,00  | Cisco Systems   | 7.423.857,81               | 1,57                         |   |                      |                            |                              |
| 57.374,00   | Cognex  | 3.950.303,62               | 0,83                         |   |                      |                            |                              |
| 126.574,00  | Colgate-Palmolive   | 9.465.252,12               | 2,00                         |   |                      |                            |                              |
| 40.304,00   | Ecolab  | 8.309.530,83               | 1,76                         |   |                      |                            |                              |
| 30.413,00   | First Republic Bank/CA  | 5.542.354,07               | 1,17                         |   |                      |                            |                              |
| 43.265,00   | International Flavors & Fragrances  | 5.694.944,47               | 1,20                         |   |                      |                            |                              |
| 51.966,00   | Jones Lang LaSalle  | 12.459.635,93              | 2,63                         |   |                      |                            |                              |
| 70.789,00   | JPMorgan Chase  | 9.896.647,83               | 2,09                         |   |                      |                            |                              |
| 58.525,00   | Medtronic   | 5.395.471,25               | 1,14                         |   |                      |                            |                              |
| 168.456,00  | Merck   | 11.492.160,10              | 2,43                         |   |                      |                            |                              |
| 88.339,00   | Microsoft   | 26.313.346,45              | 5,56                         |   |                      |                            |                              |
| 172.301,00  | Mondelez International  | 10.008.867,98              | 2,12                         |   |                      |                            |                              |
| 53.291,00   | NIKE  | 7.846.972,14               | 1,66                         |   |                      |                            |                              |
| 27.757,00   | PayPal Holdings   | 4.676.036,88               | 0,99                         |   |                      |                            |                              |
| 69.521,00   | Progressive   | 6.325.726,63               | 1,34                         |   |                      |                            |                              |
| 19.765,00   | S&P Global  | 8.210.331,97               | 1,74                         |   |                      |                            |                              |
| 35.952,00   | salesforce.com  | 8.093.128,02               | 1,71                         |   |                      |                            |                              |
| 7.506,00  | Samsung Electronics GDR   | 10.927.818,84              | 2,31                         |   |                      |                            |                              |
| 46.744,00   | Stryker   | 11.146.090,61              | 2,36                         |   |                      |                            |                              |
| 80.795,00   | Taiwan Semiconductor<br>Manufacturing ADR   | 8.620.558,65               | 1,82                         |   |                      |                            |                              |
| 53.874,00   | Texas Instruments   | 8.997.788,01               | 1,90                         |   |                      |                            |                              |
| 22.827,00   | Thermo Fisher Scientific  | 13.452.945,80              | 2,84                         |   |                      |                            |                              |
| 134.062,00  | TJX Cos   | 8.948.119,20               | 1,89                         |   |                      |                            |                              |
| 23.253,00   | United Rentals  | 6.711.374,42               | 1,42                         |   |                      |                            |                              |
| 190.939,00  | US Foods Holding  | 5.886.716,89               | 1,24                         |   |                      |                            |                              |
| 54.653,00   | Verisk Analytics  | 11.020.349,34              | 2,33                         |   |                      |                            |                              |
| 52.333,00   | Visa  | 10.029.047,80              | 2,12                         |   |                      |                            |                              |
| 151.825,00  | Wells Fargo   | 6.450.199,98               | 1,36                         |   |                      |                            |                              |
| 233.237,00  | Westrock  | 9.134.678,26               | 1,93                         |   |                      |                            |                              |
| 84.311,00   | Xcel Energy   | 4.996.207,41               | 1,06                         |   |                      |                            |                              |
|   |   | <b>389.805.217,50</b>      | <b>82,38</b>                 |   |                      |                            |                              |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>461.699.878,60</b>      | <b>97,57</b>                 |   |                      |                            |                              |
|   | <b>Summe übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an<br/>einer amtlichen Börse notiert<br/>sind</b> | <b>461.699.878,60</b>      | <b>97,57</b>                 |   |                      |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Global Portfolio Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| USA                    | 70,91        | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 7,98         |
| Niederlande            | 6,68         | Verschiedene Banken                                 | 6,43         |
| Irland                 | 4,63         | Systemssoftware                                     | 5,56         |
| Vereinigtes Königreich | 3,10         | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 4,57         |
| Japan                  | 2,94         | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 4,43         |
| Schweiz                | 2,89         | Sach- und Unfallversicherung                        | 4,23         |
| Republik Korea         | 2,31         | Anwendungssoftware                                  | 4,10         |
| Schweden               | 2,28         | Halbleiter  | 3,72         |
| Taiwan, Provinz Chinas | 1,82         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 3,70         |
| Kaimaninseln           | 0,94         | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 3,11         |
|                        |              | Spezialchemikalien                                  | 2,96         |
|                        |              | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen      | 2,84         |
|                        |              | Industriemaschinen                                  | 2,73         |
|                        |              | Immobiliendienste                                   | 2,63         |
|                        |              | Halbleiter-Ausrüstung                               | 2,62         |
|                        |              | Pharmazeutika                                       | 2,43         |
|                        |              | Forschungs- und Beratungsleistungen                 | 2,33         |
|                        |              | Hardware-Technologie, Speicherung und Peripherie    | 2,31         |
|                        |              | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 2,28         |
|                        |              | Biotechnologie                                      | 2,04         |
|                        |              | Haushaltsprodukte                                   | 2,00         |
|                        |              | Autoteile und -zubehör                              | 1,94         |
|                        |              | Papierverpackungen                                  | 1,93         |
|                        |              | Bauprodukte   | 1,91         |
|                        |              | Verschiedene Support-Leistungen                     | 1,90         |
|                        |              | Bekleidung-Einzelhandel                             | 1,89         |
|                        |              | Börsen und Finanzdaten                              | 1,74         |
|                        |              | Schuhe  | 1,66         |
|                        |              | Kommunikationsanlagen                               | 1,57         |
|                        |              | Handelsgesellschaften und Großhändler               | 1,42         |
|                        |              | Interaktives Home Entertainment                     | 1,32         |
|                        |              | Lebensmittelvertriebsunternehmen                    | 1,24         |
|                        |              | Regionale Banken                                    | 1,17         |
|                        |              | Stromversorger                                      | 1,06         |
|                        |              | Warenhäuser   | 1,04         |
|                        |              | Freizeitartikel                                     | 0,88         |
|                        |              | Hersteller von Elektronikausrüstung                 | 0,83         |
|                        |              | <b>Summe</b>  | <b>98,51</b> |
| <b>Summe</b>           | <b>98,51</b> |   |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Global Real Estate Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>AUD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 7.851.187,00  | National Storage REIT                          | 15.135.793,09              | 1,31                         | 252.175,00         | Simon Property Group  | 40.312.695,50              | 3,48                         |
| 1.102.545,00  | NEXTDC   | 10.220.098,76              | 0,88                         | 422.800,00         | Spirit Realty Capital   | 20.336.680,00              | 1,76                         |
| 7.915.000,00  | Scentre  | 18.127.012,15              | 1,57                         | 179.336,00         | Sun Communities   | 37.664.146,72              | 3,25                         |
|   |  | <b>43.482.904,00</b>       | <b>3,76</b>                  | 321.310,00         | VICI Properties   | 9.658.578,60               | 0,83                         |
| <b>CAD</b>  |  |                            |                              | 334.975,00         | Welltower   | 28.807.850,00              | 2,49                         |
| 293.000,00  | Allied Properties Real Estate Investment Trust | 10.132.691,04              | 0,88                         |                    |   | <b>690.526.804,29</b>      | <b>59,66</b>                 |
| 352.576,00  | Boardwalk Real Estate Investment Trust         | 15.182.300,56              | 1,31                         |                    | <b>Summe Aktien</b>   | <b>1.132.611.703,87</b>    | <b>97,86</b>                 |
| 250.700,00  | Granite Real Estate Investment Trust           | 20.703.527,51              | 1,79                         |                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>1.132.611.703,87</b>    | <b>97,86</b>                 |
|   |  | <b>46.018.519,11</b>       | <b>3,98</b>                  |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>1.132.611.703,87</b>    | <b>97,86</b>                 |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>32.992.463,10</b>       | <b>2,85</b>                  |
| 2.380.800,00  | Aroundtown                                     | 14.345.981,80              | 1,24                         |                    | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(8.214.591,49)</b>      | <b>(0,71)</b>                |
| 68.800,00   | Gecina   | 9.577.144,73               | 0,83                         |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>1.157.389.575,48</b>    | <b>100,00</b>                |
| 911.030,00  | Inmobiliaria Colonial Socimi                   | 8.512.994,57               | 0,74                         |                    |   |                            |                              |
| 4.625.000,00  | Irish Residential Properties REIT              | 8.779.736,48               | 0,76                         |                    |   |                            |                              |
| 713.485,00  | Klepierre                                      | 16.849.485,17              | 1,46                         |                    |   |                            |                              |
| 1.593.412,00  | Merlin Properties Socimi                       | 17.271.726,43              | 1,49                         |                    |   |                            |                              |
| 589.091,00  | Vonovia  | 32.360.845,18              | 2,80                         |                    |   |                            |                              |
| 311.110,00  | Warehouses De Pauw CVA                         | 14.863.335,32              | 1,28                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>122.561.249,68</b>      | <b>10,59</b>                 |                    |   |                            |                              |
| <b>GBP</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 245.000,00  | Derwent London                                 | 11.280.889,03              | 0,97                         |                    |   |                            |                              |
| 714.692,00  | Safestore Holdings                             | 13.629.430,30              | 1,18                         |                    |   |                            |                              |
| 447.196,00  | Segro  | 8.661.439,48               | 0,75                         |                    |   |                            |                              |
| 1.495.439,00  | UNITE Group                                    | 22.391.015,99              | 1,93                         |                    |   |                            |                              |
| 1.228.600,00  | Workspace Group                                | 13.513.172,55              | 1,17                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>69.475.947,35</b>       | <b>6,00</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>HKD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.360.000,00  | Link REIT                                      | 11.970.971,49              | 1,03                         |                    |   |                            |                              |
| 6.198.800,00  | Swire Properties                               | 15.530.381,72              | 1,34                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>27.501.353,21</b>       | <b>2,38</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>JPY</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.315,00  | Kenedix Office Investment                      | 8.120.601,11               | 0,70                         |                    |   |                            |                              |
| 5.020,00  | Kenedix Residential Next Investment            | 9.692.504,35               | 0,84                         |                    |   |                            |                              |
| 2.051.596,00  | Mitsubishi Estate                              | 28.412.483,19              | 2,45                         |                    |   |                            |                              |
| 3.847,00  | Mitsui Fudosan Logistics Park                  | 21.551.362,18              | 1,86                         |                    |   |                            |                              |
| 4.655,00  | Nippon Prologis REIT                           | 16.455.342,23              | 1,42                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>84.232.293,06</b>       | <b>7,28</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>SEK</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 646.648,00  | Castellum                                      | 17.417.983,89              | 1,50                         |                    |   |                            |                              |
| 231.785,00  | Catena   | 14.443.108,56              | 1,25                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>31.861.092,45</b>       | <b>2,75</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>SGD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 9.320.000,00  | Ascendas India Trust                           | 9.806.164,73               | 0,85                         |                    |   |                            |                              |
| 3.558.450,00  | Mapletree Industrial Trust                     | 7.145.375,99               | 0,62                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>16.951.540,72</b>       | <b>1,46</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 78.900,00   | Alexandria Real Estate Equities                | 17.649.930,00              | 1,52                         |                    |   |                            |                              |
| 463.285,00  | American Homes 4 Rent                          | 20.236.288,80              | 1,75                         |                    |   |                            |                              |
| 314.687,00  | Apartment Income REIT                          | 17.188.203,94              | 1,49                         |                    |   |                            |                              |
| 132.900,00  | AvalonBay Communities                          | 33.549.276,00              | 2,90                         |                    |   |                            |                              |
| 91.275,00   | Boston Properties                              | 10.556.866,50              | 0,91                         |                    |   |                            |                              |
| 905.000,00  | Brixmor Property Group                         | 22.996.050,00              | 1,99                         |                    |   |                            |                              |
| 468.000,00  | Cousins Properties                             | 18.939.960,00              | 1,64                         |                    |   |                            |                              |
| 486.100,00  | CubeSmart                                      | 27.717.422,00              | 2,39                         |                    |   |                            |                              |
| 70.483,00   | CyrusOne                                       | 6.315.276,80               | 0,55                         |                    |   |                            |                              |
| 393.310,00  | Douglas Emmett                                 | 13.305.677,30              | 1,15                         |                    |   |                            |                              |
| 522.340,00  | Duke Realty                                    | 34.119.248,80              | 2,95                         |                    |   |                            |                              |
| 40.726,00   | Equinix  | 34.521.801,16              | 2,98                         |                    |   |                            |                              |
| 221.900,00  | Equity Residential                             | 20.048.665,00              | 1,73                         |                    |   |                            |                              |
| 130.168,00  | Extra Space Storage                            | 29.492.163,76              | 2,55                         |                    |   |                            |                              |
| 439.070,00  | Healthcare Trust of America                    | 14.752.752,00              | 1,27                         |                    |   |                            |                              |
| 461.400,00  | Healthpeak Properties                          | 16.596.558,00              | 1,43                         |                    |   |                            |                              |
| 906.695,00  | Host Hotels & Resorts                          | 15.912.497,25              | 1,37                         |                    |   |                            |                              |
| 466.684,00  | Invitation Homes                               | 21.159.452,56              | 1,83                         |                    |   |                            |                              |
| 550.600,00  | Kimco Realty                                   | 13.605.326,00              | 1,18                         |                    |   |                            |                              |
| 152.700,00  | Mid-America Apartment Communities              | 34.989.678,00              | 3,02                         |                    |   |                            |                              |
| 421.947,00  | Prologis                                       | 71.064.313,74              | 6,14                         |                    |   |                            |                              |
| 213.861,00  | Regency Centers                                | 16.095.178,86              | 1,39                         |                    |   |                            |                              |
| 135.700,00  | Rexford Industrial Realty                      | 10.965.917,00              | 0,95                         |                    |   |                            |                              |
| 537.500,00  | RLJ Lodging Trust                              | 7.503.500,00               | 0,65                         |                    |   |                            |                              |
| 140.500,00  | Ryman Hospitality Properties                   | 12.751.780,00              | 1,10                         |                    |   |                            |                              |
| 30.200,00   | SBA Communications                             | 11.713.070,00              | 1,01                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Real Estate Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor                                 |              |
|------------------------|--------------|--|--------------|
| USA                    | 59,66        | Immobilien: REITs (Wohnimmobilien)     | 20,81        |
| Japan                  | 7,28         | Immobilien: REITs (Gewerbe)            | 17,76        |
| Vereinigtes Königreich | 6,00         | Immobilien: REITs (Einzelhandel)       | 13,85        |
| Kanada                 | 3,98         | Immobilien: Spezialisierte REITs       | 12,80        |
| Australien             | 3,76         | Immobilien: REITs (Bürogebäude)        | 9,68         |
| Deutschland            | 2,80         | Immobilien: REOC                       | 8,98         |
| Schweden               | 2,75         | Immobilien: REITs (Gesundheitswesen)   | 5,20         |
| Hongkong               | 2,38         | Immobilien: REITs (Hotels und Resorts) | 3,12         |
| Frankreich             | 2,28         | Verschiedene Immobilienaktivitäten     | 2,45         |
| Spanien                | 2,23         | Immobilien: Verschiedene REITs         | 2,32         |
| Singapur               | 1,46         | Internet-Dienste und -Infrastruktur    | 0,88         |
| Belgien                | 1,28         |  |              |
| Luxemburg              | 1,24         |  |              |
| Irland                 | 0,76         |  |              |
| <b>Summe</b>           | <b>97,86</b> | <b>Summe</b>                           | <b>97,86</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Global Small Cap Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                             | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>AUD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.157.339,00  | Omni Bridgeway                           | 3.086.715,70               | 1,14                         | 33.260,00          | Chase   | 3.284.092,40               | 1,21                         |
|   |  | <b>3.086.715,70</b>        | <b>1,14</b>                  | 29.400,00          | Curtiss-Wright  | 4.044.264,00               | 1,49                         |
| <b>CAD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 122.850,00  | CAE                                      | 3.074.511,00               | 1,13                         | 49.151,00          | Donaldson   | 2.878.774,07               | 1,06                         |
| 61.601,00   | Calian Group                             | 2.936.034,14               | 1,08                         | 174.850,00         | Eastern Bankshares  | 3.535.467,00               | 1,30                         |
| 71.800,00   | Canada Goose Holdings                    | 2.663.170,40               | 0,98                         | 100.393,00         | Envista Holdings  | 4.580.932,59               | 1,69                         |
| 166.035,00  | Hardwoods Distribution                   | 5.801.985,97               | 2,14                         | 93.707,00          | Equity Commonwealth   | 2.444.815,63               | 0,90                         |
| 106.366,00  | Richelieu Hardware                       | 3.644.946,03               | 1,34                         | 98.174,00          | EVl Industries  | 3.269.194,20               | 1,20                         |
|   |  | <b>18.120.647,54</b>       | <b>6,68</b>                  | 94.644,00          | First Mid Bancshares  | 4.036.566,60               | 1,49                         |
| <b>CHF</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 3.613,00  | Siegfried Holding                        | 3.524.056,70               | 1,30                         | 408.746,00         | Garrett Motion  | 3.171.868,96               | 1,17                         |
|   |  | <b>3.524.056,70</b>        | <b>1,30</b>                  | 253.936,00         | GrafTech International  | 2.996.444,80               | 1,10                         |
| <b>DKK</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 35.668,00   | Schouw & Co.                             | 3.091.219,34               | 1,14                         | 243.871,00         | Green Brick Partners  | 7.311.252,58               | 2,69                         |
|   |  | <b>3.091.219,34</b>        | <b>1,14</b>                  | 118.716,00         | Hawkins   | 4.748.640,00               | 1,75                         |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 264.235,00  | Esprinet                                 | 3.860.786,47               | 1,42                         | 29.300,00          | Insperty  | 3.418.724,00               | 1,26                         |
| 88.791,00   | Fluidra                                  | 3.540.033,24               | 1,30                         | 40.979,00          | Inter Parfums   | 4.321.235,55               | 1,59                         |
| 198.086,00  | GVS                                      | 2.367.020,24               | 0,87                         | 174.815,00         | Legacy Housing  | 4.555.678,90               | 1,68                         |
| 71.592,00   | Huhtamäki                                | 3.153.538,72               | 1,16                         | 118.445,00         | Napco Security Technologies   | 5.777.747,10               | 2,13                         |
| 254.137,00  | Marel HF                                 | 1.709.818,74               | 0,63                         | 236.644,00         | Park Aerospace  | 3.140.265,88               | 1,16                         |
| 143.755,00  | PATRIZIA                                 | 3.337.894,07               | 1,23                         | 333.944,00         | PLx Pharma  | 2.714.964,72               | 1,00                         |
| 300.556,00  | Sarantis                                 | 3.029.780,31               | 1,12                         | 90.390,00          | Progyny   | 4.627.968,00               | 1,71                         |
| 29.814,00   | Vidrala                                  | 2.924.380,43               | 1,08                         | 54.350,00          | Silk Road Medical   | 2.370.747,00               | 0,87                         |
|   |  | <b>23.923.252,22</b>       | <b>8,82</b>                  | 44.128,00          | Skyline Champion  | 3.442.866,56               | 1,27                         |
| <b>GBP</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 161.543,00  | Hill & Smith Holdings                    | 3.911.839,35               | 1,44                         | 35.050,00          | TD SYNEX  | 3.987.288,00               | 1,47                         |
| 326.167,00  | Marshalls                                | 3.045.413,95               | 1,12                         | 68.400,00          | Triton International  | 4.078.008,00               | 1,50                         |
| 270.246,00  | Renalytix                                | 2.189.151,07               | 0,81                         | 85.093,00          | UFP Technologies  | 6.066.279,97               | 2,24                         |
|   |  | <b>9.146.404,37</b>        | <b>3,37</b>                  | 80.637,00          | Vericel   | 3.252.090,21               | 1,20                         |
| <b>HKD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.980.224,00  | Nissin Foods                             | 1.515.788,46               | 0,56                         | 56.121,00          | VSE   | 3.392.514,45               | 1,25                         |
| 1.213.800,00  | SITC International Holdings              | 4.388.804,02               | 1,62                         | 295.060,00         | Whole Earth Brands  | 3.142.389,00               | 1,16                         |
|   |  | <b>5.904.592,48</b>        | <b>2,18</b>                  |                    |   | <b>133.951.467,70</b>      | <b>49,37</b>                 |
| <b>JPY</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 155.778,00  | Ai Holdings                              | 2.603.178,90               | 0,96                         |                    | <b>Summe Aktien</b>   | <b>266.104.713,17</b>      | <b>98,08</b>                 |
| 81.095,00   | Argo Graphics                            | 2.271.520,30               | 0,84                         |                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>266.104.713,17</b>      | <b>98,08</b>                 |
| 189.550,00  | Asahi Holdings                           | 3.374.974,33               | 1,24                         |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>266.104.713,17</b>      | <b>98,08</b>                 |
| 222.856,00  | Digital Information Technologies         | 2.591.777,60               | 0,96                         |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>6.394.570,30</b>        | <b>2,36</b>                  |
| 72.478,00   | Fukushima Galilei                        | 3.002.737,75               | 1,11                         |                    | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(1.178.971,31)</b>      | <b>(0,43)</b>                |
| 148.000,00  | FULLCAST Holdings                        | 3.164.773,17               | 1,17                         |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>271.320.312,16</b>      | <b>100,00</b>                |
| 95.512,00   | Hosokawa Micron                          | 2.828.818,89               | 1,04                         |                    |   |                            |                              |
| 42.573,00   | Kusuri no Aoki Holdings                  | 2.695.594,79               | 0,99                         |                    |   |                            |                              |
| 111.867,00  | UT Group                                 | 4.202.240,73               | 1,55                         |                    |   |                            |                              |
| 286.764,00  | Yamazen                                  | 2.679.968,72               | 0,99                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>29.415.585,18</b>       | <b>10,84</b>                 |                    |   |                            |                              |
| <b>MXN</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.576.228,00  | Becele                                   | 3.948.666,27               | 1,46                         |                    |   |                            |                              |
| 975.803,00  | Grupo Herdez                             | 1.908.453,38               | 0,70                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>5.857.119,65</b>        | <b>2,16</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>NOK</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 2.069.398,00  | Kitron                                   | 5.540.462,50               | 2,04                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>5.540.462,50</b>        | <b>2,04</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>SEK</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 325.479,00  | Arjo B                                   | 3.984.363,73               | 1,47                         |                    |   |                            |                              |
| 322.566,00  | Embracer B                               | 3.439.435,34               | 1,27                         |                    |   |                            |                              |
| 27.157,00   | MIPS                                     | 3.561.465,62               | 1,31                         |                    |   |                            |                              |
| 145.832,00  | Paradox Interactive                      | 2.875.989,50               | 1,06                         |                    |   |                            |                              |
| 285.730,00  | Sedana Medical                           | 3.095.278,16               | 1,14                         |                    |   |                            |                              |
| 102.303,00  | SAAB B                                   | 2.603.026,28               | 0,96                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>19.559.558,63</b>       | <b>7,21</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>SGD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.944.840,00  | Riverstone Holdings                      | 1.008.734,43               | 0,37                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>1.008.734,43</b>        | <b>0,37</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>TWD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 685.193,00  | Micro-Star International                 | 3.974.896,73               | 1,47                         |                    |   |                            |                              |
|   |  | <b>3.974.896,73</b>        | <b>1,47</b>                  |                    |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 449.350,00  | Amyris                                   | 2.502.879,50               | 0,92                         |                    |   |                            |                              |
| 397.162,00  | Athersys                                 | 363.403,23                 | 0,13                         |                    |   |                            |                              |
| 51.500,00   | Axcelis Technologies                     | 3.820.270,00               | 1,41                         |                    |   |                            |                              |
| 238.984,00  | Blue Foundry Bancorp                     | 3.513.064,80               | 1,29                         |                    |   |                            |                              |
| 204.293,00  | Bridgewater Bancshares                   | 3.536.311,83               | 1,30                         |                    |   |                            |                              |
| 19.571,00   | Carlisle Cos                             | 4.808.790,41               | 1,77                         |                    |   |                            |                              |
| 77.801,00   | Castle Biosciences                       | 3.459.032,46               | 1,27                         |                    |   |                            |                              |
| 101.674,00  | CBIZ                                     | 3.997.821,68               | 1,47                         |                    |   |                            |                              |
| 8.902,00  | Charles River Laboratories International | 3.358.813,62               | 1,24                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Small Cap Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| USA                    | 47,87        | Handelsgesellschaften und Großhändler             | 7,18         |
| Japan                  | 10,84        | Hausbau   | 5,64         |
| Schweden               | 7,21         | Industriemaschinen                                | 5,15         |
| Kanada                 | 6,68         | Luftfahrt und Verteidigung                        | 4,74         |
| Vereinigtes Königreich | 3,37         | Gesundheitswesen: Ausstattung                     | 4,03         |
| Spanien                | 2,38         | Personalwesen und Personaldienstleistungen        | 3,98         |
| Italien                | 2,30         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch               | 3,56         |
| Mexiko                 | 2,16         | Papierverpackungen                                | 3,40         |
| Norwegen               | 2,04         | Hersteller von Elektronikausrüstung               | 3,09         |
| Kaimaninseln           | 1,62         | Technologievertrieb                               | 2,89         |
| Bermuda                | 1,50         | Regionale Banken                                  | 2,79         |
| Taiwan, Provinz Chinas | 1,47         | Produkte für den persönlichen Gebrauch            | 2,71         |
| Schweiz                | 1,30         | Forschungs- und Beratungsleistungen               | 2,61         |
| Deutschland            | 1,23         | Bausparkassen und Hypothekenfinanzierung          | 2,60         |
| Finnland               | 1,16         | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen    | 2,54         |
| Australien             | 1,14         | Gesundheitswesen: Produkte                        | 2,39         |
| Dänemark               | 1,14         | Verschiedene Support-Leistungen                   | 2,33         |
| Griechenland           | 1,12         | Interaktives Home Entertainment                   | 2,33         |
| Island                 | 0,63         | Spezialchemikalien                                | 2,13         |
| Hongkong               | 0,56         | Dienste für die Herstellung elektronischer Geräte | 2,04         |
| Singapur               | 0,37         | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen         | 1,79         |
| <b>Summe</b>           | <b>98,08</b> | Bauprodukte                                       | 1,77         |
|                        |              | Rohstoffchemikalien                               | 1,75         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Managed Health Care             | 1,71         |
|                        |              | Schifffahrt                                       | 1,62         |
|                        |              | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie  | 1,47         |
|                        |              | Brennereien und Winzereien                        | 1,46         |
|                        |              | Stahl   | 1,44         |
|                        |              | Halbleiter-Ausrüstung                             | 1,41         |
|                        |              | Biotechnologie                                    | 1,33         |
|                        |              | Freizeitartikel                                   | 1,31         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                | 1,27         |
|                        |              | Edelmetalle und Mineralien                        | 1,24         |
|                        |              | Verschiedene Immobilienaktivitäten                | 1,23         |
|                        |              | Autoteile und -zubehör                            | 1,17         |
|                        |              | Baumaterialien                                    | 1,12         |
|                        |              | Elektrische Komponenten und Ausrüstung            | 1,10         |
|                        |              | Metall- und Glasverpackungen                      | 1,08         |
|                        |              | Pharmazeutika                                     | 1,00         |
|                        |              | Arzneimittel-Einzelhandel                         | 0,99         |
|                        |              | Bekleidung, Accessoires und Luxusgüter            | 0,98         |
|                        |              | Immobilien: REITs (Bürogebäude)                   | 0,90         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Technologie                     | 0,81         |
|                        |              | <b>Summe</b>                                      | <b>98,08</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - Global Social Empowerment Fund (vormals Nordea 1 - Global Impact Fund)

Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| USA                    | 52,55        | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen      | 7,56         |
| Frankreich             | 8,93         | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 6,17         |
| Indien                 | 4,17         | Anwendungssoftware                                  | 5,78         |
| Kaimaninseln           | 3,85         | Lebens- und Krankenversicherung                     | 5,71         |
| Niederlande            | 3,26         | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 5,64         |
| Vereinigtes Königreich | 3,21         | Halbleiter  | 4,78         |
| Taiwan, Provinz Chinas | 2,81         | Biotechnologie                                      | 3,99         |
| Japan                  | 2,63         | Personalwesen und Personaldienstleistungen          | 3,57         |
| China                  | 2,39         | Industriemaschinen                                  | 3,53         |
| Hongkong               | 1,74         | Forschungs- und Beratungsleistungen                 | 3,22         |
| Schweden               | 1,57         | Kommunikationsanlagen                               | 2,96         |
| Kanada                 | 1,50         | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 2,85         |
| Schweiz                | 1,42         | Autoteile und -zubehör                              | 2,77         |
| Kenia                  | 1,34         | Landwirtschafts- und Landmaschinen                  | 2,60         |
| Australien             | 1,26         | Bau- und Ingenieurwesen                             | 2,58         |
| Brasilien              | 1,15         | Verschiedene Banken                                 | 2,54         |
| Deutschland            | 1,03         | Börsen und Finanzdaten                              | 2,39         |
| Irland                 | 0,99         | Vermögensverwaltung und Depotbanken                 | 2,36         |
| Indonesien             | 0,97         | Branchenübergreifende Holdings                      | 2,19         |
| Neuseeland             | 0,90         | Bildungsdienstleistungen                            | 2,14         |
| Norwegen               | 0,61         | Haushaltsprodukte                                   | 1,76         |
| <b>Summe</b>           | <b>98,30</b> | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 1,75         |
|                        |              | Spezialchemikalien                                  | 1,74         |
|                        |              | Mehrsparversicherungen                              | 1,65         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 1,41         |
|                        |              | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 1,40         |
|                        |              | Drahtlose Telekommunikationsdienste                 | 1,34         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Managed Health Care               | 1,32         |
|                        |              | Immobilien: REITs (Wohnimmobilien)                  | 1,26         |
|                        |              | Immobilien: Spezialisierte REITs                    | 1,20         |
|                        |              | Investmentbanken und Broker                         | 1,16         |
|                        |              | Wasserversorger                                     | 1,15         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Technologie                       | 1,06         |
|                        |              | Immobilien: REOC                                    | 1,03         |
|                        |              | Bauprodukte   | 0,99         |
|                        |              | Lebensmitteleinzelhandel                            | 0,83         |
|                        |              | Bausparkassen und Hypothekenfinanzierung            | 0,71         |
|                        |              | Arzneimittel-Einzelhandel                           | 0,61         |
|                        |              | Interaktives Home Entertainment                     | 0,61         |
|                        |              | <b>Summe</b>  | <b>98,30</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Global Stable Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|---|---------------------------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| <b>CAD</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 584.300,00  | Alimentation Couche-Tard                           | 21.686.455,72              | 0,84                         | 75.480,00   | Dollar General                  | 15.712.421,68              | 0,61                         |
| 207.657,00  | Bank of Nova Scotia/The                            | 12.947.309,54              | 0,50                         | 903.406,00  | eBay                            | 52.817.326,96              | 2,05                         |
| 408.200,00  | CGI  | 31.831.546,63              | 1,24                         | 135.396,00  | Edison International            | 8.120.293,37               | 0,32                         |
| 338.300,00  | Hydro One  | 7.708.668,86               | 0,30                         | 128.247,00  | FedEx                           | 29.091.512,60              | 1,13                         |
| 250.400,00  | Metro Inc/CN                                       | 11.717.494,68              | 0,46                         | 382.426,00  | Fiserv                          | 35.212.296,46              | 1,37                         |
| 265.100,00  | Open Text  | 11.151.774,54              | 0,43                         | 285.131,00  | Genpact                         | 13.400.011,61              | 0,52                         |
| 513.200,00  | Rogers Communications                              | 21.399.550,12              | 0,83                         | 181.199,00  | Global Payments                 | 21.926.574,82              | 0,85                         |
| 329.400,00  | Royal Bank of Canada                               | 30.693.663,79              | 1,19                         | 170.374,00  | Grand Canyon Education          | 12.969.272,32              | 0,50                         |
|   |  | <b>149.136.463,88</b>      | <b>5,80</b>                  | 495.355,00  | Infosys ADR                     | 11.143.464,81              | 0,43                         |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 49.748,00   | Air Liquide  | 7.627.363,36               | 0,30                         | 145.670,00  | International Business Machines | 17.296.745,09              | 0,67                         |
| 101.977,00  | Allianz  | 21.175.524,05              | 0,82                         | 568.917,00  | Johnson & Johnson               | 86.433.794,61              | 3,36                         |
| 99.581,00   | Atos   | 3.723.333,59               | 0,14                         | 277.040,00  | Kellogg                         | 15.639.374,58              | 0,61                         |
| 65.474,00   | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA       | 9.438.077,10               | 0,37                         | 64.233,00   | Kyndryl Holdings                | 1.054.245,77               | 0,04                         |
| 305.663,00  | Deutsche Post                                      | 17.282.186,02              | 0,67                         | 372.803,00  | LKQ                             | 19.531.302,74              | 0,76                         |
| 4.340.106,00  | EDP - Energias de Portugal                         | 20.971.392,19              | 0,82                         | 7.480,00  | Lowe's Cos                      | 1.694.647,77               | 0,07                         |
| 803.713,00  | Endesa   | 16.235.002,60              | 0,63                         | 138.386,00  | McKesson                        | 30.517.860,87              | 1,19                         |
| 679.767,00  | Fresenius  | 24.063.751,80              | 0,94                         | 564.834,00  | Medtronic                       | 52.072.543,45              | 2,02                         |
| 3.091.607,00  | Iberdrola  | 32.183.628,87              | 1,25                         | 480.297,00  | Merck                           | 32.766.123,01              | 1,27                         |
| 138.592,00  | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in M | 36.103.216,00              | 1,40                         | 769.196,00  | Mondelez International          | 44.682.162,07              | 1,74                         |
| 473.795,00  | Red Electrica Corp                                 | 9.013.949,88               | 0,35                         | 278.978,00  | Oracle                          | 21.605.924,32              | 0,84                         |
| 523.224,00  | Sanofi   | 46.347.181,92              | 1,80                         | 62.649,00   | Organon                         | 1.697.521,58               | 0,07                         |
| 163.725,00  | Siemens  | 24.997.533,00              | 0,97                         | 256.197,00  | PepsiCo                         | 38.948.096,48              | 1,51                         |
| 546.078,00  | Unilever   | 25.695.700,29              | 1,00                         | 1.011.281,00  | Pfizer                          | 52.963.571,26              | 2,06                         |
| 507.224,00  | Vinci  | 47.126.181,84              | 1,83                         | 677.874,00  | Public Service Enterprise Group | 39.655.614,08              | 1,54                         |
|   |  | <b>341.984.022,51</b>      | <b>13,29</b>                 | 203.725,00  | State Street                    | 16.731.116,87              | 0,65                         |
| <b>GBP</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 837.470,00  | Associated British Foods                           | 19.913.465,79              | 0,77                         | 33.043,00   | Target                          | 6.708.664,01               | 0,26                         |
| 2.502.467,00  | National Grid                                      | 31.570.617,77              | 1,23                         | 208.358,00  | TD SYNEX                        | 20.926.858,35              | 0,81                         |
| 248.679,00  | Reckitt Benckiser Group                            | 18.773.971,57              | 0,73                         | 194.988,00  | Universal Health Services       | 22.455.511,19              | 0,87                         |
| 696.094,00  | SSE  | 13.664.047,15              | 0,53                         | 771.868,00  | Verizon Communications          | 35.593.224,46              | 1,38                         |
|   |  | <b>83.922.102,28</b>       | <b>3,26</b>                  | 213.916,00  | VMware                          | 22.125.333,89              | 0,86                         |
| <b>HKD</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 2.744.000,00  | CK Asset Holdings                                  | 15.267.286,10              | 0,59                         | 149.010,00  | Walmart                         | 18.806.321,04              | 0,73                         |
| 1.708.500,00  | Sun Hung Kai Properties                            | 18.296.176,22              | 0,71                         | 270.139,00  | Ziff Davis                      | 26.508.276,34              | 1,03                         |
|   |  | <b>33.563.462,32</b>       | <b>1,30</b>                  | 331.954,00  | Zimmer Biomet Holdings          | 37.513.894,01              | 1,46                         |
| <b>JPY</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 840.300,00  | Asahi Group Holdings                               | 28.828.840,34              | 1,12                         |   |                                 | <b>1.745.857.713,03</b>    | <b>67,86</b>                 |
| 1.553.878,00  | KDDI   | 40.060.047,20              | 1,56                         | <b>Summe Aktien</b>   |                                 | <b>2.563.810.456,58</b>    | <b>99,65</b>                 |
| 2.603.700,00  | Nippon Telegraph & Telephone                       | 62.892.422,97              | 2,44                         | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                                 | <b>2.563.810.456,58</b>    | <b>99,65</b>                 |
| 250.100,00  | Seven & i Holdings                                 | 9.696.557,71               | 0,38                         | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  |                                 | <b>2.563.810.456,58</b>    | <b>99,65</b>                 |
| 197.000,00  | Sumitomo Realty & Development                      | 5.110.519,55               | 0,20                         | <b>Bankguthaben</b>   |                                 | <b>13.719.622,32</b>       | <b>0,53</b>                  |
| 877.100,00  | Takeda Pharmaceutical                              | 21.098.931,36              | 0,82                         | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  |                                 | <b>(4.709.960,54)</b>      | <b>(0,18)</b>                |
|   |  | <b>167.687.319,13</b>      | <b>6,52</b>                  | <b>Summe Nettovermögen</b>  |                                 | <b>2.572.820.118,36</b>    | <b>100,00</b>                |
| <b>SEK</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 930.946,00  | Svenska Handelsbanken A                            | 8.886.489,21               | 0,35                         |   |                                 |                            |                              |
|   |  | <b>8.886.489,21</b>        | <b>0,35</b>                  |   |                                 |                            |                              |
| <b>SGD</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 1.269.787,00  | Oversea-Chinese Banking                            | 9.469.671,83               | 0,37                         |   |                                 |                            |                              |
| 6.813.500,00  | Singapore Telecommunications                       | 10.340.878,75              | 0,40                         |   |                                 |                            |                              |
| 736.600,00  | United Overseas Bank                               | 12.962.333,64              | 0,50                         |   |                                 |                            |                              |
|   |  | <b>32.772.884,22</b>       | <b>1,27</b>                  |   |                                 |                            |                              |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 497.201,00  | Akamai Technologies                                | 51.394.776,09              | 2,00                         |   |                                 |                            |                              |
| 23.223,00   | Alphabet   | 59.719.185,52              | 2,32                         |   |                                 |                            |                              |
| 527.260,00  | Amdocs   | 34.941.187,16              | 1,36                         |   |                                 |                            |                              |
| 175.032,00  | Amgen  | 35.012.581,36              | 1,36                         |   |                                 |                            |                              |
| 105.731,00  | Anthem   | 43.591.808,97              | 1,69                         |   |                                 |                            |                              |
| 209.055,00  | Archer-Daniels-Midland                             | 12.384.753,03              | 0,48                         |   |                                 |                            |                              |
| 2.531.664,00  | AT&T   | 55.119.263,94              | 2,14                         |   |                                 |                            |                              |
| 17.082,00   | AutoZone   | 31.425.058,60              | 1,22                         |   |                                 |                            |                              |
| 400.655,00  | Brinker International                              | 13.031.501,54              | 0,51                         |   |                                 |                            |                              |
| 1.275.245,00  | Bristol-Myers Squibb                               | 70.582.359,19              | 2,74                         |   |                                 |                            |                              |
| 257.246,00  | Check Point Software Technologies                  | 26.513.837,52              | 1,03                         |   |                                 |                            |                              |
| 97.132,00   | Chubb  | 16.605.014,06              | 0,65                         |   |                                 |                            |                              |
| 422.483,00  | Cigna  | 86.272.099,21              | 3,35                         |   |                                 |                            |                              |
| 1.303.318,00  | Cisco Systems                                      | 73.033.676,38              | 2,84                         |   |                                 |                            |                              |
| 1.451.140,00  | Coca-Cola  | 75.199.454,72              | 2,92                         |   |                                 |                            |                              |
| 459.564,00  | Cognizant Technology Solutions                     | 36.038.029,86              | 1,40                         |   |                                 |                            |                              |
| 1.539.832,00  | Comcast  | 68.817.636,45              | 2,67                         |   |                                 |                            |                              |
| 182.057,00  | Conagra Brands                                     | 5.443.305,80               | 0,21                         |   |                                 |                            |                              |
| 81.431,00   | Consensus Cloud Solutions                          | 4.225.942,86               | 0,16                         |   |                                 |                            |                              |
| 184.033,00  | Crown Holdings                                     | 17.846.805,93              | 0,69                         |   |                                 |                            |                              |
| 705.303,00  | CVS Health   | 64.337.532,37              | 2,50                         |   |                                 |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Global Stable Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| USA                    | 61,85        | Pharmazeutika                                       | 12,12        |
| Japan                  | 6,52         | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  | 6,79         |
| Kanada                 | 5,80         | Integrierte Telekommunikationsdienste               | 6,37         |
| Deutschland            | 4,80         | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen           | 5,29         |
| Frankreich             | 4,44         | Alkoholfreie Getränke                               | 4,44         |
| Vereinigtes Königreich | 4,26         | Stromversorger                                      | 4,19         |
| Spanien                | 2,23         | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 3,48         |
| Irland                 | 2,02         | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 3,35         |
| Guernsey               | 1,36         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 3,33         |
| Singapur               | 1,27         | Verschiedene Banken                                 | 2,91         |
| Israel                 | 1,03         | Kommunikationsanlagen                               | 2,84         |
| Portugal               | 0,82         | Mehrsparten-Versorger                               | 2,77         |
| Hongkong               | 0,71         | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 2,74         |
| Schweiz                | 0,65         | Systemsoftware                                      | 2,73         |
| Kaimaninseln           | 0,59         | Kabel und Satellitenübertragung                     | 2,67         |
| Bermuda                | 0,52         | Drahtlose Telekommunikationsdienste                 | 2,39         |
| Indien                 | 0,43         | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 2,05         |
| Schweden               | 0,35         | Internet-Dienste und -Infrastruktur                 | 2,00         |
| <b>Summe</b>           | <b>99,65</b> | Bau- und Ingenieurwesen                             | 1,83         |
|                        |              | Luftfracht und Logistik                             | 1,80         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Managed Health Care               | 1,69         |
|                        |              | Lebensmitteleinzelhandel                            | 1,68         |
|                        |              | Rückversicherungen                                  | 1,40         |
|                        |              | Biotechnologie                                      | 1,36         |
|                        |              | Kraftfahrzeugeinzelhandel                           | 1,22         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Vertrieb                          | 1,19         |
|                        |              | Brauereien  | 1,12         |
|                        |              | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 1,00         |
|                        |              | Industriekonglomerate                               | 0,97         |
|                        |              | Verschiedene Immobilienaktivitäten                  | 0,91         |
|                        |              | Warenhäuser   | 0,87         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 0,87         |
|                        |              | Mehrspartenversicherungen                           | 0,82         |
|                        |              | Technologievertrieb                                 | 0,81         |
|                        |              | Großhändler   | 0,76         |
|                        |              | Haushaltsprodukte                                   | 0,73         |
|                        |              | Großmärkte  | 0,73         |
|                        |              | Metall- und Glasverpackungen                        | 0,69         |
|                        |              | Vermögensverwaltung und Depotbanken                 | 0,65         |
|                        |              | Sach- und Unfallversicherung                        | 0,65         |
|                        |              | Anwendungssoftware                                  | 0,60         |
|                        |              | Immobilienentwicklung                               | 0,59         |
|                        |              | Restaurants   | 0,51         |
|                        |              | Bildungsdienstleistungen                            | 0,50         |
|                        |              | Landwirtschaftliche Produkte                        | 0,48         |
|                        |              | Reifen und Gummi                                    | 0,37         |
|                        |              | Industriegase                                       | 0,30         |
|                        |              | Einzelhandel: Heimwerker und Garten                 | 0,07         |
|                        |              | <b>Summe</b>  | <b>99,65</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Global Stable Equity Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 242,01  | EUR               | 2.484,28           | SEK                | (0,24)   | 28.01.2022 |
| 81.479,12   | EUR               | 92.299,55          | USD                | 34,38  | 28.01.2022 |
| 53.665,25   | SEK               | 5.293,55           | EUR                | (60,65)  | 28.01.2022 |
| 1.838.874,11                                      | USD               | 1.632.021,34       | EUR                | (9.411,07)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(9.437,58)</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|---|---------------------------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| <b>CAD</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 123.400,00  | Alimentation Couche-Tard                           | 4.580.025,05               | 0,81                         | 39.990,00   | Conagra Brands                  | 1.195.657,40               | 0,21                         |
| 49.156,00   | Bank of Nova Scotia/The                            | 3.064.851,88               | 0,54                         | 18.442,00   | Consensus Cloud Solutions       | 957.065,96                 | 0,17                         |
| 89.600,00   | CGI  | 6.987.032,28               | 1,24                         | 41.809,00   | Crown Holdings                  | 4.054.474,52               | 0,72                         |
| 75.200,00   | Hydro One  | 1.713.543,89               | 0,30                         | 156.834,00  | CVS Health                      | 14.306.351,39              | 2,53                         |
| 50.200,00   | Metro Inc/CN                                       | 2.349.114,35               | 0,42                         | 17.489,00   | Dollar General                  | 3.640.627,22               | 0,64                         |
| 56.100,00   | Open Text  | 2.359.919,09               | 0,42                         | 200.900,00  | eBay                            | 11.745.550,71              | 2,08                         |
| 116.600,00  | Rogers Communications                              | 4.862.017,82               | 0,86                         | 30.340,00   | Edison International            | 1.819.623,19               | 0,32                         |
| 70.300,00   | Royal Bank of Canada                               | 6.550.590,66               | 1,16                         | 27.903,00   | FedEx                           | 6.329.508,50               | 1,12                         |
|   |  | <b>32.467.095,02</b>       | <b>5,74</b>                  | 85.038,00   | Fiserv                          | 7.829.967,80               | 1,38                         |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 11.267,00   | Air Liquide  | 1.727.456,44               | 0,31                         | 61.911,00   | Genpact                         | 2.909.568,30               | 0,51                         |
| 22.641,00   | Allianz  | 4.701.403,65               | 0,83                         | 38.710,00   | Global Payments                 | 4.684.229,56               | 0,83                         |
| 25.043,00   | Atos   | 936.357,77                 | 0,17                         | 36.876,00   | Grand Canyon Education          | 2.807.088,44               | 0,50                         |
| 12.982,00   | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA       | 1.871.355,30               | 0,33                         | 112.046,00  | Infosys ADR                     | 2.520.577,48               | 0,45                         |
| 68.142,00   | Deutsche Post                                      | 3.852.748,68               | 0,68                         | 32.302,00   | International Business Machines | 3.835.514,93               | 0,68                         |
| 970.209,00  | EDP - Energias de Portugal                         | 4.688.049,89               | 0,83                         | 126.507,00  | Johnson & Johnson               | 19.219.815,99              | 3,40                         |
| 178.644,00  | Endesa   | 3.608.608,80               | 0,64                         | 60.855,00   | Kellogg                         | 3.435.367,24               | 0,61                         |
| 148.511,00  | Fresenius  | 5.257.289,40               | 0,93                         | 14.600,00   | Kyndryl Holdings                | 239.627,42                 | 0,04                         |
| 687.512,00  | Iberdrola  | 7.156.999,92               | 1,27                         | 81.684,00   | LKQ                             | 4.279.458,41               | 0,76                         |
| 30.818,00   | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in M | 8.028.089,00               | 1,42                         | 1.664,00  | Lowe's Cos                      | 376.991,16                 | 0,07                         |
| 107.092,00  | Red Electrica Corp                                 | 2.037.425,30               | 0,36                         | 30.774,00   | McKesson                        | 6.786.500,44               | 1,20                         |
| 116.346,00  | Sanofi   | 10.305.928,68              | 1,82                         | 125.599,00  | Medtronic                       | 11.579.082,32              | 2,05                         |
| 37.501,00   | Siemens  | 5.725.652,68               | 1,01                         | 106.760,00  | Merck                           | 7.283.225,36               | 1,29                         |
| 115.310,00  | Unilever   | 5.425.912,05               | 0,96                         | 170.959,00  | Mondelez International          | 9.930.911,95               | 1,76                         |
| 112.530,00  | Vinci  | 10.455.162,30              | 1,85                         | 63.893,00   | Oracle                          | 4.948.301,74               | 0,88                         |
|   |  | <b>75.778.439,86</b>       | <b>13,40</b>                 | 13.854,00   | Organon                         | 375.384,51                 | 0,07                         |
| <b>GBP</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 189.977,00  | Associated British Foods                           | 4.517.296,73               | 0,80                         | 56.945,00   | PepsiCo                         | 8.657.007,51               | 1,53                         |
| 572.726,00  | National Grid                                      | 7.225.395,43               | 1,28                         | 215.896,00  | Pfizer                          | 11.307.068,14              | 2,00                         |
| 55.597,00   | Reckitt Benckiser Group                            | 4.197.284,44               | 0,74                         | 150.735,00  | Public Service Enterprise Group | 8.817.994,18               | 1,56                         |
| 146.180,00  | SSE  | 2.869.455,00               | 0,51                         | 44.002,00   | State Street                    | 3.613.707,72               | 0,64                         |
|   |  | <b>18.809.431,60</b>       | <b>3,33</b>                  | 7.409,00  | Target                          | 1.504.236,65               | 0,27                         |
| <b>HKD</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 576.000,00  | CK Asset Holdings                                  | 3.204.794,75               | 0,57                         | 46.203,00   | TD SYNEX                        | 4.640.492,02               | 0,82                         |
| 388.000,00  | Sun Hung Kai Properties                            | 4.155.057,87               | 0,73                         | 45.260,00   | Universal Health Services       | 5.212.302,48               | 0,92                         |
|   |  | <b>7.359.852,62</b>        | <b>1,30</b>                  | 171.635,00  | Verizon Communications          | 7.914.621,52               | 1,40                         |
| <b>JPY</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 186.900,00  | Asahi Group Holdings                               | 6.412.126,93               | 1,13                         | 47.567,00   | VMware                          | 4.919.855,26               | 0,87                         |
| 345.500,00  | KDDI   | 8.907.228,44               | 1,58                         | 32.732,00   | Walmart                         | 4.131.054,96               | 0,73                         |
| 579.000,00  | Nippon Telegraph & Telephone                       | 13.985.756,00              | 2,47                         | 60.069,00   | Ziff Davis                      | 5.894.467,86               | 1,04                         |
| 50.200,00   | Seven & i Holdings                                 | 1.946.290,27               | 0,34                         | 73.815,00   | Zimmer Biomet Holdings          | 8.341.782,55               | 1,48                         |
| 44.400,00   | Sumitomo Realty & Development                      | 1.151.812,53               | 0,20                         |   |                                 | <b>386.047.733,74</b>      | <b>68,27</b>                 |
| 199.100,00  | Takeda Pharmaceutical                              | 4.789.416,53               | 0,85                         |   |                                 | <b>566.959.900,00</b>      | <b>100,27</b>                |
|   |  | <b>37.192.630,70</b>       | <b>6,58</b>                  | <b>Summe Aktien</b>   |                                 |                            |                              |
| <b>SEK</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 206.990,00  | Svenska Handelsbanken A                            | 1.975.855,10               | 0,35                         |   |                                 | <b>566.959.900,00</b>      | <b>100,27</b>                |
|   |  | <b>1.975.855,10</b>        | <b>0,35</b>                  | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                                 |                            |                              |
| <b>SGD</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 283.109,00  | Oversea-Chinese Banking                            | 2.111.337,82               | 0,37                         |   |                                 | <b>566.959.900,00</b>      | <b>100,27</b>                |
| 1.539.700,00  | Singapore Telecommunications                       | 2.336.809,43               | 0,41                         | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  |                                 |                            |                              |
| 163.700,00  | United Overseas Bank                               | 2.880.714,11               | 0,51                         |   |                                 | <b>566.959.900,00</b>      | <b>100,27</b>                |
|   |  | <b>7.328.861,36</b>        | <b>1,30</b>                  | <b>Bankguthaben</b>   |                                 |                            |                              |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              |   |                                 |                            |                              |
| 106.212,00  | Akamai Technologies                                | 10.978.944,05              | 1,94                         |   |                                 | <b>4.858.770,01</b>        | <b>0,86</b>                  |
| 5.164,00  | Alphabet   | 13.279.501,96              | 2,35                         | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  |                                 |                            |                              |
| 117.244,00  | Amdocs   | 7.769.685,82               | 1,37                         |   |                                 | <b>(6.361.986,62)</b>      | <b>(1,13)</b>                |
| 38.371,00   | Amgen  | 7.675.555,10               | 1,36                         | <b>Summe Nettovermögen</b>  |                                 |                            |                              |
| 23.487,00   | Anthem   | 9.683.449,67               | 1,71                         |   |                                 | <b>565.456.683,39</b>      | <b>100,00</b>                |
| 43.313,00   | Archer-Daniels-Midland                             | 2.565.931,49               | 0,45                         |   |                                 |                            |                              |
| 562.950,00  | AT&T   | 12.256.519,68              | 2,17                         |   |                                 |                            |                              |
| 3.798,00  | AutoZone   | 6.987.025,67               | 1,24                         |   |                                 |                            |                              |
| 83.086,00   | Brinker International                              | 2.702.413,14               | 0,48                         |   |                                 |                            |                              |
| 283.568,00  | Bristol-Myers Squibb                               | 15.694.943,66              | 2,78                         |   |                                 |                            |                              |
| 53.728,00   | Check Point Software Technologies                  | 5.537.638,92               | 0,98                         |   |                                 |                            |                              |
| 19.971,00   | Chubb  | 3.414.103,86               | 0,60                         |   |                                 |                            |                              |
| 93.945,00   | Cigna  | 19.183.807,07              | 3,39                         |   |                                 |                            |                              |
| 289.811,00  | Cisco Systems                                      | 16.240.060,20              | 2,87                         |   |                                 |                            |                              |
| 322.560,00  | Coca-Cola  | 16.715.365,93              | 2,96                         |   |                                 |                            |                              |
| 102.211,00  | Cognizant Technology Solutions                     | 8.015.168,88               | 1,42                         |   |                                 |                            |                              |
| 342.403,00  | Comcast  | 15.302.555,85              | 2,71                         |   |                                 |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |               | Sektor  |               |
|------------------------|---------------|---|---------------|
| USA                    | 62,31         | Pharmazeutika                                       | 12,20         |
| Japan                  | 6,58          | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  | 6,85          |
| Kanada                 | 5,74          | Integrierte Telekommunikationsdienste               | 6,45          |
| Deutschland            | 4,87          | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen           | 5,36          |
| Frankreich             | 4,47          | Alkoholfreie Getränke                               | 4,49          |
| Vereinigtes Königreich | 4,29          | Stromversorger                                      | 4,23          |
| Spanien                | 2,26          | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 3,52          |
| Irland                 | 2,05          | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 3,39          |
| Guernsey               | 1,37          | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 3,37          |
| Singapur               | 1,30          | Verschiedene Banken                                 | 2,93          |
| Israel                 | 0,98          | Kommunikationsanlagen                               | 2,87          |
| Portugal               | 0,83          | Mehrsparren-Versorger                               | 2,84          |
| Hongkong               | 0,73          | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 2,73          |
| Schweiz                | 0,60          | Systemsoftware                                      | 2,72          |
| Kaimaninseln           | 0,57          | Kabel und Satellitenübertragung                     | 2,71          |
| Bermuda                | 0,51          | Drahtlose Telekommunikationsdienste                 | 2,44          |
| Indien                 | 0,45          | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 2,08          |
| Schweden               | 0,35          | Internet-Dienste und -Infrastruktur                 | 1,94          |
|                        |               | Bau- und Ingenieurwesen                             | 1,85          |
|                        |               | Lufthandlung und Logistik                           | 1,80          |
|                        |               | Gesundheitswesen: Managed Health Care               | 1,71          |
|                        |               | Lebensmitteleinzelhandel                            | 1,57          |
|                        |               | Rückversicherungen                                  | 1,42          |
|                        |               | Biotechnologie                                      | 1,36          |
|                        |               | Kraftfahrzeugeinzelhandel                           | 1,24          |
|                        |               | Gesundheitswesen: Vertrieb                          | 1,20          |
|                        |               | Brauereien  | 1,13          |
|                        |               | Industriekonglomerate                               | 1,01          |
|                        |               | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 0,96          |
|                        |               | Verschiedene Immobilienaktivitäten                  | 0,94          |
|                        |               | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 0,92          |
|                        |               | Warenhäuser   | 0,91          |
|                        |               | Mehrsparrenversicherungen                           | 0,83          |
|                        |               | Technologievertrieb                                 | 0,82          |
|                        |               | Großhändler   | 0,76          |
|                        |               | Haushaltsprodukte                                   | 0,74          |
|                        |               | Großmärkte  | 0,73          |
|                        |               | Metall- und Glasverpackungen                        | 0,72          |
|                        |               | Vermögensverwaltung und Depotbanken                 | 0,64          |
|                        |               | Sach- und Unfallversicherung                        | 0,60          |
|                        |               | Anwendungssoftware                                  | 0,59          |
|                        |               | Immobilienentwicklung                               | 0,57          |
|                        |               | Bildungsdienstleistungen                            | 0,50          |
|                        |               | Restaurants   | 0,48          |
|                        |               | Landwirtschaftliche Produkte                        | 0,45          |
|                        |               | Reifen und Gummi                                    | 0,33          |
|                        |               | Industriegase                                       | 0,31          |
|                        |               | Einzelhandel: Heimwerker und Garten                 | 0,07          |
|                        |               | <b>Summe</b>  | <b>100,27</b> |
| <b>Summe</b>           | <b>100,27</b> |   |               |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 28.572,91   | EUR               | 293.406,91         | NOK                | (784,27)   | 28.01.2022 |
| 1.414,55  | EUR               | 6.642,39           | PLN                | (27,17)  | 28.01.2022 |
| 80.783.452,88                                     | EUR               | 828.804.723,71     | SEK                | (33.884,84)  | 28.01.2022 |
| 375.523,62  | EUR               | 425.087,17         | USD                | 428,63   | 28.01.2022 |
| 6.760.776,61                                      | NOK               | 670.098,81         | EUR                | 6.352,86   | 28.01.2022 |
| 154.549,05  | PLN               | 32.677,80          | EUR                | 866,72   | 28.01.2022 |
| 2.886.310.961,64                                  | SEK               | 284.039.443,11     | EUR                | (2.594.603,75)   | 28.01.2022 |
| 10.038.111,30                                     | USD               | 8.908.774,21       | EUR                | (51.211,59)  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(2.672.863,41)</b>  |            |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                   |                    |                    |  |            |
| 1.180.687.000,00                                  | JPY               | 9.106.631,44       | EUR                | (54.462,13)  | 14.01.2022 |
| 32.299.244,82                                     | EUR               | 46.430.000,00      | CAD                | 91.744,26  | 17.02.2022 |
| 151.408,47  | EUR               | 1.562.000,00       | SEK                | (866,85)   | 17.02.2022 |
| 216.977.316,88                                    | EUR               | 249.013.280,00     | USD                | (2.663.974,26)   | 17.02.2022 |
| 1.193.000,00                                      | GBP               | 1.401.060,74       | EUR                | 17.516,87  | 17.02.2022 |
| 3.558.000,00                                      | SEK               | 354.099,04         | EUR                | (7.247,04)   | 17.02.2022 |
| 14.776.000,00                                     | USD               | 12.975.557,11      | EUR                | 57.472,76  | 17.02.2022 |
| 190.025.718,19                                    | EUR               | 214.506.720,00     | USD                | 866.013,46   | 28.02.2022 |
| 37.618.100,00                                     | USD               | 33.163.410,01      | EUR                | 9.753,44   | 28.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(1.684.049,49)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                   |                    |                    |  |            |
| 49.936.392,19                                     | EUR               | 6.493.289.000,00   | JPY                | 153.176,42   | 14.01.2022 |
| 137.303.000,00                                    | JPY               | 1.070.100,58       | EUR                | (17.419,68)  | 14.01.2022 |
| 2.169.000,00                                      | CAD               | 1.511.695,72       | EUR                | (7.109,20)   | 17.02.2022 |
| 20.273.252,01                                     | EUR               | 17.330.000,00      | GBP                | (333.649,59)   | 17.02.2022 |
| 413.000,00  | GBP               | 487.646,49         | EUR                | 3.443,02   | 17.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(201.559,03)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                   |                    |                    |  |            |
| 1.882.314,93                                      | EUR               | 242.329.000,00     | JPY                | 24.414,29  | 14.01.2022 |
| 359.421.000,00                                    | JPY               | 2.800.740,15       | EUR                | (45.114,73)  | 14.01.2022 |
| 556.594,60  | EUR               | 475.000,00         | GBP                | (8.221,56)   | 17.02.2022 |
| 7.742.666,33                                      | EUR               | 69.227.000,00      | HKD                | (87.174,46)  | 17.02.2022 |
| 52.810,09   | EUR               | 544.000,00         | SEK                | (222,99)   | 17.02.2022 |
| 559.000,00  | GBP               | 655.069,09         | EUR                | 9.630,31   | 17.02.2022 |
| 617.000,00  | SEK               | 60.016,50          | EUR                | 133,04   | 17.02.2022 |
| 386.000,00  | SGD               | 249.271,04         | EUR                | 2.933,49   | 17.02.2022 |
| 9.730.868,94                                      | EUR               | 11.035.000,00      | USD                | (237,92)   | 28.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(103.860,53)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                  |                   |                    |                    |  |            |
| 264.217.000,00                                    | JPY               | 2.052.360,36       | EUR                | (26.647,66)  | 14.01.2022 |
| 901.049,80  | EUR               | 1.309.000,00       | CAD                | (6.984,06)   | 17.02.2022 |
| 203.133,18  | EUR               | 1.797.000,00       | HKD                | (112,54)   | 17.02.2022 |
| 55.172,05   | EUR               | 565.000,00         | SEK                | 92,03  | 17.02.2022 |
| 6.842.982,92                                      | EUR               | 10.612.000,00      | SGD                | (90.690,40)  | 17.02.2022 |
| 6.824.000,00                                      | HKD               | 773.646,88         | EUR                | (1.835,39)   | 17.02.2022 |
| 1.265.000,00                                      | SEK               | 124.392,98         | EUR                | (1.072,99)   | 17.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>(127.251,01)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>           |                   |                    |                    |  |            |
| 2.416.798,59                                      | EUR               | 24.244.000,00      | SEK                | 53.373,28  | 17.02.2022 |
| 549.253,42  | EUR               | 847.000,00         | SGD                | (4.157,09)   | 17.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>49.216,19</b>   |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(2.067.503,87)</b>  |            |
|   |                   |                    |                    | <b>(4.740.367,28)</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Global Stars Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung             | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------------------------------|----------------------------|------------------------------|---|--------------------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| <b>DKK</b>  |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| 145.540,00  | Vestas Wind Systems                | 4.433.545,43               | 0,20                         |   |                          |                            |                              |
|   |                                    | <b>4.433.545,43</b>        | <b>0,20</b>                  |   |                          |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| 119.168,00  | Air Liquide                        | 20.694.464,39              | 0,95                         |   |                          |                            |                              |
| 872.554,00  | AXA                                | 25.878.590,67              | 1,19                         |   |                          |                            |                              |
| 241.037,00  | Infinion Technologies              | 11.127.910,35              | 0,51                         |   |                          |                            |                              |
| 2.633.289,00  | ING Groep                          | 36.512.925,37              | 1,67                         |   |                          |                            |                              |
| 170.146,00  | Kerry Group                        | 21.825.071,93              | 1,00                         |   |                          |                            |                              |
| 393.504,00  | Koninklijke Philips                | 14.603.436,04              | 0,67                         |   |                          |                            |                              |
| 27.150,00   | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton   | 22.356.302,33              | 1,03                         |   |                          |                            |                              |
| 694.435,00  | Rexel                              | 14.024.218,64              | 0,64                         |   |                          |                            |                              |
| 608.457,00  | Unilever                           | 32.428.838,88              | 1,49                         |   |                          |                            |                              |
|   |                                    | <b>199.451.758,60</b>      | <b>9,15</b>                  |   |                          |                            |                              |
| <b>GBP</b>  |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| 449.203,00  | Experian                           | 21.974.570,82              | 1,01                         |   |                          |                            |                              |
| 36.533.881,00   | Lloyds Banking Group               | 23.545.625,98              | 1,08                         |   |                          |                            |                              |
| 7.628.918,00  | Rotork                             | 36.741.842,54              | 1,69                         |   |                          |                            |                              |
|   |                                    | <b>82.262.039,34</b>       | <b>3,77</b>                  |   |                          |                            |                              |
| <b>HKD</b>  |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| 2.673.000,00  | AIA Group                          | 26.938.378,55              | 1,24                         |   |                          |                            |                              |
| 1.697.904,00  | Alibaba Group Holding              | 25.884.807,09              | 1,19                         |   |                          |                            |                              |
| 600.000,00  | Tencent Holdings                   | 35.142.066,18              | 1,61                         |   |                          |                            |                              |
|   |                                    | <b>87.965.251,82</b>       | <b>4,03</b>                  |   |                          |                            |                              |
| <b>INR</b>  |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| 1.238.754,00  | HDFC Bank                          | 24.653.213,74              | 1,13                         |   |                          |                            |                              |
|   |                                    | <b>24.653.213,74</b>       | <b>1,13</b>                  |   |                          |                            |                              |
| <b>JPY</b>  |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| 19.700,00   | Keyence                            | 12.367.365,46              | 0,57                         |   |                          |                            |                              |
| 397.700,00  | Nabtesco                           | 11.761.576,34              | 0,54                         |   |                          |                            |                              |
| 1.715.600,00  | Pan Pacific International Holdings | 23.647.530,20              | 1,08                         |   |                          |                            |                              |
|   |                                    | <b>47.776.472,00</b>       | <b>2,19</b>                  |   |                          |                            |                              |
| <b>KRW</b>  |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| 486.562,00  | Samsung Electronics                | 32.048.635,19              | 1,47                         |   |                          |                            |                              |
| 142.638,00  | SK Hynix                           | 15.718.681,93              | 0,72                         |   |                          |                            |                              |
|   |                                    | <b>47.767.317,12</b>       | <b>2,19</b>                  |   |                          |                            |                              |
| <b>SEK</b>  |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| 834.564,00  | Epiroc A                           | 21.133.455,06              | 0,97                         |   |                          |                            |                              |
| 581.072,00  | SKF B                              | 13.770.619,86              | 0,63                         |   |                          |                            |                              |
|   |                                    | <b>34.904.074,92</b>       | <b>1,60</b>                  |   |                          |                            |                              |
| <b>TWD</b>  |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| 2.021.000,00  | Taiwan Semiconductor Manufacturing | 44.924.093,77              | 2,06                         |   |                          |                            |                              |
|   |                                    | <b>44.924.093,77</b>       | <b>2,06</b>                  |   |                          |                            |                              |
| <b>USD</b>  |                                    |                            |                              |   |                          |                            |                              |
| 318.981,00  | AbbVie                             | 43.199.596,83              | 1,98                         |   |                          |                            |                              |
| 300.047,00  | Activision Blizzard                | 20.211.165,92              | 0,93                         |   |                          |                            |                              |
| 254.299,00  | Alllegion                          | 33.442.861,49              | 1,53                         |   |                          |                            |                              |
| 149.137,00  | Allstate                           | 17.581.760,93              | 0,81                         |   |                          |                            |                              |
| 30.592,00   | Alphabet                           | 89.104.400,64              | 4,09                         |   |                          |                            |                              |
| 25.408,00   | Amazon.com                         | 85.574.906,24              | 3,92                         |   |                          |                            |                              |
| 44.407,00   | ANSYS                              | 17.972.845,11              | 0,82                         |   |                          |                            |                              |
| 279.481,00  | Apple                              | 49.714.080,28              | 2,28                         |   |                          |                            |                              |
| 85.293,00   | Applied Materials                  | 13.504.440,69              | 0,62                         |   |                          |                            |                              |
| 15.029,00   | Atlassian Corp                     | 5.785.714,13               | 0,27                         |   |                          |                            |                              |
| 411.594,00  | Autoliv                            | 42.381.834,18              | 1,94                         |   |                          |                            |                              |
| 258.720,00  | Avantor                            | 10.951.617,60              | 0,50                         |   |                          |                            |                              |
| 128.717,00  | Chubb                              | 24.923.472,71              | 1,14                         |   |                          |                            |                              |
| 462.769,00  | Colgate-Palmolive                  | 39.196.534,30              | 1,80                         |   |                          |                            |                              |
| 60.349,00   | Ecolab                             | 14.092.698,48              | 0,65                         |   |                          |                            |                              |
| 391.082,00  | Fastenal                           | 24.868.904,38              | 1,14                         |   |                          |                            |                              |
| 61.638,00   | First Republic Bank/CA             | 12.722.699,58              | 0,58                         |   |                          |                            |                              |
| 284.620,00  | Global Payments                    | 39.010.017,20              | 1,79                         |   |                          |                            |                              |
| 264.047,00  | Globus Medical                     | 19.212.059,72              | 0,88                         |   |                          |                            |                              |
| 70.400,00   | Healthcare Realty Trust            | 2.240.832,00               | 0,10                         |   |                          |                            |                              |
| 189.754,00  | Houlihan Lokey                     | 19.586.407,88              | 0,90                         |   |                          |                            |                              |
| 148.668,00  | International Flavors & Fragrances | 22.164.912,12              | 1,02                         |   |                          |                            |                              |
| 196.813,00  | Jack Henry & Associates            | 32.976.018,15              | 1,51                         |   |                          |                            |                              |
| 88.681,00   | Jones Lang LaSalle                 | 24.083.099,17              | 1,10                         |   |                          |                            |                              |
| 106.286,00  | JPMorgan Chase                     | 16.830.388,10              | 0,77                         |   |                          |                            |                              |
| 145.966,00  | Kimberly-Clark                     | 20.718.414,04              | 0,95                         |   |                          |                            |                              |
| 80.028,00   | Littelfuse                         | 25.048.764,00              | 1,15                         |   |                          |                            |                              |
| 87.101,00   | Mastercard                         | 31.499.205,64              | 1,44                         |   |                          |                            |                              |
| 274.957,00  | Medtronic                          | 28.711.009,94              | 1,32                         |   |                          |                            |                              |
| 616.859,00  | Merck                              | 47.664.694,93              | 2,19                         |   |                          |                            |                              |
| 296.086,00  | Microsoft                          | 99.893.494,68              | 4,58                         |   |                          |                            |                              |
| 31.009,00   | MSCI                               | 18.961.693,41              | 0,87                         |   |                          |                            |                              |
|   |                                    |                            |                              | 177.500,00  | Neurocrine Biosciences   | 15.112.350,00              | 0,69                         |
|   |                                    |                            |                              | 117.335,00  | NIKE                     | 19.569.131,30              | 0,90                         |
|   |                                    |                            |                              | 39.417,00   | Paycom Software          | 16.399.837,02              | 0,75                         |
|   |                                    |                            |                              | 102.705,00  | PayPal Holdings          | 19.597.141,05              | 0,90                         |
|   |                                    |                            |                              | 9.739,00  | Pool                     | 5.456.956,48               | 0,25                         |
|   |                                    |                            |                              | 365.973,00  | PRA Group                | 18.273.031,89              | 0,84                         |
|   |                                    |                            |                              | 170.940,00  | Progressive              | 17.617.076,40              | 0,81                         |
|   |                                    |                            |                              | 54.360,00   | S&P Global               | 25.576.380,00              | 1,17                         |
|   |                                    |                            |                              | 134.805,00  | salesforce.com           | 34.371.230,85              | 1,58                         |
|   |                                    |                            |                              | 3.773.013,00  | Sberbank of Russia PJSC  | 14.837.366,08              | 0,68                         |
|   |                                    |                            |                              | 21.856,00   | Spotify Technology       | 5.269.700,16               | 0,24                         |
|   |                                    |                            |                              | 131.864,00  | Stryker                  | 35.613.829,12              | 1,63                         |
|   |                                    |                            |                              | 147.004,00  | Texas Instruments        | 27.808.746,68              | 1,28                         |
|   |                                    |                            |                              | 53.951,00   | Thermo Fisher Scientific | 36.013.371,52              | 1,65                         |
|   |                                    |                            |                              | 375.263,00  | TJX Cos                  | 28.369.882,80              | 1,30                         |
|   |                                    |                            |                              | 25.095,00   | Twilio                   | 6.752.060,70               | 0,31                         |
|   |                                    |                            |                              | 43.376,00   | United Rentals           | 14.180.048,16              | 0,65                         |
|   |                                    |                            |                              | 796.078,00  | US Foods Holding         | 27.799.043,76              | 1,27                         |
|   |                                    |                            |                              | 153.132,00  | Verisk Analytics         | 34.973.817,48              | 1,60                         |
|   |                                    |                            |                              | 174.556,00  | Waste Management         | 28.941.384,80              | 1,33                         |
|   |                                    |                            |                              | 61.143,00   | Waters                   | 22.715.235,93              | 1,04                         |
|   |                                    |                            |                              | 59.778,00   | Watsco                   | 18.413.417,34              | 0,84                         |
|   |                                    |                            |                              | 705.449,00  | Wells Fargo              | 33.946.205,88              | 1,56                         |
|   |                                    |                            |                              | 591.494,00  | Westrock                 | 26.238.673,84              | 1,20                         |
|   |                                    |                            |                              | 307.516,00  | Xcel Energy              | 20.640.473,92              | 0,95                         |
|   |                                    |                            |                              |   |                          | <b>1.548.316.937,63</b>    | <b>71,01</b>                 |
|   |                                    |                            |                              | <b>Summe Aktien</b>   |                          | <b>2.122.454.704,37</b>    | <b>97,34</b>                 |
|   |                                    |                            |                              | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   |                          | <b>2.122.454.704,37</b>    | <b>97,34</b>                 |
|   |                                    |                            |                              | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                          |                            |                              |
|   |                                    |                            |                              | <b>Aktien</b>   |                          |                            |                              |
|   |                                    |                            |                              | <b>CNY</b>  |                          |                            |                              |
|   |                                    |                            |                              | 1.031.400,00  | East Money Information   | 6.005.515,78               | 0,28                         |
|   |                                    |                            |                              |   |                          | <b>6.005.515,78</b>        | <b>0,28</b>                  |
|   |                                    |                            |                              | <b>Summe Aktien</b>   |                          | <b>6.005.515,78</b>        | <b>0,28</b>                  |
|   |                                    |                            |                              | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |                          | <b>6.005.515,78</b>        | <b>0,28</b>                  |
|   |                                    |                            |                              | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  |                          | <b>2.128.460.220,15</b>    | <b>97,61</b>                 |
|   |                                    |                            |                              | <b>Bankguthaben</b>   |                          | <b>59.744.786,95</b>       | <b>2,74</b>                  |
|   |                                    |                            |                              | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  |                          | <b>(7.726.533,49)</b>      | <b>(0,35)</b>                |
|   |                                    |                            |                              | <b>Summe Nettovermögen</b>  |                          | <b>2.180.478.473,61</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Global Stars Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| USA                    | 65,83        | Verschiedene Banken                                 | 6,89         |
| Vereinigtes Königreich | 4,52         | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 5,70         |
| Irland                 | 3,85         | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 5,64         |
| Frankreich             | 3,80         | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 5,11         |
| Kaimaninseln           | 2,80         | Systemsoftware                                      | 4,58         |
| Niederlande            | 2,34         | Halbleiter  | 4,57         |
| Japan                  | 2,19         | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 4,50         |
| Republik Korea         | 2,19         | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie    | 3,75         |
| Taiwan, Provinz Chinas | 2,06         | Anwendungssoftware                                  | 3,42         |
| Schweden               | 1,60         | Handelsgesellschaften und Großhändler               | 3,28         |
| Hongkong               | 1,24         | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen      | 3,20         |
| Schweiz                | 1,14         | Industriemaschinen                                  | 2,86         |
| Indien                 | 1,13         | Sach- und Unfallversicherung                        | 2,76         |
| Jersey                 | 1,01         | Haushaltsprodukte                                   | 2,75         |
| Russische Föderation   | 0,68         | Biotechnologie                                      | 2,67         |
| Deutschland            | 0,51         | Forschungs- und Beratungsleistungen                 | 2,61         |
| China                  | 0,28         | Börsen und Finanzdaten                              | 2,32         |
| Luxemburg              | 0,24         | Pharmazeutika                                       | 2,19         |
| Dänemark               | 0,20         | Autoteile und -zubehör                              | 1,94         |
| <b>Summe</b>           | <b>97,61</b> | Spezialchemikalien                                  | 1,66         |
|                        |              | Bauprodukte   | 1,53         |
|                        |              | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 1,49         |
|                        |              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 1,33         |
|                        |              | Bekleidung-Einzelhandel                             | 1,30         |
|                        |              | Lebensmittelvertriebsunternehmen                    | 1,27         |
|                        |              | Lebens- und Krankenversicherung                     | 1,24         |
|                        |              | Papierverpackungen                                  | 1,20         |
|                        |              | Mehrsparversicherungen                              | 1,19         |
|                        |              | Elektronische Komponenten                           | 1,15         |
|                        |              | Immobiliendienste                                   | 1,10         |
|                        |              | Warenhäuser   | 1,08         |
|                        |              | Bekleidung, Accessoires und Luxusgüter              | 1,03         |
|                        |              | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 1,00         |
|                        |              | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 0,97         |
|                        |              | Stromversorger                                      | 0,95         |
|                        |              | Industriegase                                       | 0,95         |
|                        |              | Interaktives Home Entertainment                     | 0,93         |
|                        |              | Schuhe  | 0,90         |
|                        |              | Investmentbanken und Broker                         | 0,90         |
|                        |              | Konsumfinanzierungen                                | 0,84         |
|                        |              | Halbleiter-Ausrüstung                               | 0,62         |
|                        |              | Regionale Banken                                    | 0,58         |
|                        |              | Hersteller von Elektronikausrüstung                 | 0,57         |
|                        |              | Internet-Dienste und -Infrastruktur                 | 0,31         |
|                        |              | Großhändler   | 0,25         |
|                        |              | Filme und Entertainment                             | 0,24         |
|                        |              | Elektrische Anlagen                                 | 0,20         |
|                        |              | Immobilien: REITs (Gesundheitswesen)                | 0,10         |
|                        |              | <b>Summe</b>  | <b>97,61</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Global Stars Equity Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswahrung (USD) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 1.311.679,05                                      | EUR                | 1.478.047,59      | USD                  | 8.449,21  | 28.01.2022  |
| 134.227,72  | USD                | 118.833,59        | EUR                  | (443,76)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>8.005,45</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 3.746.736.134,00                                  | JPY                | 33.985.527,10     | USD                  | (1.436.859,33)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.436.859,33)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 15.519.268,00                                     | EUR                | 18.264.266,46     | USD                  | (676.593,09)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(676.593,09)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 23.359.112,00                                     | AUD                | 16.998.402,44     | USD                  | (67.611,59)   | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(67.611,59)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 35.450.516,00                                     | CAD                | 27.781.541,05     | USD                  | 97.750,89   | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>97.750,89</b>  |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(2.083.313,12)</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(2.075.307,67)</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.



# Nordea 1 - Indian Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |
| <b>INR</b>  |   |                            |                              |
| 9.067,00  | 3M India  | 3.093.352,57               | 0,91                         |
| 98.775,00   | ABB India   | 2.967.941,22               | 0,88                         |
| 220.740,00  | Angel One   | 3.510.102,04               | 1,04                         |
| 295.057,00  | APL Apollo Tubes  | 3.968.459,13               | 1,17                         |
| 141.317,00  | Apollo Hospitals Enterprise   | 9.530.805,85               | 2,81                         |
| 189.897,00  | Aster DM Healthcare   | 443.987,49                 | 0,13                         |
| 114.703,00  | Bajaj Finance   | 10.766.264,13              | 3,18                         |
| 1.789.389,00  | Bharti Airtel   | 16.460.260,97              | 4,86                         |
| 293.364,00  | Brigade Enterprises   | 1.934.958,11               | 0,57                         |
| 58.851,00   | Coforge   | 4.663.347,77               | 1,38                         |
| 177.595,00  | FSN E-Commerce Ventures   | 5.020.804,58               | 1,48                         |
| 47.434,00   | GMM Pfaudler  | 3.102.405,97               | 0,92                         |
| 505.752,00  | Godrej Consumer Products  | 6.588.291,74               | 1,94                         |
| 126.320,00  | Great Eastern Shipping Co   | 506.737,00                 | 0,15                         |
| 251.370,00  | Havells India   | 4.724.030,66               | 1,39                         |
| 779.755,00  | HCL Technologies  | 13.836.898,18              | 4,08                         |
| 415.410,00  | HDFC Bank   | 8.267.332,75               | 2,44                         |
| 1.953.036,00  | Hindalco Industries   | 12.494.224,10              | 3,69                         |
| 337.576,00  | Housing Development Finance   | 11.745.689,25              | 3,47                         |
| 3.163.265,00  | ICICI Bank  | 31.496.201,21              | 9,30                         |
| 1.041.911,00  | Infosys   | 26.459.276,14              | 7,81                         |
| 1.247.501,00  | Jindal Stainless  | 3.326.192,72               | 0,98                         |
| 532.991,00  | Jyothy Labs   | 990.902,16                 | 0,29                         |
| 362.399,00  | Kotak Mahindra Bank   | 8.756.294,51               | 2,59                         |
| 266.286,00  | Macrotech Developers  | 4.418.836,66               | 1,30                         |
| 337.329,00  | Mahindra Lifespace Developers   | 1.100.898,63               | 0,33                         |
| 713.213,00  | Marico  | 4.918.617,71               | 1,45                         |
| 286.756,00  | Minda Industries  | 4.724.961,53               | 1,39                         |
| 401.580,00  | PB Fintech  | 5.133.761,18               | 1,52                         |
| 205.317,00  | Piramal Enterprises   | 7.302.520,61               | 2,16                         |
| 636.550,00  | Reliance Industries   | 20.278.909,01              | 5,99                         |
| 9.443,00  | Sanofi India  | 1.001.926,12               | 0,30                         |
| 703.257,00  | SBI Life Insurance  | 11.314.831,74              | 3,34                         |
| 25.893,00   | Schaeffler India  | 3.059.830,23               | 0,90                         |
| 324.452,00  | Sobha   | 3.908.360,84               | 1,15                         |
| 2.082.372,00  | State Bank of India   | 12.898.631,91              | 3,81                         |
| 180.657,00  | Tata Consultancy Services   | 9.085.265,23               | 2,68                         |
| 1.568.812,00  | Tata Motors   | 10.180.780,13              | 3,01                         |
| 421.099,00  | Tech Mahindra   | 10.143.165,69              | 2,99                         |
| 121.218,00  | Torrent Pharmaceuticals   | 5.346.117,94               | 1,58                         |
| 86.843,00   | UltraTech Cement  | 8.868.282,65               | 2,62                         |
| 179.287,00  | United Breweries  | 3.825.326,70               | 1,13                         |
| 246.094,00  | UTI Asset Management  | 3.486.535,68               | 1,03                         |
| 155.344,00  | VRL Logistics   | 895.255,10                 | 0,26                         |
|   |   | <b>326.547.575,54</b>      | <b>96,40</b>                 |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |
| 125.706,00  | Infosys ADR   | 3.202.988,88               | 0,95                         |
|   |   | <b>3.202.988,88</b>        | <b>0,95</b>                  |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>329.750.564,42</b>      | <b>97,35</b>                 |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>329.750.564,42</b>      | <b>97,35</b>                 |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>329.750.564,42</b>      | <b>97,35</b>                 |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>24.682.255,10</b>       | <b>7,29</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(15.702.223,03)</b>     | <b>(4,64)</b>                |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>338.730.596,49</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Indian Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land   | Sektor                                      |
|--------|---|
| Indien | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen   |
| 97,35  | 19,90                                       |
|        | Verschiedene Banken                         |
|        | 18,13                                       |
|        | Öl- und Gasraffinerien und -marketing       |
|        | 5,99  |
|        | Drahtlose Telekommunikationsdienste         |
|        | 4,86  |
|        | Aluminium                                   |
|        | 3,69  |
|        | Bausparkassen und Hypothekenfinanzierung    |
|        | 3,47  |
|        | Produkte für den persönlichen Gebrauch      |
|        | 3,40  |
|        | Lebens- und Krankenversicherung             |
|        | 3,34  |
|        | Konsumfinanzierungen                        |
|        | 3,18  |
|        | Automobilhersteller                         |
|        | 3,01  |
|        | Internet und Direktmarketing (Privatkunden) |
|        | 3,00  |
|        | Gesundheitswesen: Einrichtungen             |
|        | 2,94  |
|        | Immobilienentwicklung                       |
|        | 2,78  |
|        | Baumaterialien                              |
|        | 2,62  |
|        | Spezialfinanzdienstleister                  |
|        | 2,16  |
|        | Stahl                                       |
|        | 2,15  |
|        | Pharmazeutika                               |
|        | 1,87  |
|        | Industriemaschinen                          |
|        | 1,82  |
|        | Autoteile und -zubehör                      |
|        | 1,39  |
|        | Elektrische Komponenten und Ausrüstung      |
|        | 1,39  |
|        | Brauereien                                  |
|        | 1,13  |
|        | Investmentbanken und Broker                 |
|        | 1,04  |
|        | Vermögensverwaltung und Depotbanken         |
|        | 1,03  |
|        | Industriekonglomerate                       |
|        | 0,91  |
|        | Elektrische Anlagen                         |
|        | 0,88  |
|        | Verschiedene Immobilienaktivitäten          |
|        | 0,57  |
|        | Haushaltsprodukte                           |
|        | 0,29  |
|        | Speedition/Transport                        |
|        | 0,26  |
|        | Öl- und Gaslagerung und Transport           |
|        | 0,15  |
|        | <b>Summe</b>                                |
|        | <b>97,35</b>                                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              | <b>USD</b>         |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 140.000,00  | Altice Finco SA 4.75% 15-01-2028               | 150.642,45                 | 0,18                         | 400.000,00         | AerCap Global Aviation 6.500% MULTI 15-06-2045  | 432.000,01                 | 0,53                         |
| 906.025,00  | ARD Finance SA 5% P-I-K 30-06-2027             | 1.051.864,45               | 1,29                         | 200.000,00         | Altice France SA/France 5.5% 15-10-2029         | 197.000,00                 | 0,24                         |
| 195.000,00  | Ardagh Metal Packaging Finan 2% 01-09-2028     | 218.200,89                 | 0,27                         | 229.775,00         | Avation Capital SA 31-10-2026                   | 190.713,25                 | 0,23                         |
| 195.000,00  | Ardagh Metal Packaging Finan 3% 01-09-2029     | 216.173,33                 | 0,26                         | 384.000,00         | Ball Corp 2.875% 15-08-2030                     | 372.480,00                 | 0,46                         |
| 332.000,00  | Ardagh Packaging Finance PLC 2.125% 15-08-2026 | 368.236,97                 | 0,45                         | 262.000,00         | Banco Mercantil del No 8.375% MULTI Perp FC2030 | 300.385,62                 | 0,37                         |
| 185.000,00  | Avis Budget Finance Plc 4.125% 15-11-2024      | 211.111,80                 | 0,26                         | 665.000,00         | Barclays PLC 8.000% MULTI Perp FC2024           | 735.011,20                 | 0,90                         |
| 328.000,00  | Avis Budget Finance Plc 4.75% 30-01-2026       | 378.010,61                 | 0,46                         | 106.000,00         | Bath & Body Works Inc 6.75% 01-07-2036          | 130.910,00                 | 0,16                         |
| 559.000,00  | Belden Inc 3.375% 15-07-2031                   | 649.708,26                 | 0,80                         | 148.000,00         | Bath & Body Works Inc 6.875% 01-11-2035         | 183.890,00                 | 0,23                         |
| 150.000,00  | Carnival Corp 7.625% 01-03-2026                | 178.392,38                 | 0,22                         | 182.000,00         | Bausch Health Cos Inc 5.25% 15-02-2031          | 159.932,50                 | 0,20                         |
| 293.000,00  | Cirsa Finance International 4.5% 15-03-2027    | 324.266,71                 | 0,40                         | 56.000,00          | Bausch Health Cos Inc 7% 15-01-2028             | 55.720,00                  | 0,07                         |
| 478.000,00  | Constellium SE 3.125% 15-07-2029               | 536.696,46                 | 0,66                         | 165.000,00         | Beazer Homes USA Inc 5.875% 15-10-2027          | 172.631,25                 | 0,21                         |
| 546.000,00  | Constellium SE 4.25% 15-02-2026                | 623.188,79                 | 0,76                         | 56.000,00          | Beazer Homes USA Inc 6.75% 15-03-2025           | 57.470,00                  | 0,07                         |
| 365.000,00  | Crown European Holdings SA 2.875% 01-02-2026   | 436.225,48                 | 0,53                         | 84.000,00          | Callon Petroleum Co 6.125% 01-10-2024           | 82.740,00                  | 0,10                         |
| 388.000,00  | CT Investment GmbH 5.5% 15-04-2026             | 442.764,21                 | 0,54                         | 211.000,00         | Calpine Corp 3.75% 01-03-2031                   | 204.670,00                 | 0,25                         |
| 288.000,00  | Dana Financing Luxembourg Sa 3% 15-07-2029     | 329.465,23                 | 0,40                         | 200.000,00         | Canpack SA / Canpack US LLC 3.875% 15-11-2029   | 195.250,00                 | 0,24                         |
| 389.000,00  | Douglas GmbH 6% 08-04-2026                     | 439.279,05                 | 0,54                         | 134.000,00         | CIT Group Inc 4.75% 16-02-2024                  | 141.370,00                 | 0,17                         |
| 335.000,00  | eG Global Finance PLC 4.375% 07-02-2025        | 380.386,34                 | 0,47                         | 199.000,00         | Citigroup Inc 5.000% MULTI Perp FC2024          | 204.970,00                 | 0,25                         |
| 341.000,00  | eG Global Finance PLC 6.25% 30-10-2025         | 395.889,49                 | 0,48                         | 200.000,00         | Credit Suisse Group AG 6.375% MULTI Perp FC2026 | 215.560,00                 | 0,26                         |
| 437.000,00  | Faurecia SE 3.75% 15-06-2028                   | 516.622,90                 | 0,63                         | 200.000,00         | Credit Suisse Group AG 7.500% MULTI Perp FC2023 | 211.500,00                 | 0,26                         |
| 336.000,00  | Grifols Escrow Issuer SA 3.875% 15-10-2028     | 381.881,08                 | 0,47                         | 363.000,00         | Credit Suisse Group AG 7.500% MULTI Perp FC2023 | 392.040,00                 | 0,48                         |
| 348.000,00  | International Game Technolog 3.5% 15-06-2026   | 401.749,82                 | 0,49                         | 150.000,00         | Crowdstrike Holdings Inc 3% 15-02-2029          | 148.500,00                 | 0,18                         |
| 315.000,00  | International Game Technolog 3.5% 15-07-2024   | 373.732,03                 | 0,46                         | 155.000,00         | Dana Inc 4.5% 15-02-2032                        | 154.612,50                 | 0,19                         |
| 435.000,00  | Netflix Inc 3.625% 15-06-2030                  | 586.368,50                 | 0,72                         | 215.000,00         | Deutsche Bank AG/New Yo 3.729% MULTI 14-01-2032 | 219.972,21                 | 0,27                         |
| 300.000,00  | Novelis Sheet Ingot GmbH 3.375% 15-04-2029     | 349.037,42                 | 0,43                         | 121.000,00         | DISH DBS Corp 5% 15-03-2023                     | 123.571,25                 | 0,15                         |
| 165.000,00  | Organon & Co / Organon Forei 2.875% 30-04-2028 | 188.111,36                 | 0,23                         | 113.000,00         | DISH DBS Corp 5.875% 15-07-2022                 | 114.695,00                 | 0,14                         |
| 113.000,00  | PeopleCert Wisdom Issuer PLC 5.75% 15-09-2026  | 133.013,04                 | 0,16                         | 25.948,00          | Ecuador Government Internati 31-07-2030         | 14.433,58                  | 0,02                         |
| 550.000,00  | Pinnacle Bidco PLC 5.5% 15-02-2025             | 634.637,95                 | 0,78                         | 75.600,00          | Ecuador Government Internati MULTI 31-07-2030   | 62.275,50                  | 0,08                         |
| 671.000,00  | Primo Water Holdings Inc 3.875% 31-10-2028     | 775.208,31                 | 0,95                         | 198.120,00         | Ecuador Government Internati MULTI 31-07-2035   | 128.282,70                 | 0,16                         |
| 844.000,00  | Scientific Games Internation 5.5% 15-02-2026   | 975.075,73                 | 1,19                         | 90.800,00          | Ecuador Government Internati MULTI 31-07-2040   | 52.437,00                  | 0,06                         |
| 185.000,00  | Silgan Holdings Inc 2.25% 01-06-2028           | 207.660,67                 | 0,25                         | 65.000,00          | Encompass Health Corp 4.5% 01-02-2028           | 66.868,75                  | 0,08                         |
| 398.000,00  | Silgan Holdings Inc 3.25% 15-03-2025           | 452.567,23                 | 0,55                         | 23.000,00          | Encompass Health Corp 4.625% 01-04-2031         | 23.402,50                  | 0,03                         |
| 892.000,00  | Teva Pharmaceutical Finance 4.5% 01-03-2025    | 1.046.948,04               | 1,28                         | 82.000,00          | Encompass Health Corp 4.75% 01-02-2030          | 84.460,00                  | 0,10                         |
| 100.000,00  | Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15-08-2026  | 114.585,67                 | 0,14                         | 209.000,00         | Ford Motor Credit Co LLC 4% 13-11-2030          | 224.413,75                 | 0,27                         |
| 359.000,00  | Verisure Holding AB 3.25% 15-02-2027           | 405.096,52                 | 0,50                         | 274.000,00         | Ford Motor Credit Co LLC 4.389% 08-01-2026      | 295.235,00                 | 0,36                         |
| 199.000,00  | Verisure Midholding AB 5.25% 15-02-2029        | 228.309,03                 | 0,28                         | 60.000,00          | Freepport-McMoRan Inc 4.25% 01-03-2030          | 63.150,00                  | 0,08                         |
| 120.000,00  | Virgin Media Finance PLC 3.75% 15-07-2030      | 135.694,28                 | 0,17                         | 173.000,00         | Freepport-McMoRan Inc 4.375% 01-08-2028         | 181.433,75                 | 0,22                         |
| 200.000,00  | WP/AP Telecom Holdings IV BV 3.75% 15-01-2029  | 228.795,30                 | 0,28                         | 115.000,00         | Freepport-McMoRan Inc 4.625% 01-08-2030         | 123.337,50                 | 0,15                         |
| 323.000,00  | Ziggo BV 4.25% 15-01-2027                      | 298.489,32                 | 0,37                         | 146.000,00         | Freepport-McMoRan Inc 5.45% 15-03-2043          | 183.777,50                 | 0,23                         |
|   |  | <b>15.764.087,10</b>       | <b>19,30</b>                 | 123.000,00         | Goodyear Tire & Rubber Co/Th 4.875% 15-03-2027  | 130.072,50                 | 0,16                         |
|   |  |                            |                              | 142.000,00         | Goodyear Tire & Rubber Co/Th 5% 31-05-2026      | 145.727,50                 | 0,18                         |
|   | <b>GBP</b>                                     |                            |                              | 208.000,00         | HCA Inc 3.5% 01-09-2030                         | 218.868,00                 | 0,27                         |
| 190.000,00  | Deuce Finco Plc 5.5% 15-06-2027                | 253.999,50                 | 0,31                         | 55.000,00          | HCA Inc 5.875% 01-02-2029                       | 65.535,25                  | 0,08                         |
| 100.000,00  | Wheel Bidco Ltd 6.75% 15-07-2026               | 132.133,40                 | 0,16                         | 290.000,00         | HCA Inc 5.875% 15-02-2026                       | 328.055,25                 | 0,40                         |
|   |  | <b>386.132,90</b>          | <b>0,47</b>                  | 52.000,00          | HCA Inc 7.5% 06-11-2033                         | 74.620,00                  | 0,09                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 235.000,00         | IHS Holding Ltd 5.625% 29-11-2026              | 237.068,00                 | 0,29                         | 162.000,00         | Tenet Healthcare Corp 4.25% 01-06-2029  | 164.025,00                 | 0,20                         |
| 303.000,00         | Investment Energy Resources 6.25% 26-04-2029   | 325.349,29                 | 0,40                         | 113.000,00         | Tenet Healthcare Corp 6.75% 15-06-2023  | 120.768,75                 | 0,15                         |
| 225.000,00         | iStar Inc 4.25% 01-08-2025                     | 231.376,50                 | 0,28                         | 96.000,00          | T-Mobile USA Inc 2.25% 15-02-2026   | 96.240,00                  | 0,12                         |
| 118.000,00         | iStar Inc 5.5% 15-02-2026                      | 122.425,00                 | 0,15                         | 162.000,00         | T-Mobile USA Inc 3.375% 15-04-2029  | 165.115,26                 | 0,20                         |
| 300.000,00         | Ithaca Energy North Sea PLC 9% 15-07-2026      | 307.500,00                 | 0,38                         | 230.000,00         | Travel + Leisure Co 5.65% 01-04-2024  | 244.375,00                 | 0,30                         |
| 179.000,00         | JPMorgan Chase & Co 4.600% MULTI Perp FC2025   | 183.698,75                 | 0,22                         | 284.000,00         | Travel + Leisure Co 6% 01-04-2027   | 308.642,68                 | 0,38                         |
| 58.000,00          | JPMorgan Chase & Co MULTI Perpetual            | 58.000,00                  | 0,07                         | 126.000,00         | Triumph Group Inc 7.75% 15-08-2025  | 125.055,00                 | 0,15                         |
| 195.000,00         | KB Home 7.625% 15-05-2023                      | 204.993,75                 | 0,25                         | 332.000,00         | Tullow Oil PLC 10.25% 15-05-2026  | 335.320,00                 | 0,41                         |
| 34.000,00          | Kinder Morgan Inc 7.75% 15-01-2032             | 48.021,09                  | 0,06                         | 157.000,00         | United Airlines Holdings Inc 4.875% 15-01-2025  | 161.513,75                 | 0,20                         |
| 246.000,00         | Kinder Morgan Inc 8.05% 15-10-2030             | 334.922,74                 | 0,41                         | 83.000,00          | United Rentals North America 3.75% 15-01-2032   | 83.581,21                  | 0,10                         |
| 66.000,00          | Kraft Heinz Foods Co 4.875% 01-10-2049         | 82.726,88                  | 0,10                         | 120.000,00         | United Rentals North America 4% 15-07-2030  | 123.705,60                 | 0,15                         |
| 55.000,00          | Kraft Heinz Foods Co 5% 04-06-2042             | 67.728,97                  | 0,08                         | 76.000,00          | United Rentals North America 5.5% 15-05-2027  | 79.040,00                  | 0,10                         |
| 124.000,00         | Kraft Heinz Foods Co 5% 15-07-2035             | 151.720,51                 | 0,19                         | 436.000,00         | Virgin Media Secured Finance 5.5% 15-05-2029  | 455.620,00                 | 0,56                         |
| 66.000,00          | Kraft Heinz Foods Co 6.875% 26-01-2039         | 96.578,63                  | 0,12                         | 186.000,00         | Virstra Operations Co LLC 4.375% 01-05-2029   | 186.303,18                 | 0,23                         |
| 136.000,00         | Lumen Technologies Inc 4.5% 15-01-2029         | 131.580,00                 | 0,16                         | 340.000,00         | Vmed O2 UK Financing I PLC 4.25% 31-01-2031   | 333.200,00                 | 0,41                         |
| 225.000,00         | Lumen Technologies Inc 7.5% 01-04-2024         | 246.375,00                 | 0,30                         | 290.000,00         | Ziggo Bond Co BV 6% 15-01-2027  | 298.700,00                 | 0,37                         |
| 118.000,00         | Meritage Homes Corp 5.125% 06-06-2027          | 130.095,00                 | 0,16                         |                    |   | <b>18.395.256,54</b>       | <b>22,52</b>                 |
| 29.000,00          | Meritage Homes Corp 6% 01-06-2025              | 32.216,10                  | 0,04                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>34.545.476,54</b>       | <b>42,29</b>                 |
| 188.000,00         | MGM Resorts International 5.75% 15-06-2025     | 203.372,76                 | 0,25                         |                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>34.545.476,54</b>       | <b>42,29</b>                 |
| 200.000,00         | Mongolia Government Internat 5.625% 01-05-2023 | 205.753,49                 | 0,25                         |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
| 203.000,00         | MPT Operating Partnership LP 3.5% 15-03-2031   | 205.791,25                 | 0,25                         |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
| 55.000,00          | Navient Corp 5% 15-03-2027                     | 56.057,10                  | 0,07                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 58.000,00          | Navient Corp 5.5% 15-03-2029                   | 57.855,00                  | 0,07                         | 173.000,00         | 1011778 BC ULC / New Red Fin 4% 15-10-2030  | 169.972,50                 | 0,21                         |
| 79.000,00          | NuStar Logistics LP 5.625% 28-04-2027          | 83.542,50                  | 0,10                         | 145.000,00         | Acadia Healthcare Co Inc 5% 15-04-2029  | 148.987,50                 | 0,18                         |
| 45.000,00          | NuStar Logistics LP 5.75% 01-10-2025           | 48.425,40                  | 0,06                         | 35.000,00          | AdaptHealth LLC 4.625% 01-08-2029   | 35.000,00                  | 0,04                         |
| 34.000,00          | NuStar Logistics LP 6% 01-06-2026              | 36.635,00                  | 0,04                         | 40.000,00          | AdaptHealth LLC 5.125% 01-03-2030   | 40.700,00                  | 0,05                         |
| 185.000,00         | Occidental Petroleum Corp 5.875% 01-09-2025    | 203.962,50                 | 0,25                         | 184.000,00         | AdaptHealth LLC 6.125% 01-08-2028   | 195.040,00                 | 0,24                         |
| 39.000,00          | Occidental Petroleum Corp 6.125% 01-01-2031    | 47.385,00                  | 0,06                         | 207.000,00         | Albertsons Cos Inc / Safeway 3.5% 15-03-2029  | 207.196,65                 | 0,25                         |
| 96.000,00          | Occidental Petroleum Corp 6.625% 01-09-2030    | 118.800,00                 | 0,15                         | 94.000,00          | Albertsons Cos Inc / Safeway 4.625% 15-01-2027  | 98.465,00                  | 0,12                         |
| 199.000,00         | Olin Corp 5.125% 15-09-2027                    | 204.223,75                 | 0,25                         | 52.000,00          | Albertsons Cos Inc / Safeway 7.5% 15-03-2026  | 55.510,00                  | 0,07                         |
| 74.000,00          | Olin Corp 5.625% 01-08-2029                    | 80.138,30                  | 0,10                         | 102.000,00         | Allison Transmission Inc 3.75% 30-01-2031   | 98.685,00                  | 0,12                         |
| 310.000,00         | Petroleos Mexicanos 6.7% 16-02-2032            | 312.371,50                 | 0,38                         | 200.000,00         | Altice Financing SA 5% 15-01-2028   | 195.178,00                 | 0,24                         |
| 735.000,00         | Petroleos Mexicanos 7.69% 23-01-2050           | 707.602,88                 | 0,87                         | 325.000,00         | American Airlines Group Inc 3.75% 01-03-2025  | 299.812,50                 | 0,37                         |
| 61.000,00          | Royal Caribbean Cruises Ltd 5.5% 01-04-2028    | 61.915,00                  | 0,08                         | 5.000,00           | American Airlines Group Inc 5% 01-06-2022   | 4.987,50                   | 0,01                         |
| 151.000,00         | SM Energy Co 6.625% 15-01-2027                 | 155.530,00                 | 0,19                         | 107.000,00         | American Airlines Inc/AAAdvn 5.5% 20-04-2026  | 110.745,00                 | 0,14                         |
| 160.000,00         | SM Energy Co 6.75% 15-09-2026                  | 164.400,00                 | 0,20                         | 106.000,00         | Antero Midstream Partners LP 5.375% 15-06-2029  | 110.770,00                 | 0,14                         |
| 50.000,00          | Southwestern Energy Co 4.75% 01-02-2032        | 52.825,25                  | 0,06                         | 110.000,00         | Antero Midstream Partners LP 7.875% 15-05-2026  | 120.587,50                 | 0,15                         |
| 78.000,00          | Southwestern Energy Co 5.375% 15-03-2030       | 83.460,00                  | 0,10                         | 120.000,00         | Arches Buyer Inc 4.25% 01-06-2028   | 119.892,00                 | 0,15                         |
| 286.000,00         | Sprint Corp 7.125% 15-06-2024                  | 320.320,00                 | 0,39                         | 143.000,00         | Archrock Partners LP / Archr 6.25% 01-04-2028   | 149.108,96                 | 0,18                         |
| 205.000,00         | Sprint Corp 7.625% 01-03-2026                  | 246.123,00                 | 0,30                         |                    |   |                            |                              |
| 142.000,00         | Standard Industries Inc/NJ 3.375% 15-01-2031   | 135.255,00                 | 0,17                         |                    |   |                            |                              |
| 73.000,00          | Summit Midstream Holdings LL 5.75% 15-04-2025  | 65.335,00                  | 0,08                         |                    |   |                            |                              |
| 162.000,00         | Targa Resources Partners LP 5.875% 15-04-2026  | 168.480,00                 | 0,21                         |                    |   |                            |                              |
| 80.000,00          | Telecom Italia Capital SA 6% 30-09-2034        | 84.612,80                  | 0,10                         |                    |   |                            |                              |
| 137.000,00         | Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-11-2033    | 147.521,60                 | 0,18                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged

## Aufstellung der Wertpapiieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 62.000,00          | Ashton Woods USA LLC / Ashto 4.625% 01-04-2030 | 61.306,22                  | 0,08                         | 84.000,00          | Civitas Resources Inc 5% 15-10-2026                | 85.041,60                  | 0,10                         |
| 60.000,00          | Ashton Woods USA LLC / Ashto 4.625% 01-08-2029 | 59.250,00                  | 0,07                         | 38.724,00          | Civitas Resources Inc 7.5% 30-04-2026              | 38.724,00                  | 0,05                         |
| 77.000,00          | Ashton Woods USA LLC / Ashto 6.625% 15-01-2028 | 81.235,00                  | 0,10                         | 156.000,00         | Clarios Global LP / Clarios 6.25% 15-05-2026       | 163.215,00                 | 0,20                         |
| 338.000,00         | Associated Materials LLC / A 9% 01-09-2025     | 360.375,60                 | 0,44                         | 190.000,00         | Clarios Global LP / Clarios 8.5% 15-05-2027        | 201.400,00                 | 0,25                         |
| 549.000,00         | Avaya Inc 6.125% 15-09-2028                    | 581.940,00                 | 0,71                         | 76.000,00          | Clear Channel Outdoor Holdin 7.5% 01-06-2029       | 81.510,00                  | 0,10                         |
| 85.000,00          | Bath & Body Works Inc 6.625% 01-10-2030        | 96.262,50                  | 0,12                         | 93.000,00          | Clear Channel Outdoor Holdin 7.75% 15-04-2028      | 100.207,50                 | 0,12                         |
| 21.000,00          | Bath & Body Works Inc 9.375% 01-07-2025        | 25.620,00                  | 0,03                         | 200.000,00         | Clear Channel Worldwide Hold 5.125% 15-08-2027     | 206.000,00                 | 0,25                         |
| 180.000,00         | Bausch Health Americas Inc 8.5% 31-01-2027     | 189.000,00                 | 0,23                         | 33.000,00          | Clearway Energy Operating LL 3.75% 15-02-2031      | 33.031,68                  | 0,04                         |
| 236.000,00         | Bausch Health Cos Inc 5% 15-02-2029            | 208.270,00                 | 0,25                         | 179.000,00         | Clearway Energy Operating LL 4.75% 15-03-2028      | 188.173,75                 | 0,23                         |
| 37.000,00          | Bausch Health Cos Inc 5% 30-01-2028            | 34.040,00                  | 0,04                         | 155.000,00         | Cleveland-Cliffs Inc 6.75% 15-03-2026              | 163.331,25                 | 0,20                         |
| 37.000,00          | Bausch Health Cos Inc 5.25% 30-01-2030         | 32.560,00                  | 0,04                         | 210.000,00         | CommScope Inc 4.75% 01-09-2029                     | 207.900,00                 | 0,25                         |
| 112.000,00         | Beazer Homes USA Inc 7.25% 15-10-2029          | 124.600,00                 | 0,15                         | 159.000,00         | CommScope Inc 6% 01-03-2026                        | 163.770,00                 | 0,20                         |
| 138.000,00         | Big River Steel LLC / BRS Fi 6.625% 31-01-2029 | 149.212,50                 | 0,18                         | 107.000,00         | CommScope Inc 8.25% 01-03-2027                     | 109.407,50                 | 0,13                         |
| 119.000,00         | Boyd Gaming Corp 4.75% 01-12-2027              | 122.242,75                 | 0,15                         | 159.000,00         | CommScope Technologies LLC 6% 15-06-2025           | 159.000,00                 | 0,19                         |
| 49.000,00          | Boyd Gaming Corp 4.75% 15-06-2031              | 50.287,23                  | 0,06                         | 16.000,00          | Comstock Resources Inc 5.875% 15-01-2030           | 16.400,00                  | 0,02                         |
| 32.000,00          | Boyd Gaming Corp 8.625% 01-06-2025             | 34.240,00                  | 0,04                         | 161.000,00         | Conduent Business Services L 6% 01-11-2029         | 159.188,75                 | 0,19                         |
| 161.000,00         | Boyer USA Inc 4.75% 15-05-2029                 | 166.761,39                 | 0,20                         | 237.000,00         | Connect Finco SARL / Connect 6.75% 01-10-2026      | 249.146,25                 | 0,31                         |
| 56.000,00          | Builders FirstSource Inc 4.25% 01-02-2032      | 58.240,00                  | 0,07                         | 169.000,00         | Coty Inc 5% 15-04-2026                             | 173.436,25                 | 0,21                         |
| 37.000,00          | Builders FirstSource Inc 5% 01-03-2030         | 39.682,50                  | 0,05                         | 56.000,00          | Coty Inc 6.5% 15-04-2026                           | 57.540,00                  | 0,07                         |
| 197.000,00         | Builders FirstSource Inc 6.75% 01-06-2027      | 207.835,00                 | 0,25                         | 80.000,00          | Crown Americas LLC / Crown A 4.75% 01-02-2026      | 82.000,00                  | 0,10                         |
| 148.000,00         | Caesars Entertainment Inc 4.625% 15-10-2029    | 148.489,88                 | 0,18                         | 16.000,00          | CrownRock LP / CrownRock Fin 5% 01-05-2029         | 16.600,00                  | 0,02                         |
| 273.000,00         | Callon Petroleum Co 8.25% 15-07-2025           | 268.905,00                 | 0,33                         | 156.000,00         | CrownRock LP / CrownRock Fin 5.625% 15-10-2025     | 159.510,00                 | 0,20                         |
| 264.000,00         | Calpine Corp 4.5% 15-02-2028                   | 273.240,00                 | 0,33                         | 343.000,00         | CSC Holdings LLC 4.5% 15-11-2031                   | 338.712,50                 | 0,41                         |
| 49.000,00          | Calpine Corp 5% 01-02-2031                     | 49.000,00                  | 0,06                         | 364.000,00         | CSC Holdings LLC 4.625% 01-12-2030                 | 344.435,00                 | 0,42                         |
| 164.000,00         | Calpine Corp 5.125% 15-03-2028                 | 166.486,24                 | 0,20                         | 208.000,00         | CSC Holdings LLC 6.5% 01-02-2029                   | 222.560,00                 | 0,27                         |
| 39.000,00          | Calpine Corp 5.25% 01-06-2026                  | 40.023,75                  | 0,05                         | 272.000,00         | CSC Holdings LLC 7.5% 01-04-2028                   | 291.720,00                 | 0,36                         |
| 111.000,00         | Carnival Corp 6% 01-05-2029                    | 110.445,00                 | 0,14                         | 122.000,00         | CSI Compressco LP / CSI Comp 7.5% 01-04-2025       | 122.915,00                 | 0,15                         |
| 389.000,00         | Cascades Inc/Cascades USA In 5.375% 15-01-2028 | 398.725,00                 | 0,49                         | 203.377,00         | CSI Compressco LP / CSI Compressco Finance Inc 01- | 199.309,46                 | 0,24                         |
| 78.000,00          | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.25% 01-02-2031  | 78.780,00                  | 0,10                         | 138.000,00         | Cushman & Wakefield US Borro 6.75% 15-05-2028      | 148.708,80                 | 0,18                         |
| 120.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.25% 15-01-2034  | 118.059,30                 | 0,14                         | 270.000,00         | Dana Financing Luxembourg Sa 5.75% 15-04-2025      | 276.412,50                 | 0,34                         |
| 95.000,00          | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.5% 01-05-2032   | 97.375,00                  | 0,12                         | 217.000,00         | DaVita Inc 3.75% 15-02-2031                        | 211.032,50                 | 0,26                         |
| 66.000,00          | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.5% 15-08-2030   | 67.581,36                  | 0,08                         | 199.000,00         | DaVita Inc 4.625% 01-06-2030                       | 203.726,25                 | 0,25                         |
| 438.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.75% 01-03-2030  | 455.520,00                 | 0,56                         | 147.000,00         | DCP Midstream LP 7.375% MULTI Perp FC2022          | 145.162,50                 | 0,18                         |
| 169.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 5% 01-02-2028     | 175.760,00                 | 0,22                         | 150.000,00         | DCP Midstream Operating LP 5.375% 15-07-2025       | 164.787,00                 | 0,20                         |
| 140.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 5.375% 01-06-2029 | 150.761,80                 | 0,18                         | 317.000,00         | Diamond Sports Group LLC / D 5.375% 15-08-2026     | 160.940,90                 | 0,20                         |
| 120.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 5.5% 01-05-2026   | 123.300,00                 | 0,15                         | 131.000,00         | Directv Financing LLC / Dire 5.875% 15-08-2027     | 134.416,48                 | 0,16                         |
| 181.000,00         | Century Communities Inc 3.875% 15-08-2029      | 182.357,50                 | 0,22                         | 125.000,00         | DISH DBS Corp 5.25% 01-12-2026                     | 127.187,50                 | 0,16                         |
| 105.000,00         | Century Communities Inc 6.75% 01-06-2027       | 110.250,00                 | 0,13                         | 130.000,00         | DISH DBS Corp 5.75% 01-12-2028                     | 130.975,00                 | 0,16                         |
| 61.000,00          | Cheniere Corpus Christi Hold 5.875% 31-03-2025 | 67.645,63                  | 0,08                         | 59.000,00          | DISH DBS Corp 7.375% 01-07-2028                    | 59.737,50                  | 0,07                         |
| 38.000,00          | Cheniere Energy Inc 4.625% 15-10-2028          | 40.090,00                  | 0,05                         | 155.000,00         | DISH DBS Corp 7.75% 01-07-2026                     | 163.525,00                 | 0,20                         |
| 207.000,00         | Cheniere Energy Partners LP 4% 01-03-2031      | 217.350,00                 | 0,27                         | 175.000,00         | Domtar Corp 6.75% 01-10-2028                       | 179.375,00                 | 0,22                         |
| 79.000,00          | CHS/Community Health Systems 5.625% 15-03-2027 | 83.608,07                  | 0,10                         | 311.000,00         | Eagle Intermediate Global Ho 7.5% 01-05-2025       | 281.641,60                 | 0,34                         |
| 497.000,00         | CHS/Community Health Systems 8% 15-03-2026     | 522.471,25                 | 0,64                         | 303.000,00         | Endo Dac / Endo Finance LLC 6% 30-06-2028          | 226.413,72                 | 0,28                         |
|                    |  |                            |                              | 118.000,00         | Endo Dac / Endo Finance LLC 9.5% 31-07-2027        | 120.114,56                 | 0,15                         |
|                    |  |                            |                              | 60.000,00          | EQM Midstream Partners LP 6% 01-07-2025            | 64.800,00                  | 0,08                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 67.000,00          | EQM Midstream Partners LP 6.5% 01-07-2027      | 75.040,00                  | 0,09                         | 82.000,00          | Ladder Capital Finance Holdi 4.25% 01-02-2027  | 82.270,60                  | 0,10                         |
| 325.000,00         | First Quantum Minerals Ltd 7.5% 01-04-2025     | 334.327,50                 | 0,41                         | 224.000,00         | LCPR Senior Secured Financin 5.125% 15-07-2029 | 225.120,00                 | 0,28                         |
| 242.000,00         | Flex Acquisition Co Inc 6.875% 15-01-2025      | 242.290,40                 | 0,30                         | 180.000,00         | LCPR Senior Secured Financin 6.75% 15-10-2027  | 189.000,00                 | 0,23                         |
| 86.000,00          | Flex Acquisition Co Inc 7.875% 15-07-2026      | 89.225,00                  | 0,11                         | 271.000,00         | Level 3 Financing Inc 3.625% 15-01-2029        | 257.450,00                 | 0,32                         |
| 74.000,00          | Frontier Communications Hold 5% 01-05-2028     | 75.850,00                  | 0,09                         | 66.000,00          | Level 3 Financing Inc 3.75% 15-07-2029         | 62.700,00                  | 0,08                         |
| 116.000,00         | Frontier Communications Hold 5.875% 15-10-2027 | 122.670,00                 | 0,15                         | 207.000,00         | Level 3 Financing Inc 4.25% 01-07-2028         | 204.930,00                 | 0,25                         |
| 124.000,00         | Frontier Communications Hold 6% 15-01-2030     | 123.380,00                 | 0,15                         | 459.000,00         | Lincoln National Corp FRN 17-05-2066           | 407.362,50                 | 0,50                         |
| 143.000,00         | Frontier Communications Hold 6.75% 01-05-2029  | 148.005,00                 | 0,18                         | 161.000,00         | Lions Gate Capital Holdings 5.5% 15-04-2029    | 164.220,00                 | 0,20                         |
| 184.000,00         | FXI Holdings Inc 12.25% 15-11-2026             | 206.779,20                 | 0,25                         | 146.000,00         | LPL Holdings Inc 4% 15-03-2029                 | 149.467,50                 | 0,18                         |
| 33.000,00          | Gap Inc/The 3.625% 01-10-2029                  | 32.505,00                  | 0,04                         | 162.000,00         | LSF9 Atlantis Holdings LLC / 7.75% 15-02-2026  | 163.809,54                 | 0,20                         |
| 33.000,00          | Gap Inc/The 3.875% 01-10-2031                  | 32.546,25                  | 0,04                         | 279.000,00         | Lumen Technologies Inc 5.125% 15-12-2026       | 290.712,42                 | 0,36                         |
| 165.000,00         | Garda World Security Corp 4.625% 15-02-2027    | 165.000,00                 | 0,20                         | 167.000,00         | Lumen Technologies Inc 5.375% 15-06-2029       | 167.000,00                 | 0,20                         |
| 142.000,00         | Garda World Security Corp 6% 01-06-2029        | 136.474,78                 | 0,17                         | 590.000,00         | MARB BondCo PLC 3.95% 29-01-2031               | 564.193,40                 | 0,69                         |
| 84.000,00          | Gartner Inc 3.75% 01-10-2030                   | 85.881,60                  | 0,11                         | 59.000,00          | Marriott Ownership Resorts I 4.5% 15-06-2029   | 59.384,68                  | 0,07                         |
| 196.000,00         | Gartner Inc 4.5% 01-07-2028                    | 204.699,46                 | 0,25                         | 353.000,00         | Mauser Packaging Solutions H 5.5% 15-04-2024   | 356.237,01                 | 0,44                         |
| 202.000,00         | Glatfelter Corp 4.75% 15-11-2029               | 208.312,50                 | 0,26                         | 37.000,00          | Meritor Inc 4.5% 15-12-2028                    | 37.092,50                  | 0,05                         |
| 145.000,00         | Global Atlantic Fin Co 4.700% MULTI 15-10-2051 | 146.966,78                 | 0,18                         | 200.000,00         | MGM China Holdings Ltd 5.375% 15-05-2024       | 199.340,00                 | 0,24                         |
| 126.000,00         | Goodyear Tire & Rubber Co/Th 5% 15-07-2029     | 135.349,20                 | 0,17                         | 146.000,00         | MGM Growth Properties Operat 3.875% 15-02-2029 | 153.866,12                 | 0,19                         |
| 124.000,00         | Graphic Packaging Internatio 3.5% 01-03-2029   | 123.070,00                 | 0,15                         | 61.000,00          | MGM Growth Properties Operat 4.625% 15-06-2025 | 64.965,00                  | 0,08                         |
| 217.000,00         | Graphic Packaging Internatio 3.5% 15-03-2028   | 216.457,50                 | 0,27                         | 144.000,00         | MGM Growth Properties Operat 5.75% 01-02-2027  | 162.360,00                 | 0,20                         |
| 153.000,00         | Gray Escrow II Inc 5.375% 15-11-2031           | 157.190,67                 | 0,19                         | 214.000,00         | Mineral Resources Ltd 8.125% 01-05-2027        | 230.730,52                 | 0,28                         |
| 211.000,00         | Gray Television Inc 4.75% 15-10-2030           | 209.945,00                 | 0,26                         | 147.000,00         | Moss Creek Resources Holding 10.5% 15-05-2027  | 147.183,75                 | 0,18                         |
| 194.000,00         | Gray Television Inc 7% 15-05-2027              | 207.337,50                 | 0,25                         | 167.000,00         | Mozart Debt Merger Sub Inc 3.875% 01-04-2029   | 166.165,00                 | 0,20                         |
| 236.000,00         | Greif Inc 6.5% 01-03-2027                      | 244.850,01                 | 0,30                         | 199.000,00         | MSCI Inc 3.625% 01-09-2030                     | 203.477,50                 | 0,25                         |
| 300.000,00         | Hartford Financial Services FRN 12-02-2047     | 285.816,39                 | 0,35                         | 242.000,00         | Navigent Corp 5.875% 25-10-2024                | 257.730,00                 | 0,32                         |
| 73.000,00          | HAT Holdings I LLC / HAT Hol 6% 15-04-2025     | 75.737,50                  | 0,09                         | 77.000,00          | NCL Corp Ltd 10.25% 01-02-2026                 | 89.512,50                  | 0,11                         |
| 336.000,00         | Helios Software Holdings Inc 4.625% 01-05-2028 | 329.280,00                 | 0,40                         | 102.000,00         | NCL Corp Ltd 12.25% 15-05-2024                 | 120.870,00                 | 0,15                         |
| 274.000,00         | Herc Holdings Inc 5.5% 15-07-2027              | 284.960,00                 | 0,35                         | 146.000,00         | NCL Corp Ltd 3.625% 15-12-2024                 | 138.700,00                 | 0,17                         |
| 19.000,00          | Hertz Corp/The 4.625% 01-12-2026               | 19.118,75                  | 0,02                         | 251.000,00         | NCR Corp 5.125% 15-04-2029                     | 259.157,50                 | 0,32                         |
| 39.000,00          | Hertz Corp/The 5% 01-12-2029                   | 39.033,35                  | 0,05                         | 104.000,00         | NCR Corp 5.25% 01-10-2030                      | 106.860,00                 | 0,13                         |
| 9.000,00           | Hess Midstream Operations LP 4.25% 15-02-2030  | 8.932,50                   | 0,01                         | 108.000,00         | NCR Corp 5.75% 01-09-2027                      | 112.590,00                 | 0,14                         |
| 157.000,00         | Hess Midstream Operations LP 5.125% 15-06-2028 | 163.476,25                 | 0,20                         | 114.000,00         | NCR Corp 6.125% 01-09-2029                     | 121.825,26                 | 0,15                         |
| 228.000,00         | Hexion Inc 7.875% 15-07-2027                   | 240.540,00                 | 0,29                         | 81.000,00          | New Gold Inc 6.375% 15-05-2025                 | 83.227,50                  | 0,10                         |
| 153.000,00         | Hilton Domestic Operating Co 4.875% 15-01-2030 | 163.518,75                 | 0,20                         | 212.000,00         | New Gold Inc 7.5% 15-07-2027                   | 225.250,00                 | 0,28                         |
| 20.000,00          | Hilton Domestic Operating Co 5.375% 01-05-2025 | 20.812,00                  | 0,03                         | 118.000,00         | Nielsen Finance LLC / Nielse 4.5% 15-07-2029   | 116.081,32                 | 0,14                         |
| 85.000,00          | Hilton Grand Vacations Borro 5% 01-06-2029     | 87.125,00                  | 0,11                         | 142.000,00         | Nielsen Finance LLC / Nielse 5.625% 01-10-2028 | 146.260,00                 | 0,18                         |
| 265.600,00         | iHeartCommunications Inc 8.375% 01-05-2027     | 280.208,00                 | 0,34                         | 72.000,00          | Nielsen Finance LLC / Nielse 5.875% 01-10-2030 | 75.510,00                  | 0,09                         |
| 232.000,00         | Iliad Holding SASU 6.5% 15-10-2026             | 243.769,36                 | 0,30                         | 349.000,00         | NOVA Chemicals Corp 4.875% 01-06-2024          | 360.778,75                 | 0,44                         |
| 209.000,00         | Intelsat Jackson Holdings SA 15-10-2024        | 95.781,57                  | 0,12                         | 269.000,00         | NOVA Chemicals Corp 5.25% 01-06-2027           | 286.485,00                 | 0,35                         |
| 200.000,00         | Intesa Sanpaolo SpA 4.198% MULTI 01-06-2032    | 201.900,56                 | 0,25                         | 21.000,00          | Novelis Corp 3.25% 15-11-2026                  | 21.183,75                  | 0,03                         |
| 274.000,00         | Intesa Sanpaolo SpA 5.71% 15-01-2026           | 303.208,39                 | 0,37                         | 20.000,00          | Novelis Corp 3.875% 15-08-2031                 | 19.875,00                  | 0,02                         |
| 75.000,00          | Iron Mountain Inc 4.5% 15-02-2031              | 75.801,75                  | 0,09                         | 61.000,00          | NRG Energy Inc 3.875% 15-02-2032               | 59.780,00                  | 0,07                         |
| 315.000,00         | Iron Mountain Inc 5.25% 15-03-2028             | 327.600,00                 | 0,40                         | 214.000,00         | Oasis Midstream Partners LP 8% 01-04-2029      | 232.917,60                 | 0,29                         |
| 153.000,00         | Kraft Heinz Foods Co 3.875% 15-05-2027         | 165.350,45                 | 0,20                         | 107.000,00         | Oasis Petroleum Inc 6.375% 01-06-2026          | 111.815,00                 | 0,14                         |
|                    |  |                            |                              | 132.000,00         | Occidental Petroleum Corp 6.2% 15-03-2040      | 162.360,00                 | 0,20                         |
|                    |  |                            |                              | 227.000,00         | Occidental Petroleum Corp 6.45% 15-09-2036     | 289.425,00                 | 0,35                         |
|                    |  |                            |                              | 323.000,00         | Ohio National Financial Serv 5.8% 24-01-2030   | 365.981,35                 | 0,45                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged

## Aufstellung der Wertpapiieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal                              | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------------------|------------------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 156.000,00 Owens-Brockway Glass Contain<br>5.875% 15-08-2023 | 163.410,00                 | 0,20                         | 206.000,00 Tenet Healthcare Corp 4.875%<br>01-01-2026   | 211.588,78                 | 0,26                         |
| 127.000,00 Pactiv Evergreen Group Issue 4%<br>15-10-2027     | 123.507,50                 | 0,15                         | 206.000,00 Tenet Healthcare Corp 5.125%<br>01-11-2027   | 214.755,00                 | 0,26                         |
| 213.000,00 Par Pharmaceutical Inc 7.5%<br>01-04-2027         | 217.526,25                 | 0,27                         | 33.000,00 Tenet Healthcare Corp 7.5%<br>01-04-2025  | 34.730,85                  | 0,04                         |
| 63.000,00 Park Intermediate Holdings L<br>5.875% 01-10-2028  | 65.885,40                  | 0,08                         | 110.000,00 Travel + Leisure Co 4.5% 01-12-<br>2029  | 110.933,35                 | 0,14                         |
| 161.000,00 Park Intermediate Holdings L 7.5%<br>01-06-2025   | 170.131,92                 | 0,21                         | 29.000,00 Triumph Group Inc 8.875% 01-<br>06-2024   | 31.729,48                  | 0,04                         |
| 58.000,00 Parkland Corp 4.5% 01-10-2029                      | 57.710,00                  | 0,07                         | 243.000,00 Uber Technologies Inc 4.5%<br>15-08-2029   | 247.252,50                 | 0,30                         |
| 71.000,00 Parkland Corp 4.625% 01-05-2030                    | 70.556,25                  | 0,09                         | 25.000,00 Uber Technologies Inc 6.25%<br>15-01-2028   | 26.750,00                  | 0,03                         |
| 70.000,00 Parkland Corp 5.875% 15-07-2027                    | 73.943,80                  | 0,09                         | 225.000,00 Uber Technologies Inc 7.5%<br>15-09-2027   | 244.145,25                 | 0,30                         |
| 193.000,00 Patrick Industries Inc 7.5% 15-<br>10-2027        | 205.545,00                 | 0,25                         | 185.000,00 Uber Technologies Inc 8% 01-<br>11-2026  | 197.025,00                 | 0,24                         |
| 105.000,00 Post Holdings Inc 4.5% 15-09-2031                 | 104.212,50                 | 0,13                         | 608.000,00 UniCredit SpA 5.861% MULTI<br>19-06-2032   | 664.176,38                 | 0,81                         |
| 66.000,00 Post Holdings Inc 4.625% 15-<br>04-2030            | 67.221,00                  | 0,08                         | 42.000,00 Unifrax Escrow Issuer Corp 5.25%<br>30-09-2028  | 42.451,50                  | 0,05                         |
| 332.000,00 Post Holdings Inc 5.5% 15-12-2029                 | 348.185,00                 | 0,43                         | 48.000,00 Unifrax Escrow Issuer Corp 7.5%<br>30-09-2029   | 48.480,00                  | 0,06                         |
| 174.000,00 Rackspace Technology Global<br>3.5% 15-02-2028    | 164.430,00                 | 0,20                         | 139.000,00 United Airlines 2014-2 Class<br>4.625% 03-09-2022  | 62.902,64                  | 0,08                         |
| 207.000,00 Rite Aid Corp 7.5% 01-07-2025                     | 212.796,01                 | 0,26                         | 141.000,00 United Wholesale Mortgage LL<br>5.5% 15-11-2025  | 143.643,75                 | 0,18                         |
| 200.000,00 Rite Aid Corp 8% 15-11-2026                       | 204.000,00                 | 0,25                         | 125.000,00 United Wholesale Mortgage LL<br>5.75% 15-06-2027   | 125.280,00                 | 0,15                         |
| 72.000,00 Royal Caribbean Cruises Ltd<br>10.875% 01-06-2023  | 78.660,00                  | 0,10                         | 161.000,00 Univision Communications Inc<br>6.625% 01-06-2027  | 173.463,82                 | 0,21                         |
| 45.000,00 Royal Caribbean Cruises Ltd 11.5%<br>01-06-2025    | 50.400,00                  | 0,06                         | 401.000,00 UPC Broadband Finco BV 4.875%<br>15-07-2031  | 409.020,00                 | 0,50                         |
| 214.000,00 SBA Communications Corp 3.125%<br>01-02-2029      | 205.440,00                 | 0,25                         | 118.000,00 USA Compression Partners LP<br>6.875% 01-09-2027   | 124.637,50                 | 0,15                         |
| 143.000,00 SBA Communications Corp<br>3.875% 15-02-2027      | 147.290,00                 | 0,18                         | 107.000,00 Vertiv Group Corp 4.125% 15-<br>11-2028  | 108.070,00                 | 0,13                         |
| 200.000,00 Sensata Technologies BV 4%<br>15-04-2029          | 204.250,00                 | 0,25                         | 120.000,00 Viking Cruises Ltd 5.875% 15-<br>09-2027   | 114.300,00                 | 0,14                         |
| 88.000,00 Sinclair Television Group In 4.125%<br>01-12-2030  | 83.380,00                  | 0,10                         | 376.000,00 Viking Cruises Ltd 6.25% 15-05-<br>2025  | 372.240,00                 | 0,46                         |
| 87.000,00 Sinclair Television Group In 5.5%<br>01-03-2030    | 84.390,00                  | 0,10                         | 186.000,00 Vistra Operations Co LLC 5%<br>31-07-2027  | 192.510,00                 | 0,24                         |
| 59.000,00 Sirius XM Radio Inc 3.125% 01-<br>09-2026          | 59.017,11                  | 0,07                         | 58.000,00 Vistra Operations Co LLC 5.625%<br>15-02-2027   | 59.740,00                  | 0,07                         |
| 46.000,00 Sirius XM Radio Inc 4.125% 01-<br>07-2030          | 46.000,00                  | 0,06                         | 216.000,00 Vmed O2 UK Financing I PLC<br>4.75% 15-07-2031   | 218.160,00                 | 0,27                         |
| 23.000,00 Sirius XM Radio Inc 5% 01-08-<br>2027              | 23.862,50                  | 0,03                         | 148.000,00 Wabash National Corp 4.5%<br>15-10-2028  | 149.480,00                 | 0,18                         |
| 152.000,00 Sirius XM Radio Inc 5.5% 01-07-<br>2029           | 163.780,00                 | 0,20                         | 155.000,00 WW International Inc 4.5% 15-<br>04-2029   | 148.059,10                 | 0,18                         |
| 121.000,00 Spectrum Brands Inc 3.875%<br>15-03-2031          | 119.487,50                 | 0,15                         | 212.000,00 Zayo Group Holdings Inc 4%<br>01-03-2027   | 209.350,00                 | 0,26                         |
| 238.000,00 SRM Escrow Issuer LLC 6%<br>01-11-2028            | 253.543,78                 | 0,31                         | 278.000,00 Ziggo BV 5.5% 15-01-2027   | 285.645,00                 | 0,35                         |
| 120.000,00 Standard Industries Inc/NJ 5%<br>15-02-2027       | 123.015,60                 | 0,15                         |   | <b>42.833.999,18</b>       | <b>52,44</b>                 |
| 283.000,00 Staples Inc 7.5% 15-04-2026                       | 289.367,50                 | 0,35                         | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>42.833.999,18</b>       | <b>52,44</b>                 |
| 188.000,00 Station Casinos LLC 4.5% 15-<br>02-2028           | 189.880,00                 | 0,23                         | <b>Aktien</b>   |                            |                              |
| 159.000,00 Stericycle Inc 5.375% 15-07-2024                  | 162.975,00                 | 0,20                         | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 298.000,00 Summer BC Bidco B LLC 5.5%<br>31-10-2026          | 305.068,56                 | 0,37                         | 6.654,00 Hexion Holdings  | 190.304,40                 | 0,23                         |
| 67.000,00 Summit Midstream Holdings LL<br>8.5% 15-10-2026    | 69.058,24                  | 0,08                         |   | <b>190.304,40</b>          | <b>0,23</b>                  |
| 282.000,00 Summit Midstream Partners LP                      | 207.270,00                 | 0,25                         | <b>Summe Aktien</b>   | <b>190.304,40</b>          | <b>0,23</b>                  |
| 71.000,00 Sunnova Energy Corp 5.875%<br>01-09-2026           | 72.420,00                  | 0,09                         | <b>Summe an einem anderen<br/>geregelten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b> | <b>43.024.303,58</b>       | <b>52,68</b>                 |
| 99.000,00 Switch Ltd 3.75% 15-09-2028                        | 99.742,50                  | 0,12                         |   |                            |                              |
| 151.000,00 Switch Ltd 4.125% 15-06-2029                      | 154.397,50                 | 0,19                         |   |                            |                              |
| 126.000,00 Targa Resources Partners LP 4%<br>15-01-2032      | 131.670,00                 | 0,16                         |   |                            |                              |
| 113.000,00 Targa Resources Partners LP<br>4.875% 01-02-2031  | 122.712,35                 | 0,15                         |   |                            |                              |
| 172.000,00 Targa Resources Partners LP 5%<br>15-01-2028      | 180.600,00                 | 0,22                         |   |                            |                              |
| 31.000,00 Targa Resources Partners LP<br>6.5% 15-07-2027     | 33.092,50                  | 0,04                         |   |                            |                              |
| 192.000,00 Taylor Morrison Communities<br>6.625% 15-07-2027  | 202.523,52                 | 0,25                         |   |                            |                              |
| 128.000,00 TEGNA Inc 4.625% 15-03-2028                       | 129.381,12                 | 0,16                         |   |                            |                              |
| 86.000,00 TEGNA Inc 4.75% 15-03-2026                         | 89.440,00                  | 0,11                         |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |
| 69.000,00   | Ultra Resources Inc/US 15-04-2022 NEW Escrow                            | 0,00                       | 0,00                         |
| 341.000,00  | Ultra Resources Inc/US 15-04-2025 NEW Escrow                            | 0,00                       | 0,00                         |
|   |   | <b>0,00</b>                | <b>0,00</b>                  |
|   | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>0,00</b>                | <b>0,00</b>                  |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |
| 21.043,00   | Homer City Generation - LLC unit  | 0,02                       | 0,00                         |
| 129.850,62  | New AMI I, LLC  | 753.133,59                 | 0,92                         |
|   |   | <b>753.133,61</b>          | <b>0,92</b>                  |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>753.133,61</b>          | <b>0,92</b>                  |
|   | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>753.133,61</b>          | <b>0,92</b>                  |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>78.322.913,73</b>       | <b>95,89</b>                 |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>2.021.679,48</b>        | <b>2,48</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>                                     | <b>1.333.199,30</b>        | <b>1,63</b>                  |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>81.677.792,51</b>       | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| USA                    | 60,60        | Unternehmensanleihen | 94,17        |
| Vereinigtes Königreich | 6,93         | Sonstige             | 0,92         |
| Niederlande            | 3,53         | Staatsanleihen       | 0,57         |
| Luxemburg              | 3,48         | Spezialchemikalien   | 0,23         |
| Länderübergreifend     | 3,37         |                      |              |
| Frankreich             | 3,13         | <b>Summe</b>         | <b>95,89</b> |
| Kanada                 | 3,00         |                      |              |
| Deutschland            | 1,78         |                      |              |
| Mexiko                 | 1,62         |                      |              |
| Italien                | 1,43         |                      |              |
| Bermuda                | 1,42         |                      |              |
| Schweiz                | 1,00         |                      |              |
| Jersey                 | 0,88         |                      |              |
| Schweden               | 0,78         |                      |              |
| Kaimaninseln           | 0,53         |                      |              |
| Irland                 | 0,51         |                      |              |
| Spanien                | 0,47         |                      |              |
| Panama                 | 0,35         |                      |              |
| Ecuador                | 0,32         |                      |              |
| Australien             | 0,28         |                      |              |
| Mongolei               | 0,25         |                      |              |
| Liberia                | 0,23         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>95,89</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 42.221.227,19                                     | EUR               | 47.562.860,15      | USD                | 285.486,59   | 28.01.2022 |
| 74.234.303,33                                     | NOK               | 8.290.797,09       | USD                | 126.631,40   | 28.01.2022 |
| 115.933.428,99                                    | SEK               | 12.889.451,11      | USD                | (78.042,53)  | 28.01.2022 |
| 633.844,85  | USD               | 560.615,63         | EUR                | (1.488,08)   | 28.01.2022 |
| 272.842,96  | USD               | 2.464.137,92       | NOK                | (6.565,58)   | 28.01.2022 |
| 399.827,32  | USD               | 3.627.738,69       | SEK                | (1.061,55)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>324.960,25</b>  |            |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                   |                    |                    |  |            |
| 15.931.779,06                                     | USD               | 13.987.000,00      | EUR                | 73.865,33  | 18.02.2022 |
| 400.232,00  | USD               | 297.000,00         | GBP                | (150,07)   | 18.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>73.715,26</b>   |            |
|   |                   |                    |                    | <b>398.675,51</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Latin American Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|---|--------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| <b>BRL</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 1.300,00  | Ambev   | 3.177,44                   | 0,01                         | 73.834,00   | Suzano ADR   | 699.455,98                 | 2,05                         |
| 122.424,00  | Atacadao  | 295.927,61                 | 0,87                         | 25.534,00   | TIM ADR      | 263.309,16                 | 0,77                         |
| 498.244,00  | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao                     | 879.784,58                 | 2,58                         | 118.807,00  | Vale ADR     | 1.466.403,44               | 4,31                         |
| 84.051,00   | Banco Bradesco                                  | 215.694,37                 | 0,63                         |   |              | 33.032,58                  | 0,10                         |
| 382.535,00  | Banco Bradesco                                  | 1.164.789,96               | 3,42                         |   |              | <b>8.909.605,99</b>        | <b>26,17</b>                 |
| 157.748,00  | Banco BTG Pactual                               | 525.088,17                 | 1,54                         | <b>Summe Aktien</b>   |              | <b>33.881.681,46</b>       | <b>99,54</b>                 |
| 201.983,00  | CCR   | 371.062,73                 | 1,09                         | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |              |                            |                              |
| 13.100,00   | Centrais Eletricas Brasileiras                  | 69.374,02                  | 0,20                         |   |              | <b>33.881.681,46</b>       | <b>99,54</b>                 |
| 13.200,00   | Centrais Eletricas Brasileiras                  | 69.066,67                  | 0,20                         | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  |              | <b>33.881.681,46</b>       | <b>99,54</b>                 |
| 98.116,00   | Energisa  | 690.046,47                 | 2,03                         | <b>Bankguthaben</b>   |              |                            |                              |
| 76.798,00   | Gerdau  | 331.837,02                 | 0,97                         |   |              | <b>369.993,50</b>          | <b>1,09</b>                  |
| 234.500,00  | Hapvida Participacoes e Investimentos           | 385.824,03                 | 1,13                         | <b>Sonstige Nettverbindlichkeiten</b>   |              |                            |                              |
| 325.144,00  | Itau Unibanco Holding                           | 1.079.714,29               | 3,17                         |   |              | <b>(212.394,44)</b>        | <b>(0,62)</b>                |
| 231.134,00  | Itausa  | 327.163,14                 | 0,96                         | <b>Summe Nettovermögen</b>  |              | <b>34.039.280,52</b>       | <b>100,00</b>                |
| 133.779,00  | Klabin  | 544.118,73                 | 1,60                         |   |              |                            |                              |
| 54.800,00   | Localiza Rent a Car                             | 460.368,40                 | 1,35                         |   |              |                            |                              |
| 194.122,00  | Lojas Renner                                    | 752.012,46                 | 2,21                         |   |              |                            |                              |
| 349.201,00  | Magazine Luiza                                  | 399.633,38                 | 1,17                         |   |              |                            |                              |
| 108.853,00  | Multiplan Empreendimentos Imobiliarios          | 322.994,65                 | 0,95                         |   |              |                            |                              |
| 63.113,00   | Notre Dame Intermedica Participacoes            | 603.733,36                 | 1,77                         |   |              |                            |                              |
| 266.919,00  | Petroleo Brasileiro                             | 1.298.873,75               | 3,82                         |   |              |                            |                              |
| 8.381,00  | Petroleo Brasileiro                             | 37.794,38                  | 0,11                         |   |              |                            |                              |
| 340.424,00  | Rumo  | 958.323,66                 | 2,82                         |   |              |                            |                              |
| 78.600,00   | Sequoia Logistica e Transportes                 | 176.165,57                 | 0,52                         |   |              |                            |                              |
| 8.688,00  | Suzano  | 82.778,13                  | 0,24                         |   |              |                            |                              |
| 145.725,00  | TOTVS   | 661.540,07                 | 1,94                         |   |              |                            |                              |
| 48.513,00   | Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas | 116.575,26                 | 0,34                         |   |              |                            |                              |
| 86.312,00   | Vale  | 1.066.576,69               | 3,13                         |   |              |                            |                              |
| 184.093,00  | Vibra Energia                                   | 624.453,53                 | 1,83                         |   |              |                            |                              |
| 100.524,00  | WEG   | 525.496,09                 | 1,54                         |   |              |                            |                              |
| 6.534,00  | XP  | 166.217,28                 | 0,49                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>15.206.205,89</b>       | <b>44,67</b>                 |   |              |                            |                              |
| <b>CLP</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 79.061,00   | Cencosud Shopping                               | 82.864,93                  | 0,24                         |   |              |                            |                              |
| 435.932,00  | Cencosud  | 644.007,47                 | 1,89                         |   |              |                            |                              |
| 70.087,00   | Empresas COPEC                                  | 478.538,06                 | 1,41                         |   |              |                            |                              |
| 41.400,00   | Falabella                                       | 119.274,11                 | 0,35                         |   |              |                            |                              |
| 203.457,00  | Parque Arauco                                   | 198.249,26                 | 0,58                         |   |              |                            |                              |
| 219.983,00  | Plaza   | 214.149,28                 | 0,63                         |   |              |                            |                              |
| 92,00   | Sociedad Quimica y Minera de Chile              | 4.147,86                   | 0,01                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>1.741.230,97</b>        | <b>5,12</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>MXN</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 1.616.230,00  | America Movil                                   | 1.514.061,82               | 4,45                         |   |              |                            |                              |
| 422.267,00  | Fibra Uno Administracion                        | 393.567,72                 | 1,16                         |   |              |                            |                              |
| 5.710,00  | Fomento Economico Mexicano                      | 38.987,14                  | 0,11                         |   |              |                            |                              |
| 152.007,00  | GCC   | 1.020.880,42               | 3,00                         |   |              |                            |                              |
| 294.793,00  | Genomma Lab Internacional                       | 270.301,25                 | 0,79                         |   |              |                            |                              |
| 12.863,00   | Grupo Aeroportuario del Sureste                 | 233.597,67                 | 0,69                         |   |              |                            |                              |
| 261.778,00  | Grupo Financiero Banorte                        | 1.513.099,59               | 4,45                         |   |              |                            |                              |
| 340.789,00  | Grupo Mexico                                    | 1.314.223,66               | 3,86                         |   |              |                            |                              |
| 206.676,00  | Macquarie Mexico Real Estate Management         | 231.637,20                 | 0,68                         |   |              |                            |                              |
| 229.522,00  | Orbia Advance Corp                              | 521.721,32                 | 1,53                         |   |              |                            |                              |
| 1,00  | Prologis Property Mexico                        | 2,41                       | 0,00                         |   |              |                            |                              |
| 294.896,00  | Wal-Mart de Mexico                              | 972.558,41                 | 2,86                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>8.024.638,61</b>        | <b>23,57</b>                 |   |              |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 12.185,00   | Afya  | 170.728,78                 | 0,50                         |   |              |                            |                              |
| 26.500,00   | Ambev ADR                                       | 65.159,14                  | 0,19                         |   |              |                            |                              |
| 103,00  | America Movil ADR                               | 1.931,51                   | 0,01                         |   |              |                            |                              |
| 187.831,00  | Banco Bradesco ADR                              | 571.295,46                 | 1,68                         |   |              |                            |                              |
| 9.415,00  | Credicorp                                       | 1.035.471,29               | 3,04                         |   |              |                            |                              |
| 15.975,00   | Fomento Economico Mexicano ADR                  | 1.093.208,19               | 3,21                         |   |              |                            |                              |
| 157.600,00  | Gerdau ADR                                      | 676.233,61                 | 1,99                         |   |              |                            |                              |
| 1.936,00  | Grupo Aeroportuario del Sureste ADR             | 348.621,87                 | 1,02                         |   |              |                            |                              |
| 18.977,00   | Grupo Televisa SAB ADR                          | 157.995,06                 | 0,46                         |   |              |                            |                              |
| 152.900,00  | Itau Unibanco Holding ADR                       | 506.899,31                 | 1,49                         |   |              |                            |                              |
| 125.933,00  | Petroleo Brasileiro ADR                         | 1.229.143,44               | 3,61                         |   |              |                            |                              |
| 39.075,00   | Petroleo Brasileiro ADR                         | 352.577,14                 | 1,04                         |   |              |                            |                              |
| 5.294,00  | Sociedad Quimica y Minera de Chile ADR          | 238.140,03                 | 0,70                         |   |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Latin American Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land         | Sektor  |
|--------------|---|
| Brasilien    | Verschiedene Banken                           |
| Mexiko       | Stahl   |
| Chile        | Integrierte Öl- und Gasunternehmen            |
| Bermuda      | Großmärkte                                    |
| Kaimaninseln | Drahtlose Telekommunikationsdienste           |
|              | Verschiedene Metall- und Bergbaubetriebe      |
|              | Alkoholfreie Getränke                         |
|              | Baumaterialien                                |
|              | Gesundheitswesen: Managed Health Care         |
|              | Schienerverkehr                               |
|              | Börsen und Finanzdaten                        |
|              | Kaufhäuser                                    |
|              | Stromversorger                                |
|              | Immobilien: REOC                              |
|              | Papierprodukte                                |
|              | Systemsoftware                                |
|              | Kraftfahrzeugeinzelhandel                     |
|              | Flughafendienste                              |
|              | Papierverpackungen                            |
|              | Verschiedene Kapitalmärkte                    |
|              | Elektrische Komponenten und Ausrüstung        |
|              | Rohstoffchemikalien                           |
|              | Öl- und Gasraffinerien und -marketing         |
|              | Spedition/Transport                           |
|              | Warenhäuser                                   |
|              | Immobilien: Verschiedene REITs                |
|              | Straßen- und Schienennetze                    |
|              | Pharmazeutika                                 |
|              | Dünger und Chemikalien für die Landwirtschaft |
|              | Immobilien: REITs (Gewerbe)                   |
|              | Investmentbanken und Broker                   |
|              | Luftfracht und Logistik                       |
|              | Bildungsdienstleistungen                      |
|              | Kabel und Satellitenübertragung               |
|              | Brauereien                                    |
| <b>Summe</b> | <b>Summe</b>                                  |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Latin American Equity Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 53.059,33   | EUR                | 247.529,08        | PLN                  | (665,96)  | 28.01.2022  |
| 1.902.420,30                                      | PLN                | 402.935,50        | EUR                  | 9.980,34  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>9.314,38</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - Long Duration US Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |
| 237.000,00  | United States Treasury Note/<br>2,25% 15-08-2046  | 250.359,02                 | 5,68                         |
| 199.000,00  | United States Treasury Note/ 2,5%<br>15-02-2046   | 219.669,57                 | 4,98                         |
| 267.000,00  | United States Treasury Note/<br>2,75% 15-11-2047  | 310.762,97                 | 7,05                         |
| 141.000,00  | United States Treasury Note/<br>2,875% 15-05-2043   | 163.692,19                 | 3,71                         |
| 281.000,00  | United States Treasury Note/<br>2,875% 15-05-2049   | 338.418,40                 | 7,68                         |
| 155.000,00  | United States Treasury Note/<br>2,875% 15-08-2045   | 181.888,87                 | 4,13                         |
| 192.000,00  | United States Treasury Note/<br>2,875% 15-11-2046   | 227.025,00                 | 5,15                         |
| 247.000,00  | United States Treasury Note/ 3%<br>15-02-2048   | 301.378,59                 | 6,84                         |
| 207.000,00  | United States Treasury Note/ 3%<br>15-05-2045   | 247.462,03                 | 5,61                         |
| 216.000,00  | United States Treasury Note/ 3%<br>15-05-2047   | 261.992,81                 | 5,94                         |
| 200.000,00  | United States Treasury Note/ 3%<br>15-11-2044   | 238.320,31                 | 5,41                         |
| 195.000,00  | United States Treasury Note/ 3%<br>15-11-2045   | 234.068,55                 | 5,31                         |
| 213.000,00  | United States Treasury Note/<br>3,125% 15-05-2048   | 266.116,88                 | 6,04                         |
| 165.000,00  | United States Treasury Note/<br>3,125% 15-08-2044   | 200.236,52                 | 4,54                         |
| 113.000,00  | United States Treasury Note/<br>3,375% 15-05-2044   | 142.137,23                 | 3,23                         |
|   |   | <b>3.583.528,94</b>        | <b>81,31</b>                 |
|   | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>3.583.528,94</b>        | <b>81,31</b>                 |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>3.583.528,94</b>        | <b>81,31</b>                 |
| <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                   |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |
| 472.000,00  | United States Treasury Strip<br>Principal 15-11-2043  | 305.523,60                 | 6,93                         |
| 583.000,00  | United States Treasury Strip<br>Principal 15-11-2044  | 369.340,87                 | 8,38                         |
|   |   | <b>674.864,47</b>          | <b>15,31</b>                 |
|   | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>674.864,47</b>          | <b>15,31</b>                 |
|   | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>674.864,47</b>          | <b>15,31</b>                 |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>4.258.393,41</b>        | <b>96,62</b>                 |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>103.916,92</b>          | <b>2,36</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>44.883,81</b>           | <b>1,02</b>                  |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>4.407.194,14</b>        | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Long Duration US Bond Fund

**Aufgliederung der Wertpapieranlagen  
nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021  
(in % des Nettovermögens)**

| <b>Land</b>  |              | <b>Sektor</b>  |              |
|--------------|--------------|----------------|--------------|
| USA          | 96,62        | Staatsanleihen | 96,62        |
| <b>Summe</b> | <b>96,62</b> | <b>Summe</b>   | <b>96,62</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| <b>CHF</b>  |   |                            |                              |                    |  |                            |                              |
| 400.000,00  | Commerzbank Finance & Covere 2.5% 29-08-2025    | 421.160,91                 | 0,01                         | 3.000.000,00       | AXA Bank Europe SCF 0.01% 22-01-2027           | 2.995.164,00               | 0,04                         |
| 10.000.000,00   | Kommunalkredit Austria AG 2.5% 14-02-2022       | 9.714.232,92               | 0,13                         | 29.000.000,00      | AXA Home Loan SFH SA 0.01% 16-10-2029          | 28.580.312,00              | 0,37                         |
| 5.200.000,00  | Kommunalkredit Austria AG 3.375% 22-06-2026     | 5.814.009,14               | 0,08                         | 15.300.000,00      | AyT Cedula Cajas X Fondo de 3.75% 30-06-2025   | 17.260.480,80              | 0,23                         |
| 29.500.000,00   | Valiant Bank AG 0.000000% 20-01-2026            | 28.745.611,06              | 0,38                         | 35.000.000,00      | Banca Carige SpA 0.625% 28-10-2028             | 34.943.020,00              | 0,46                         |
|   |   | <b>44.695.014,03</b>       | <b>0,58</b>                  | 67.500.000,00      | Banca Carige SpA FRN 25-05-2022                | 67.615.425,00              | 0,88                         |
| <b>DKK</b>  |   |                            |                              | 20.000.000,00      | Banca Carige SpA FRN 25-05-2023                | 20.120.000,00              | 0,26                         |
| 150.000.000,00  | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2025 SDO A E      | 20.905.102,11              | 0,27                         | 97.192.000,00      | Banca Monte dei Paschi di Si 0.875% 08-10-2026 | 99.873.332,90              | 1,31                         |
| 400.000.000,00  | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2026 SDO A E      | 55.973.228,35              | 0,73                         | 100.400.000,00     | Banca Monte dei Paschi di Si 1.25% 20-01-2022  | 100.456.826,40             | 1,31                         |
| 560.000.000,00  | Nordea Kredit 1% 04-01-2022 SDRO A 2            | 75.593.375,11              | 0,99                         | 190.969.000,00     | Banca Monte dei Paschi di Si 2% 29-01-2024     | 199.238.721,58             | 2,61                         |
| 150.000.000,00  | Nordea Kredit 1% 04-01-2024 SDRO A 2            | 20.766.562,85              | 0,27                         | 13.000.000,00      | Banca Monte dei Paschi di Si 2.125% 26-11-2025 | 13.967.850,00              | 0,18                         |
| 630.000.000,00  | Nordea Kredit 1% 04-01-2026 IO A                | 88.157.834,66              | 1,15                         | 73.200.000,00      | Banca Monte dei Paschi di Si 2.875% 16-07-2024 | 78.510.513,60              | 1,03                         |
| 92.000.000,00   | Nordea Kredit 1% 10-01-2023 SDRO A 2            | 12.677.840,33              | 0,17                         | 8.000.000,00       | Banca Popolare dell'Alto Adi 0.25% 28-10-2026  | 8.018.768,00               | 0,10                         |
| 328.290.062,67  | Nordea Kredit 1% 10-01-2024 SDRO A 2            | 45.613.783,41              | 0,60                         | 45.000.000,00      | Banco BPM SpA 0.75% 31-03-2022                 | 45.126.900,00              | 0,59                         |
| 720.000.000,00  | Nordea Kredit 1% 10-01-2025 IO SDRO A 2         | 100.578.441,93             | 1,32                         | 38.497.000,00      | Banco BPM SpA 0.875% 14-09-2022                | 38.854.615,96              | 0,51                         |
| 350.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 01-01-2024 SDO A H       | 48.335.246,43              | 0,63                         | 3.900.000,00       | Banco de Sabadell SA 0.125% 10-02-2028         | 3.894.150,00               | 0,05                         |
| 630.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 04-01-2022 SDO AR H      | 85.042.852,83              | 1,11                         | 25.000.000,00      | Banco di Desio e della Brian 0.375% 24-07-2026 | 25.335.700,00              | 0,33                         |
| 980.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2025 SDO A H       | 136.706.338,36             | 1,79                         | 20.000.000,00      | Bank Gospodarstwa Krajowego 0.5% 08-07-2031    | 19.220.200,00              | 0,25                         |
| 670.000.000,00  | Nykredit Realkredit 1% 07-01-2026 SDO A H       | 93.786.935,26              | 1,23                         | 12.000.000,00      | Bank of New Zealand 0.01% 15-06-2028           | 11.841.720,00              | 0,15                         |
| 975.000.000,00  | Nykredit Realkredit 2% 01-01-2025 SDO A H       | 139.578.939,62             | 1,83                         | 26.900.000,00      | Bank of Nova Scotia/The 0.01% 14-01-2027       | 26.830.060,00              | 0,35                         |
| 1.250.000.000,00  | Nykredit Realkredit 2% 01-01-2026 SDO A H       | 181.426.664,24             | 2,37                         | 33.300.000,00      | Bank of Nova Scotia/The 0.01% 15-12-2027       | 33.079.753,80              | 0,43                         |
| 59.573.688,68   | Nykredit Realkredit FRN 01-01-2023 IO CITA-6M A | 8.040.681,00               | 0,11                         | 33.670.000,00      | Bank of Queensland Ltd 0.5% 10-07-2022         | 33.836.868,52              | 0,44                         |
| 483.773.232,92  | Nykredit Realkredit FRN 01-01-2024 IO CITA-6M A | 65.522.732,31              | 0,86                         | 9.700.000,00       | Bausparkasse Schwaebisch Hal 0.01% 22-10-2030  | 9.527.340,00               | 0,12                         |
| 100.000.000,00  | Realkredit Danmark 1% 01-01-2025 SDRO A T       | 13.912.246,62              | 0,18                         | 27.200.000,00      | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.01% 03-09-2029  | 26.881.107,20              | 0,35                         |
| 750.000.000,00  | Realkredit Danmark 1% 04-01-2022 SDRO A T       | 101.241.163,68             | 1,32                         | 6.000.000,00       | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.01% 23-09-2030  | 5.880.444,00               | 0,08                         |
| 281.709.937,33  | Realkredit Danmark 1% 04-01-2024 SDRO A T       | 38.992.274,51              | 0,51                         | 11.200.000,00      | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit u 0.1% 12-05-2031   | 11.005.839,94              | 0,14                         |
| 300.000.000,00  | Realkredit Danmark 1% 04-01-2025 SDRO A T       | 41.803.498,46              | 0,55                         | 8.000.000,00       | BNZ International Funding Lt 0.625% 03-07-2025 | 8.183.280,00               | 0,11                         |
|   |   | <b>1.374.655.742,07</b>    | <b>17,98</b>                 | 4.500.000,00       | BPCE SFH SA 0.01% 10-11-2027                   | 4.484.925,00               | 0,06                         |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              | 20.100.000,00      | BPCE SFH SA 0.01% 16-10-2028                   | 19.947.481,20              | 0,26                         |
| 5.100.000,00  | Achmea Bank NV 0.01% 16-06-2025                 | 5.112.301,20               | 0,07                         | 66.400.000,00      | BPCE SFH SA 0.01% 18-03-2031                   | 64.793.651,20              | 0,85                         |
| 5.100.000,00  | Aegon Bank NV 0.01% 16-11-2025                  | 5.103.508,80               | 0,07                         | 8.000.000,00       | BPCE SFH SA 0.01% 27-05-2030                   | 7.865.104,00               | 0,10                         |
| 14.600.000,00   | Aegon Bank NV 0.375% 09-06-2036                 | 14.291.268,40              | 0,19                         | 21.000.000,00      | BPCE SFH SA 0.01% 29-01-2029                   | 20.809.908,00              | 0,27                         |
| 20.000.000,00   | Alpha Bank Romania SA FRN 16-05-2024            | 20.100.000,00              | 0,26                         | 36.700.000,00      | BPCE SFH SA 0.125% 03-12-2030                  | 36.299.529,60              | 0,47                         |
| 69.877.000,00   | Alpha Bank SA 2.5% 05-02-2023                   | 71.580.880,77              | 0,94                         | 20.000.000,00      | BPCE SFH SA 0.75% 27-11-2026                   | 20.729.760,00              | 0,27                         |
| 18.600.000,00   | AMCO - Asset Management Co S 0.75% 20-04-2028   | 18.047.200,75              | 0,24                         | 15.530.000,00      | BPER Banca 1% 22-07-2023                       | 15.834.667,54              | 0,21                         |
| 35.000.000,00   | AMCO - Asset Management Co S 2.25% 17-07-2027   | 37.143.060,50              | 0,49                         | 9.800.000,00       | BPER Banca 1.125% 22-04-2026                   | 10.238.961,60              | 0,13                         |
| 16.500.000,00   | Andorra Capital Agricol Reig FRN 25-07-2022     | 16.551.695,16              | 0,22                         | 11.200.000,00      | Caisse de Refinancement de l 0.01% 08-10-2029  | 11.057.043,20              | 0,14                         |
| 14.500.000,00   | Argenta Spaarbank NV 0.01% 11-02-2031           | 14.181.203,00              | 0,19                         | 36.000.000,00      | Caisse Francaise de Financem 0.01% 07-05-2025  | 36.155.880,00              | 0,47                         |
| 19.000.000,00   | Arkea Home Loans SFH SA 0.375% 04-03-2024       | 19.267.786,00              | 0,25                         | 40.400.000,00      | Caisse Francaise de Financem 0.01% 18-03-2031  | 39.422.643,20              | 0,52                         |
| 7.500.000,00  | ASB Finance Ltd/London 0.75% 09-10-2025         | 7.708.560,00               | 0,10                         | 11.900.000,00      | Caisse Francaise de Financem 0.01% 22-02-2028  | 11.843.855,80              | 0,15                         |
| 29.757.000,00   | Autonomous Community of Cata 4.22% 26-04-2035   | 38.643.154,37              | 0,51                         | 34.300.000,00      | Caisse Francaise de Financem 0.01% 27-04-2029  | 33.982.519,20              | 0,44                         |
|   |   |                            |                              | 30.200.000,00      | Caixa Economica Montepio Ger 0.125% 14-11-2024 | 30.339.524,00              | 0,40                         |
|   |   |                            |                              | 47.400.000,00      | Caixa Economica Montepio Ger 0.875% 17-10-2022 | 47.839.587,60              | 0,63                         |
|   |   |                            |                              | 25.000.000,00      | Caixa Geral de Depositos SA 1% 27-01-2022      | 25.017.500,00              | 0,33                         |
|   |   |                            |                              | 6.000.000,00       | Caja Rural de Navarra SCC 0.625% 01-12-2023    | 6.088.260,00               | 0,08                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 20.000.000,00      | Caja Rural de Navarra SCC 0.875% 08-05-2025       | 20.557.520,00              | 0,27                         | 20.000.000,00      | DNB Boligkredit AS 0.625% 14-01-2026           | 20.537.520,00              | 0,27                         |
| 4.000.000,00       | Cajamar Caja Rural SCC 0.875% 18-06-2023          | 4.065.800,00               | 0,05                         | 59.000.000,00      | DNB Boligkredit AS 0.625% 19-06-2025           | 60.500.016,00              | 0,79                         |
| 80.000.000,00      | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 07-10-2026     | 80.181.090,40              | 1,05                         | 25.000.000,00      | DZ Bank AG Deutsche Zentral- 0.01% 22-01-2026  | 25.017.160,75              | 0,33                         |
| 50.700.000,00      | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 30-04-2029     | 50.005.308,60              | 0,65                         | 10.000.000,00      | DZ HYP AG 0.01% 12-11-2027                     | 9.981.560,00               | 0,13                         |
| 46.500.000,00      | Canadian Imperial Bank of Co 0.25% 27-09-2023     | 46.954.491,00              | 0,61                         | 27.200.000,00      | DZ HYP AG 0.01% 15-11-2030                     | 26.696.582,40              | 0,35                         |
| 12.900.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.01% 10-11-2027     | 12.857.481,60              | 0,17                         | 23.500.000,00      | DZ HYP AG 0.01% 20-04-2029                     | 23.324.878,00              | 0,31                         |
| 43.000.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.01% 15-07-2026     | 43.060.028,00              | 0,56                         | 45.000.000,00      | DZ HYP AG 0.01% 26-10-2026                     | 45.107.640,00              | 0,59                         |
| 92.500.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.01% 16-04-2029     | 91.542.995,00              | 1,20                         | 12.000.000,00      | DZ HYP AG 0.01% 27-10-2028                     | 11.943.192,00              | 0,16                         |
| 26.300.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.01% 25-09-2030     | 25.775.683,20              | 0,34                         | 26.300.000,00      | DZ HYP AG 0.01% 29-03-2030                     | 25.926.540,00              | 0,34                         |
| 40.600.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.01% 25-10-2027     | 40.494.927,20              | 0,53                         | 8.200.000,00       | Eika Boligkredit AS 0.01% 23-03-2028           | 8.145.650,40               | 0,11                         |
| 36.200.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.05% 16-04-2024     | 36.464.839,20              | 0,48                         | 11.500.000,00      | Eika Boligkredit AS 0.125% 16-06-2031          | 11.298.405,00              | 0,15                         |
| 20.100.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.225% 14-09-2026    | 20.320.497,00              | 0,27                         | 17.000.000,00      | Eika Boligkredit AS 0.5% 28-08-2025            | 17.354.722,00              | 0,23                         |
| 96.100.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.325% 12-09-2023    | 97.251.085,80              | 1,27                         | 1.100.000,00       | Erste Group Bank AG 0.625% 17-04-2026          | 1.131.286,20               | 0,01                         |
| 37.000.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.375% 11-12-2024    | 37.594.220,00              | 0,49                         | 33.500.000,00      | Eurocaja Rural SCC 0.125% 22-09-2031           | 32.690.305,00              | 0,43                         |
| 13.100.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.5% 04-09-2024      | 13.346.830,20              | 0,17                         | 6.000.000,00       | Eurocaja Rural SCC 0.875% 27-05-2024           | 6.143.700,00               | 0,08                         |
| 20.000.000,00      | Cie de Financement Foncier S 0.75% 29-05-2026     | 20.688.000,00              | 0,27                         | 4.000.000,00       | Federation des Caisses Desja 0.01% 24-09-2025  | 4.009.296,00               | 0,05                         |
| 16.100.000,00      | Clydesdale Bank PLC 0.01% 22-09-2026              | 16.016.441,00              | 0,21                         | 43.312.500,00      | French Republic Government B 0.1% 25-07-2031   | 53.127.740,47              | 0,69                         |
| 15.000.000,00      | Commonwealth Bank of Austral 0.125% 15-10-2029    | 14.829.960,00              | 0,19                         | 8.000.000,00       | French Republic Government B 0.5% 25-05-2072   | 6.189.584,00               | 0,08                         |
| 15.000.000,00      | Commonwealth Bank of Austral 0.375% 11-04-2024    | 15.207.270,00              | 0,20                         | 27.187.500,00      | French Republic Government B 0.7% 25-07-2030   | 36.549.479,64              | 0,48                         |
| 16.003.000,00      | Commonwealth Bank of Austral 0.375% 24-04-2023    | 16.170.071,32              | 0,21                         | 8.000.000,00       | Hamburg Commercial Bank AG 0.25% 25-04-2022    | 8.018.912,00               | 0,10                         |
| 20.000.000,00      | Cooperatieve Rabobank UA 0.01% 02-07-2030         | 19.852.443,40              | 0,26                         | 9.000.000,00       | Hana Bank 0.01% 26-01-2026                     | 8.968.680,00               | 0,12                         |
| 15.700.000,00      | Coventry Building Society 0.01% 07-07-2028        | 15.488.458,20              | 0,20                         | 112.000.000,00     | Hellenic Republic Government 0.75% 18-06-2031  | 106.268.534,40             | 1,39                         |
| 38.000.000,00      | Credit Agricole Home Loan SF 0.01% 12-04-2028     | 37.823.376,00              | 0,49                         | 127.700.000,00     | Hellenic Republic Government 1.5% 18-06-2030   | 130.124.767,60             | 1,70                         |
| 9.500.000,00       | Credit Agricole Home Loan SF 0.5% 19-02-2026      | 9.715.365,00               | 0,13                         | 81.400.000,00      | Hellenic Republic Government 1.875% 24-01-2052 | 79.896.542,00              | 1,04                         |
| 9.200.000,00       | Credit Agricole Italia SpA 0.875% 31-01-2022      | 9.207.728,00               | 0,12                         | 42.600.000,00      | Hellenic Republic Government 3.875% 12-03-2029 | 50.637.768,00              | 0,66                         |
| 12.500.000,00      | Credit Agricole Public Secto 0.125% 08-12-2031    | 12.273.425,00              | 0,16                         | 7.200.000,00       | HSBC Bank Canada 0.01% 14-09-2026              | 7.186.464,00               | 0,09                         |
| 20.000.000,00      | Credit Mutuel Home Loan SFH 0.01% 06-05-2031      | 19.490.200,00              | 0,25                         | 8.000.000,00       | HYPO NOE Landesbank fuer Nie 0.01% 01-10-2026  | 7.996.736,00               | 0,10                         |
| 8.000.000,00       | Credit Mutuel Home Loan SFH 0.25% 30-04-2024      | 8.095.232,00               | 0,11                         | 15.700.000,00      | HYPO NOE Landesbank fuer Nie 0.01% 08-09-2028  | 15.557.130,00              | 0,20                         |
| 34.010.000,00      | Credito Emiliano SpA 1.125% 17-01-2024            | 34.926.229,40              | 0,46                         | 14.000.000,00      | Hypo Tirol Bank AG 0.01% 19-10-2026            | 13.980.904,00              | 0,18                         |
| 24.500.000,00      | Danmarks Skibskredit 0.125% 03-20-2025            | 24.480.890,00              | 0,32                         | 10.000.000,00      | Hypo Vorarlberg Bank AG 0.625% 17-07-2026      | 10.275.560,00              | 0,13                         |
| 27.100.000,00      | Danmarks Skibskredit 0.25% 06-21-2028 A           | 26.810.030,00              | 0,35                         | 10.000.000,00      | IM Cedula 10 Fondo de Titul 4.5% 21-02-2022    | 10.067.140,00              | 0,13                         |
| 10.000.000,00      | Danske Mortgage Bank PLC 0.01% 24-11-2026         | 10.018.540,00              | 0,13                         | 48.500.000,00      | ING Bank NV 0.125% 08-12-2031                  | 47.670.165,00              | 0,62                         |
| 14.500.000,00      | Deutsche Bank AG 0.05% 20-11-2024                 | 14.516.095,00              | 0,19                         | 37.100.000,00      | ING-DiBa AG 0.01% 07-10-2028                   | 36.951.451,60              | 0,48                         |
| 9.000.000,00       | Deutsche Bank SA Espanola 0.875% 16-01-2025       | 9.243.000,00               | 0,12                         | 13.800.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 0.15% 15-05-2051  | 14.462.148,52              | 0,19                         |
| 14.100.000,00      | Deutsche Bundesrepublik Infl 0.1% 15-04-2046      | 25.516.207,83              | 0,33                         | 90.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 0.4% 15-05-2030   | 102.909.240,00             | 1,35                         |
| 17.000.000,00      | Deutsche Hypothekbank AG 0.01% 18-02-2027         | 16.987.658,00              | 0,22                         | 8.152.000,00       | Italy Buoni Poliennali Del T 1.3% 15-05-2028   | 10.138.030,96              | 0,13                         |
| 4.934.323,69       | DLR Kredit FRN 01-01-2028 IO EURIBOR 3M SDO A B F | 4.933.879,60               | 0,06                         | 27.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 1.7% 01-09-2051   | 25.298.679,24              | 0,33                         |
| 23.100.000,00      | DNB Boligkredit AS 0.01% 08-10-2027               | 23.016.285,60              | 0,30                         | 50.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 2.15% 01-03-2072  | 47.806.060,00              | 0,63                         |
| 46.600.000,00      | DNB Boligkredit AS 0.01% 12-05-2028               | 46.306.420,00              | 0,61                         | 22.000.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 2.45% 01-09-2050  | 24.197.448,00              | 0,32                         |
| 25.800.000,00      | DNB Boligkredit AS 0.01% 21-01-2031               | 25.224.918,00              | 0,33                         | 10.322.000,00      | Italy Buoni Poliennali Del T 2.8% 01-03-2067   | 11.658.699,00              | 0,15                         |
|                    |   |                            |                              | 7.200.000,00       | Jyske Realkredit A/S 0.01% 10-01-2027 A        | 7.168.320,00               | 0,09                         |
|                    |   |                            |                              | 14.000.000,00      | Kommunalkredit Austria AG 0.01% 29-09-2028     | 13.790.112,00              | 0,18                         |
|                    |   |                            |                              | 22.400.000,00      | Kommunekredit 0.000000% 03-03-2031             | 21.833.504,00              | 0,29                         |
|                    |   |                            |                              | 8.600.000,00       | Korea Housing Finance Corp 0.01% 05-02-2025    | 8.602.356,40               | 0,11                         |
|                    |   |                            |                              | 10.000.000,00      | Korea Housing Finance Corp 0.01% 07-07-2025    | 9.986.240,00               | 0,13                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                     | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 20.000.000,00      | Korea Housing Finance Corp 0.01% 29-06-2026        | 19.886.000,00              | 0,26                         | 21.300.000,00      | Societe Generale SFH SA 0.01% 02-12-2026         | 21.348.990,00              | 0,28                         |
| 10.000.000,00      | Korea Housing Finance Corp 0.1% 18-06-2024         | 10.048.220,00              | 0,13                         | 4.000.000,00       | Societe Generale SFH SA 0.5% 28-01-2026          | 4.090.952,00               | 0,05                         |
| 5.000.000,00       | Korea Housing Finance Corp 0.75% 30-10-2023        | 5.087.480,00               | 0,07                         | 21.000.000,00      | Societe Generale SFH SA 0.5% 30-01-2025          | 21.423.150,00              | 0,28                         |
| 10.000.000,00      | La Banque Postale Home Loan 0.5% 30-01-2026        | 10.225.420,00              | 0,13                         | 56.800.000,00      | Spain Government Bond 1.45% 31-10-2071           | 49.337.729,60              | 0,65                         |
| 3.000.000,00       | Latvia Government Internatio 0.25% 23-01-2030      | 2.988.840,00               | 0,04                         | 6.000.000,00       | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.01% 22-09-2027      | 5.982.984,00               | 0,08                         |
| 1.500.000,00       | Latvia Government Internatio 2.25% 15-02-2047      | 2.046.570,00               | 0,03                         | 32.600.000,00      | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.05% 03-11-2028      | 32.391.620,80              | 0,42                         |
| 10.000.000,00      | Liberbank SA 0.25% 25-09-2029                      | 9.958.840,00               | 0,13                         | 6.000.000,00       | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.125% 05-11-2029     | 5.959.512,00               | 0,08                         |
| 7.200.000,00       | Lloyds Bank PLC 0.125% 23-09-2029                  | 7.131.024,00               | 0,09                         | 22.600.000,00      | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.125% 12-05-2031     | 22.216.478,00              | 0,29                         |
| 24.500.000,00      | Lloyds Bank PLC 0.25% 25-03-2024                   | 24.742.452,00              | 0,32                         | 5.000.000,00       | SpareBank 1 Boligkredit AS 0.125% 14-05-2026     | 5.034.860,00               | 0,07                         |
| 9.000.000,00       | Lloyds Bank PLC 0.625% 26-03-2025                  | 9.198.450,00               | 0,12                         | 20.600.000,00      | Sparebanken Soer Boligkredit 0.01% 26-10-2026    | 20.586.857,20              | 0,27                         |
| 4.500.000,00       | Luminor Bank AS/Estonia 0.01% 11-03-2025           | 4.504.104,00               | 0,06                         | 27.000.000,00      | Sparebanken Vest Boligkredit 0.01% 11-11-2026    | 26.996.544,00              | 0,35                         |
| 22.400.000,00      | mBank Hipoteczny SA 0.242% 15-09-2025              | 22.529.068,80              | 0,29                         | 10.000.000,00      | Sparebanken Vest Boligkredit 0.01% 24-11-2025    | 10.020.540,00              | 0,13                         |
| 20.000.000,00      | mBank Hipoteczny SA 0.612% 22-06-2022              | 20.066.819,20              | 0,26                         | 25.500.000,00      | SR-Boligkredit AS 0.01% 08-09-2028               | 25.283.250,00              | 0,33                         |
| 8.400.000,00       | MFB Magyar Fejlesztési Bank 0.375% 09-06-2026      | 8.342.510,40               | 0,11                         | 6.300.000,00       | SR-Boligkredit AS 0.01% 08-10-2026               | 6.296.598,00               | 0,08                         |
| 10.000.000,00      | MMB SCF SACA 0.05% 17-09-2029                      | 9.871.240,00               | 0,13                         | 22.100.000,00      | SR-Boligkredit AS 0.01% 10-03-2031               | 21.533.709,60              | 0,28                         |
| 13.220.000,00      | National Australia Bank Ltd 0.75% 30-01-2026       | 13.624.532,00              | 0,18                         | 12.700.000,00      | SR-Boligkredit AS 0.01% 25-02-2030               | 12.474.295,60              | 0,16                         |
| 7.200.000,00       | Nationale-Niederlanden Bank N 0.01% 08-07-2030     | 7.067.116,80               | 0,09                         | 41.900.000,00      | State of North Rhine-Westphalia 0.95% 10-01-2121 | 33.287.455,00              | 0,44                         |
| 7.000.000,00       | Nationale-Niederlanden Bank N 1% 25-09-2028        | 7.395.178,00               | 0,10                         | 37.875.000,00      | State of North Rhine-Westphalia 1.95% 26-09-2078 | 51.038.825,91              | 0,67                         |
| 30.000.000,00      | Nationwide Building Society 1.125% 31-05-2028      | 31.881.480,00              | 0,42                         | 16.700.000,00      | Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.409% 07-11-2029   | 16.765.430,60              | 0,22                         |
| 12.500.000,00      | NIBC Bank NV 0.125% 21-04-2031                     | 12.242.000,00              | 0,16                         | 20.000.000,00      | Sumitomo Mitsui Trust Bank L 0.01% 15-10-2027    | 19.671.360,00              | 0,26                         |
| 6.700.000,00       | NIBC Bank NV 0.5% 19-03-2027                       | 6.838.864,20               | 0,09                         | 37.800.000,00      | Sumitomo Mitsui Trust Bank L 0.277% 25-10-2028   | 37.560.502,22              | 0,49                         |
| 13.700.000,00      | NORD/LB Luxembourg SA Covere 0.375% 07-03-2024     | 13.845.083,00              | 0,18                         | 11.500.000,00      | UniCredit Bank AG 0.01% 19-11-2027               | 11.479.208,00              | 0,15                         |
| 2.295.816,12       | Nykredit Realkredit FRN 01-01-2023 IO EURIBOR 3M S | 2.310.635,61               | 0,03                         | 14.100.000,00      | UniCredit Bank AG 0.01% 21-05-2029               | 13.970.703,00              | 0,18                         |
| 57.000.000,00      | PITCHI 5.125% 20-07-2022                           | 58.716.840,00              | 0,77                         | 14.800.000,00      | UniCredit Bank AG 0.01% 28-09-2026               | 14.837.059,20              | 0,19                         |
| 80.000.000,00      | PKO Bank Hipoteczny SA 0.125% 24-06-2022           | 80.076.640,00              | 1,05                         | 1.000.000,00       | UniCredit Bank Austria AG FRN 20-08-2033         | 900.000,00                 | 0,01                         |
| 28.300.000,00      | PKO Bank Hipoteczny SA 0.75% 27-08-2024            | 28.878.112,40              | 0,38                         | 4.320.000,00       | UniCredit Bank Austria AG FRN 25-01-2031         | 3.979.340,35               | 0,05                         |
| 38.200.000,00      | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 01-10-2026          | 38.012.514,40              | 0,50                         | 900.000,00         | UniCredit Bank Austria AG FRN 27-12-2026         | 872.938,25                 | 0,01                         |
| 14.500.000,00      | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 14-09-2027          | 14.382.963,54              | 0,19                         | 3.800.000,00       | UniCredit Bank Austria AG FRN 27-12-2029         | 3.527.934,48               | 0,05                         |
| 8.000.000,00       | Raiffeisen Landesbank Vorarl 0.5% 17-09-2025       | 8.161.440,00               | 0,11                         | 2.900.000,00       | UniCredit Bank Austria AG FRN 27-12-2031         | 2.649.109,72               | 0,03                         |
| 4.460.000,00       | Realkredit Danmark 1% 01-01-2022 SDRO A T          | 4.460.000,00               | 0,06                         | 1.000.000,00       | UniCredit Bank Austria AG FRN 31-12-2031         | 900.157,92                 | 0,01                         |
| 24.000.000,00      | Republic of Austria Governme 0.85% 30-06-2120      | 20.864.502,24              | 0,27                         | 47.000.000,00      | United Overseas Bank Ltd 0.1% 25-05-2029         | 46.511.576,00              | 0,61                         |
| 10.300.000,00      | Romanian Government Internat 1.75% 13-07-2030      | 9.604.750,00               | 0,13                         | 24.000.000,00      | Vseobecna Uverova Banka AS 0.01% 23-06-2025      | 24.008.304,00              | 0,31                         |
| 30.411.000,00      | Romanian Government Internat 2% 14-04-2033         | 27.686.174,40              | 0,36                         | 14.700.000,00      | Vseobecna Uverova Banka AS 0.01% 24-03-2026      | 14.669.541,60              | 0,19                         |
| 7.000.000,00       | Romanian Government Internat 3.624% 26-05-2030     | 7.586.544,00               | 0,10                         | 11.500.000,00      | Vseobecna Uverova Banka AS 0.25% 26-03-2024      | 11.610.009,00              | 0,15                         |
| 22.300.000,00      | Royal Bank of Canada 0.01% 05-10-2028              | 22.068.169,20              | 0,29                         | 16.600.000,00      | Westpac Banking Corp 0.01% 22-09-2028            | 16.386.856,00              | 0,21                         |
| 14.783.000,00      | San Marino Government Bond 3.25% 24-02-2024        | 15.208.454,74              | 0,20                         | 49.000.000,00      | Westpac Securities NZ Ltd/Lo 0.01% 08-06-2028    | 48.346.830,00              | 0,63                         |
| 8.700.000,00       | Santander Consumer Bank AG 0.05% 14-02-2030        | 8.600.263,20               | 0,11                         | 18.000.000,00      | Wuestenrot Bausparkasse AG 0.125% 19-10-2029     | 17.956.434,96              | 0,23                         |
| 14.600.000,00      | Santander UK PLC 0.05% 12-01-2027                  | 14.584.348,80              | 0,19                         | 5.900.000,00       | Yorkshire Building Society 0.01% 13-10-2027      | 5.852.811,80               | 0,08                         |
| 7.000.000,00       | Santander UK PLC 0.1% 12-05-2024                   | 7.047.530,00               | 0,09                         | 40.260.000,00      | Yorkshire Building Society 0.75% 10-11-2022      | 40.679.509,20              | 0,53                         |
| 63.500.000,00      | Skipton Building Society 0.5% 02-10-2023           | 64.363.346,00              | 0,84                         | 5.000.000,00       | Zuercher Kantonalbank 0.000000% 15-05-2026       | 4.974.610,00               | 0,07                         |
| 6.500.000,00       | Slovenska izvozna in razvojn 0.125% 08-07-2025     | 6.506.175,00               | 0,09                         |                    |  |                            |                              |
|                    |  |                            |                              |                    |  | <b>5.468.052.858,86</b>    | <b>71,51</b>                 |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>GBP</b>  |   |                            |                              |
| 13.000.000,00   | TSB Bank PLC FRN 22-06-2028   | 15.448.878,92              | 0,20                         |
|   |   | <b>15.448.878,92</b>       | <b>0,20</b>                  |
| <b>JPY</b>  |   |                            |                              |
| 1.000.000,00  | Japan Government Thirty Year<br>0.6% 20-06-2050   | 7.507,84                   | 0,00                         |
|   |   | <b>7.507,84</b>            | <b>0,00</b>                  |
| <b>NOK</b>  |   |                            |                              |
| 125.000.000,00  | DNB Boligkreditt AS 19/22 FRN<br>C COVID  | 12.536.707,94              | 0,16                         |
| 200.000.000,00  | Eika Boligkreditt AS 18/23 FRN<br>C COVID   | 20.119.359,55              | 0,26                         |
| 400.000.000,00  | Nordea Eiendomskredi AS 16/22<br>FRN C COVID  | 40.198.122,25              | 0,53                         |
| 195.000.000,00  | Spb 1 Boligkreditt AS 18/24 ADJ<br>C COVID  | 19.863.251,85              | 0,26                         |
|   |   | <b>92.717.441,59</b>       | <b>1,21</b>                  |
| <b>SEK</b>  |   |                            |                              |
| 180.000.000,00  | DNB Boligkreditt AS 0.75%<br>31-01-2024   | 17.720.855,68              | 0,23                         |
| 200.000.000,00  | Nordea Hypotek AB 1% 17-09-<br>2025   | 19.854.884,08              | 0,26                         |
| 200.000.000,00  | Stadshypotek AB 1% 03-09-2025   | 19.858.395,66              | 0,26                         |
| 400.000.000,00  | Swedbank Hypotek AB 1%<br>18-06-2025  | 39.710.938,68              | 0,52                         |
|   |   | <b>97.145.074,10</b>       | <b>1,27</b>                  |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |
| 15.000.000,00   | Deutsche Pfandbriefbank AG<br>0.5% 19-01-2024   | 13.048.773,55              | 0,17                         |
| 32.595.000,00   | Republic of Italy Government 4%<br>17-10-2049   | 31.592.674,65              | 0,41                         |
| 25.000.000,00   | United States Treasury Infla<br>0.125% 15-02-2051   | 27.853.643,40              | 0,36                         |
|   |   | <b>72.495.091,60</b>       | <b>0,95</b>                  |
|   | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>7.165.217.609,01</b>    | <b>93,71</b>                 |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>7.165.217.609,01</b>    | <b>93,71</b>                 |
| <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |
| 20.670.000,00   | Italy Buoni Poliennali Del T<br>0.65% 15-05-2026  | 23.191.015,77              | 0,30                         |
| 5.900.000,00  | Sumitomo Mitsui Banking Corp<br>0.01% 10-09-2025  | 5.884.724,07               | 0,08                         |
| 11.000.000,00   | Sumitomo Mitsui Banking Corp<br>0.267% 18-06-2026   | 11.055.000,00              | 0,14                         |
|   |   | <b>40.130.739,84</b>       | <b>0,52</b>                  |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |
| 28.000.000,00   | Republic of Italy Government<br>2.875% 17-10-2029   | 25.250.465,54              | 0,33                         |
| 16.000.000,00   | Republic of Italy Government<br>3.875% 06-05-2051   | 15.092.280,95              | 0,20                         |
|   |   | <b>40.342.746,49</b>       | <b>0,53</b>                  |
|   | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>80.473.486,33</b>       | <b>1,05</b>                  |
|   | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>80.473.486,33</b>       | <b>1,05</b>                  |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>7.245.691.095,34</b>    | <b>94,76</b>                 |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>206.470.777,26</b>      | <b>2,70</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>193.896.478,12</b>      | <b>2,54</b>                  |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>7.646.058.350,72</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor                      |              |
|------------------------|--------------|-----------------------------|--------------|
| Dänemark               | 19,18        | Unternehmensanleihen        | 40,36        |
| Italien                | 15,55        | Hypothekenanleihen          | 38,42        |
| Frankreich             | 13,70        | Staatsanleihen              | 15,89        |
| Norwegen               | 6,77         | Kündbare Hypothekenanleihen | 0,09         |
| Deutschland            | 5,80         |                             |              |
| Griechenland           | 5,74         |                             |              |
| Kanada                 | 3,54         |                             |              |
| Spanien                | 3,49         |                             |              |
| Vereinigtes Königreich | 3,30         |                             |              |
| Polen                  | 2,23         |                             |              |
| Österreich             | 2,14         |                             |              |
| Niederlande            | 1,86         |                             |              |
| Australien             | 1,44         |                             |              |
| Portugal               | 1,35         |                             |              |
| Slowakei               | 1,34         |                             |              |
| Japan                  | 1,19         |                             |              |
| Schweden               | 1,04         |                             |              |
| Neuseeland             | 1,00         |                             |              |
| Rumänien               | 0,85         |                             |              |
| Republik Korea         | 0,82         |                             |              |
| Singapur               | 0,61         |                             |              |
| Schweiz                | 0,44         |                             |              |
| USA                    | 0,36         |                             |              |
| San Marino             | 0,20         |                             |              |
| Belgien                | 0,19         |                             |              |
| Luxemburg              | 0,19         |                             |              |
| Finnland               | 0,13         |                             |              |
| Ungarn                 | 0,11         |                             |              |
| Slowenien              | 0,09         |                             |              |
| Lettland               | 0,07         |                             |              |
| Estland                | 0,06         |                             |              |
| <b>Summe</b>           | <b>94,76</b> |                             |              |
|                        |              | <b>Summe</b>                | <b>94,76</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 15.875.161,26                                     | CHF                | 15.136.408,69     | EUR                  | 235.373,96  | 28.01.2022  |
| 447.637,95  | EUR                | 466.468,82        | CHF                  | (4.038,34)  | 28.01.2022  |
| 1.889,88  | EUR                | 1.611,59          | GBP                  | (27,40)   | 28.01.2022  |
| 2.192,12  | EUR                | 22.067,83         | NOK                  | (15,88)   | 28.01.2022  |
| 456.402,18  | EUR                | 4.700.645,78      | SEK                  | (1.961,71)  | 28.01.2022  |
| 10.157.184,65                                     | EUR                | 11.544.896,49     | USD                  | (30.007,83)   | 28.01.2022  |
| 115.498.691,24                                    | GBP                | 136.047.964,84    | EUR                  | 1.358.111,47  | 28.01.2022  |
| 4.277.809,92                                      | NOK                | 424.130,68        | EUR                  | 3.887,68  | 28.01.2022  |
| 1.628.984.660,83                                  | SEK                | 159.573.634,20    | EUR                  | (730.709,38)  | 28.01.2022  |
| 406.673.798,11                                    | USD                | 360.991.532,55    | EUR                  | (2.145.068,52)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(1.314.455,95)</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 6.682.000,00                                      | USD                | 5.745.783,23      | EUR                  | 152.065,66  | 14.01.2022  |
| 303.800.000,00                                    | DKK                | 40.849.692,98     | EUR                  | 5.576,35  | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>157.642,01</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 18.502.475,19                                     | EUR                | 21.423.000,00     | USD                  | (406.455,94)  | 14.01.2022  |
| 31.949.000,00                                     | USD                | 27.564.880,47     | EUR                  | 634.792,72  | 14.01.2022  |
| 399.000,00  | AUD                | 254.038,85        | EUR                  | 990,53  | 03.03.2022  |
| 4.968.508,90                                      | EUR                | 4.218.000,00      | GBP                  | (45.139,98)   | 03.03.2022  |
| 1.844.000,00                                      | GBP                | 2.166.729,91      | EUR                  | 25.113,26   | 03.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>209.300,59</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 93.679.532,78                                     | EUR                | 929.130.000,00    | NOK                  | 664.251,71  | 13.01.2022  |
| 8.781.960,18                                      | EUR                | 10.124.000,00     | USD                  | (153.940,92)  | 14.01.2022  |
| 6.724.000,00                                      | USD                | 5.903.079,55      | EUR                  | 31.809,45   | 14.01.2022  |
| 99.828.145,58                                     | EUR                | 1.013.533.000,26  | SEK                  | 998.429,26  | 28.01.2022  |
| 2.635.000,00                                      | AUD                | 1.664.790,67      | EUR                  | 19.440,67   | 03.03.2022  |
| 221.036,56  | EUR                | 351.000,00        | AUD                  | (3.315,39)  | 03.03.2022  |
| 20.649.211,59                                     | EUR                | 17.603.000,00     | GBP                  | (274.372,19)  | 03.03.2022  |
| 11.504,49   | EUR                | 1.480.000,00      | JPY                  | 164,61  | 03.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>1.282.467,20</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 16.713.922,66                                     | EUR                | 19.320.000,00     | USD                  | (338.796,24)  | 14.01.2022  |
| 7.097.000,00                                      | USD                | 6.057.344,95      | EUR                  | 206.814,16  | 14.01.2022  |
| 1.077.811,21                                      | EUR                | 10.974.000,00     | SEK                  | 7.733,67  | 28.01.2022  |
| 1.782.173,81                                      | EUR                | 2.826.000,00      | AUD                  | (24.144,11)   | 03.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(148.392,52)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b>  |                    |                   |                      |   |             |
| 10.202.000,00                                     | NOK                | 1.042.412,22      | EUR                  | (21.092,44)   | 13.01.2022  |
| 112.211.380,44                                    | EUR                | 133.066.000,00    | USD                  | (5.239.524,58)  | 14.01.2022  |
| 1.323.000,00                                      | USD                | 1.169.085,87      | EUR                  | (1.351,63)  | 14.01.2022  |
| 30.000,00   | AUD                | 18.886,43         | EUR                  | 288,96  | 03.03.2022  |
| 184.357,25  | EUR                | 294.000,00        | AUD                  | (3.562,38)  | 03.03.2022  |
| 44.410.288,59                                     | EUR                | 46.236.000,00     | CHF                  | (367.857,10)  | 03.03.2022  |
| 2.560.000,00                                      | GBP                | 2.996.461,57      | EUR                  | 46.457,62   | 03.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(5.586.641,55)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| 3.150.930,44                                      | EUR                | 3.560.000,00      | USD                  | 8.729,25  | 14.01.2022  |
| 2.329.000,00                                      | USD                | 2.002.600,89      | EUR                  | 53.084,57   | 14.01.2022  |
| 15.742.000,00                                     | SEK                | 1.531.411,57      | EUR                  | 3.602,41  | 28.01.2022  |
| 726.467,63  | EUR                | 621.000,00        | GBP                  | (11.678,47)   | 03.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>53.737,76</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>               |                    |                   |                      |   |             |
| 1.159.312,08                                      | EUR                | 11.958.000,00     | SEK                  | (6.723,33)  | 28.01.2022  |
| 1.466.980.615,00                                  | EUR                | 10.910.536.295,81 | DKK                  | (277.200,38)  | 28.02.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(283.923,71)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>           |                    |                   |                      |   |             |
| 360.362.295,00                                    | DKK                | 48.452.412,69     | EUR                  | 9.402,78  | 28.02.2022  |
| 1.119.227,62                                      | EUR                | 953.000,00        | GBP                  | (13.542,58)   | 03.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(4.139,80)</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(4.319.950,02)</b>   |             |
|   |                    |                   |                      | <b>(5.634.405,97)</b>   |             |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Wahrung und gleicher veraufterer Wahrung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Credit Default Swaps

| Basiswert                            | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal        | Währung | Kosten (EUR)          | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)       | Fälligkeit |
|--------------------------------------|--------------|-----------------|----------------|---------|-----------------------|---|-----------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b> |              |                 |                |         |                       |   |                       |            |
| ITRAXX-EUROPES36V1-5Y                | Kauf         | 1,00%           | 367.000.000,00 | EUR     | (7.956.866,83)        | (1.542.212,69)                                      | (9.499.079,52)        | 20.12.2026 |
|                                      |              |                 |                |         | <b>(7.956.866,83)</b> | <b>(1.542.212,69)</b>                               | <b>(9.499.079,52)</b> |            |

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|-------------------------------|--------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                               |                          |   |  |
| AUST 10Y BOND FUT 3/2022               | 15.03.2022 | AUD     | 180,00                        | 17.689.500,00            | (57.806,08)   | 58.337,56  |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (11.461,00)                   | (1.527.063.640,00)       | 0,00  | 10.981.117,52  |
| Euro-BTP Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (3.932,00)                    | (578.220.260,00)         | (176.940,00)  | 9.586.663,54   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (4.334,00)                    | (742.717.580,00)         | 0,00  | 11.782.287,01  |
| EURO-BUXL 30Y BND 3/2022               | 10.03.2022 | EUR     | (747,00)                      | (154.434.780,00)         | 0,00  | 6.051.217,58   |
| Euro-OAT Future 3/2022                 | 10.03.2022 | EUR     | (3.064,00)                    | (500.075.440,00)         | (183.840,00)  | 8.724.311,30   |
| LONG GILT FUTURE 3/2022                | 31.03.2022 | GBP     | (1.661,00)                    | (207.508.730,00)         | (296.586,72)  | (191.866,56)   |
| Short Euro-BTP Fu 3/2022               | 10.03.2022 | EUR     | (2.500,00)                    | (282.312.500,00)         | (37.500,00)   | 1.246.103,59   |
| SWEDISH 10YR FUT 3/2022                | 16.03.2022 | SEK     | (401,00)                      | (428.203.034,90)         | 59.904,84   | 572.116,64   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 100,00                        | 13.048.438,00            | 6.897,98  | (35.528,34)  |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (2.034,00)                    | (246.161.662,72)         | (84.168,61)   | (761.293,55)   |
| US LONG BOND(CBT) 3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (700,00)                      | (112.131.250,00)         | (193.131,15)  | 788.210,74   |
| US ULTRA BOND CBT 3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 460,00                        | 90.936.250,00            | 228.446,56  | (1.885.809,99)   |
|  |            |         |                               |                          | <b>(734.723,18)</b>   | <b>46.915.867,04</b>   |

### Zinsswaps

| Beschreibung                                  | Nominal          | Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Kosten in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|---|------------------|---------|---|--|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>            |                  |         |   |  |            |
| Paying fixed rate -0.0350%                    | (16.000.000,00)  | EUR     | 2.545.832,62  | -  | 06.03.2070 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months      |                  |         |   |  |            |
| Paying fixed rate 0.2440%                     | (10.000.000,00)  | EUR     | 287.294,32  | -  | 24.12.2071 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months      |                  |         |   |  |            |
|   |                  |         | <b>2.833.126,94</b>   | <b>-</b>                                       |            |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b> |                  |         |   |  |            |
| Paying fixed rate 0.3525%                     | (150.000.000,00) | SEK     | 699.290,62  | -  | 09.10.2030 |
| Receiving floating rate STIBOR 3 months       |                  |         |   |  |            |
| Paying fixed rate 0.7470%                     | (500.000.000,00) | SEK     | 936.448,54  | -  | 20.09.2031 |
| Receiving floating rate STIBOR 3 months       |                  |         |   |  |            |
| Receiving fixed rate 0.2420%                  | 23.000.000,00    | EUR     | (1.559.867,21)  | -  | 03.12.2051 |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months         |                  |         |   |  |            |
| Paying fixed rate 0.1690%                     | (65.000.000,00)  | EUR     | 853.865,35  | -  | 03.12.2031 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months      |                  |         |   |  |            |
|   |                  |         | <b>929.737,30</b>   | <b>-</b>                                       |            |
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b> |                  |         |   |  |            |
| Paying fixed rate -0.3810%                    | (50.000.000,00)  | EUR     | 592.996,10  | -  | 14.09.2025 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months      |                  |         |   |  |            |
| Paying fixed rate 0.3650%                     | (12.000.000,00)  | EUR     | 408.774,34  | -  | 15.03.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months      |                  |         |   |  |            |
| Paying fixed rate 0.3810%                     | (8.000.000,00)   | EUR     | 236.826,09  | -  | 15.03.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months      |                  |         |   |  |            |
| Paying fixed rate 0.3560%                     | (10.000.000,00)  | EUR     | 357.364,73  | -  | 14.09.2051 |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months      |                  |         |   |  |            |
| Receiving fixed rate -0.3455%                 | 100.000.000,00   | EUR     | (603.183,20)  | -  | 20.09.2024 |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Zinsswaps (Fortsetzung)

| Beschreibung                                     | Nominal          | Wahrung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/<br>(-minderung) in der<br>Basiswahrung des<br>Teilfonds (EUR) | Kosten in der<br>Basiswahrung des<br>Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|--|------------------|----------|---|---|-------------|
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate -0.2610%                       | (100.000.000,00) | EUR      | 1.256.600,02  | -   | 20.09.2026  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 0.3025%                        | (23.000.000,00)  | EUR      | 1.165.583,88  | -   | 10.11.2051  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 0.3065%                        | (24.000.000,00)  | EUR      | 1.188.934,06  | -   | 10.11.2051  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 0.6350%                        | (10.500.000,00)  | GBP      | 615.542,13  | -   | 01.02.2051  |
| Receiving floating rate GBP-SONIA-OIS COMPOUND   |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 0.3025%                        | (23.000.000,00)  | EUR      | 1.533.583,88  | (368.000,00)  | 10.11.2051  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
|  |                  |          | <b>6.753.022,03</b>   | <b>(368.000,00)</b>                                   |             |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate -0.4280%                       | (50.000.000,00)  | EUR      | 694.803,34  | -   | 29.09.2025  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate -0.2780%                       | (60.000.000,00)  | EUR      | 708.053,06  | -   | 10.06.2026  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate -0.3020%                       | (30.000.000,00)  | EUR      | 385.834,17  | -   | 11.06.2026  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 0.0775%                        | (140.000.000,00) | EUR      | 442.948,38  | -   | 25.10.2028  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Receiving fixed rate 0.5140%                     | 110.000.000,00   | EUR      | (333.293,07)  | -   | 29.10.2031  |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 0.2200%                        | (36.400.000,00)  | EUR      | 284.584,44  | -   | 16.11.2031  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate -0.0690%                       | (40.000.000,00)  | EUR      | 160.058,36  | -   | 19.11.2026  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Receiving fixed rate 0.2455%                     | 6.000.000,00     | EUR      | (400.931,50)  | -   | 03.12.2051  |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 0.1710%                        | (65.000.000,00)  | EUR      | 840.909,09  | -   | 03.12.2031  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
|  |                  |          | <b>2.782.966,27</b>   | <b>-</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 0.1210%                        | (40.000.000,00)  | EUR      | 1.973.111,32  | -   | 10.02.2036  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate -0.3240%                       | (60.000.000,00)  | EUR      | 860.568,31  | -   | 12.07.2026  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate -0.0270%                       | (150.000.000,00) | EUR      | 291.402,30  | -   | 15.11.2026  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 0.1980%                        | (120.000.000,00) | EUR      | 1.200.140,16  | -   | 16.11.2031  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate -0.0700%                       | (100.000.000,00) | EUR      | 406.017,10  | -   | 17.11.2026  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate -0.0300%                       | (150.000.000,00) | EUR      | 1.682.999,40  | -   | 09.12.2028  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Receiving fixed rate 0.3350%                     | 7.000.000,00     | EUR      | (287.799,91)  | -   | 23.12.2051  |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |          |   |   |             |
|  |                  |          | <b>6.126.438,68</b>   | <b>-</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 0.2405%                        | (10.500.000,00)  | EUR      | 318.656,93  | -   | 24.12.2071  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
|  |                  |          | <b>318.656,93</b>   | <b>-</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: Morgan Stanley Europe SE</b>     |                  |          |   |   |             |
| Receiving fixed rate -0.3625%                    | 190.000.000,00   | EUR      | (823.875,04)  | -   | 03.06.2024  |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate -0.3300%                       | (50.000.000,00)  | EUR      | 730.850,65  | -   | 12.07.2026  |
| Receiving floating rate EURIBOR 6 months         |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 1.0780%                        | (60.000.000,00)  | USD      | 1.271.152,81  | -   | 26.08.2028  |
| Receiving floating rate USDLIB 3 months          |                  |          |   |   |             |
| Paying fixed rate 1.0353%                        | (8.000.000,00)   | GBP      | (524.380,62)  | -   | 22.10.2051  |
| Receiving floating rate GBP-SONIA-OIS COMPOUND   |                  |          |   |   |             |
| Receiving fixed rate -0.0030%                    | 120.000.000,00   | EUR      | (21.204,24)   | -   | 16.11.2024  |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |          |   |   |             |
| Receiving fixed rate -0.0250%                    | 120.000.000,00   | EUR      | (74.595,36)   | -   | 16.11.2024  |
| Paying floating rate EURIBOR 6 months            |                  |          |   |   |             |
|  |                  |          | <b>557.948,20</b>   | <b>-</b>  |             |
|  |                  |          | <b>20.301.896,35</b>  | <b>(368.000,00)</b>                                   |             |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit fur Zinsswaps 140.000,00 EUR gezahlt.  
 BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit fur Zinsswaps 3.080.000,00 EUR gezahlt.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit fur Zinsswaps 6.130.000,00 EUR gezahlt.  
 Deutsche Bank AG hat als Sicherheit fur Credit Default Swaps und Zinsswaps 6.930.000,00 EUR erhalten.  
 Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit fur Zinsswaps 5.570.000,00 EUR gezahlt.  
 J.P. Morgan SE hat als Sicherheit fur Zinsswaps 440.000,00 EUR gezahlt.  
 Morgan Stanley Europe SE hat als Sicherheit fur Zinsswaps 710.000,00 EUR gezahlt.  
 Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|---|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |   |  |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |   |  |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |  |                            |                              |   |  |                            |                              |
| 950.000,00  | Alice France SA/France 2.5% 15-01-2025         | 1.059.877,24               | 0,81                         | 600.000,00  | United Airlines Holdings Inc 4.875% 15-01-2025 | 617.250,00                 | 0,47                         |
| 270.000,00  | Nobian Finance BV 3.625% 15-07-2026            | 302.375,08                 | 0,23                         | 1.300.000,00  | United Rentals North America 3.875% 15-11-2027 | 1.347.043,75               | 1,03                         |
| 359.000,00  | TK Elevator Midco GmbH FRN 15-07-2027          | 410.484,25                 | 0,31                         |   |  | <b>31.433.421,70</b>       | <b>23,92</b>                 |
|   |  | <b>1.772.736,57</b>        | <b>1,35</b>                  |   | <b>Summe Anleihen</b>                          | <b>33.206.158,27</b>       | <b>25,27</b>                 |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |
| 300.000,00  | AerCap Ireland Capital DAC / 6.5% 15-07-2025   | 342.945,62                 | 0,26                         |   |  | <b>33.206.158,27</b>       | <b>25,27</b>                 |
| 250.000,00  | Alice France SA/France 5.5% 15-01-2028         | 248.510,00                 | 0,19                         | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |  |                            |                              |
| 400.000,00  | Alice France SA/France 8.125% 01-02-2027       | 426.500,00                 | 0,32                         | <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |
| 605.000,00  | Canpack SA / Canpack US LLC 3.125% 01-11-2025  | 605.000,02                 | 0,46                         | <b>USD</b>  |  |                            |                              |
| 700.000,00  | Deutsche Bank AG 4.296% MULTI 24-05-2028       | 719.295,51                 | 0,55                         | 1.225.000,00  | Adient Global Holdings Ltd 4.875% 15-08-2026   | 1.249.500,00               | 0,95                         |
| 425.000,00  | DISH DBS Corp 5% 15-03-2023                    | 434.031,25                 | 0,33                         | 605.000,00  | Air Canada 2020-1 Class C Pa 10.5% 15-07-2026  | 742.719,65                 | 0,57                         |
| 1.020.000,00  | DISH DBS Corp 5.875% 15-11-2024                | 1.050.753,00               | 0,80                         | 145.000,00  | Air Canada 3.875% 15-08-2026                   | 147.900,00                 | 0,11                         |
| 575.000,00  | Ford Motor Co 9% 22-04-2025                    | 702.995,00                 | 0,54                         | 1.200.000,00  | Albertsons Cos Inc / Safeway 3.25% 15-03-2026  | 1.222.500,00               | 0,93                         |
| 1.250.000,00  | Ford Motor Credit Co LLC 3.375% 13-11-2025     | 1.298.650,00               | 0,99                         | 600.000,00  | Allied Universal Holdco LLC 6.625% 15-07-2026  | 630.000,00                 | 0,48                         |
| 1.000.000,00  | Ford Motor Credit Co LLC 5.596% 07-01-2022     | 1.000.700,00               | 0,76                         | 1.220.000,00  | American Airlines Inc 11.75% 15-07-2025        | 1.503.650,00               | 1,14                         |
| 595.000,00  | HCA Inc 5.375% 01-02-2025                      | 653.905,00                 | 0,50                         | 875.000,00  | Aramark Services Inc 6.375% 01-05-2025         | 914.375,00                 | 0,70                         |
| 2.050.000,00  | Hillenbrand Inc 5.75% 15-06-2025               | 2.142.250,00               | 1,63                         | 1.000.000,00  | Ardagh Packaging Finance PLC 5.25% 30-04-2025  | 1.032.500,00               | 0,79                         |
| 27.000,00   | Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-05-2025         | 31.042,73                  | 0,02                         | 420.000,00  | Aviation Capital Group LLC 5.5% 15-12-2024     | 459.573,43                 | 0,35                         |
| 710.000,00  | INEOS Quattro Finance 2 Plc 3.375% 15-01-2026  | 712.591,50                 | 0,54                         | 815.000,00  | Avient Corp 5.75% 15-05-2025                   | 849.637,50                 | 0,65                         |
| 650.000,00  | Lennar Corp 5.875% 15-11-2024                  | 715.650,00                 | 0,54                         | 218.000,00  | Bath & Body Works Inc 9.375% 01-07-2025        | 265.960,00                 | 0,20                         |
| 650.000,00  | Lumen Technologies Inc 6.75% 01-12-2023        | 701.187,50                 | 0,53                         | 974.000,00  | Bausch Health Cos Inc 6.125% 15-04-2025        | 992.262,49                 | 0,76                         |
| 990.000,00  | Macy's Retail Holdings LLC 3.625% 01-06-2024   | 1.017.413,10               | 0,77                         | 1.125.000,00  | Boxer Parent Co Inc 7.125% 02-10-2025          | 1.179.843,75               | 0,90                         |
| 1.585.000,00  | MGM Growth Properties Operat 5.625% 01-05-2024 | 1.693.921,20               | 1,29                         | 655.000,00  | Brundage-Bone Concrete Pumpi 6% 01-02-2026     | 681.200,01                 | 0,52                         |
| 750.000,00  | MGM Resorts International 6% 15-03-2023        | 788.276,25                 | 0,60                         | 210.000,00  | Cablevision Lightpath LLC 3.875% 15-09-2027    | 203.700,00                 | 0,16                         |
| 510.000,00  | Newell Brands Inc 4.7% 01-04-2026              | 556.027,50                 | 0,42                         | 1.115.000,00  | Caesars Entertainment Inc 6.25% 01-07-2025     | 1.169.356,25               | 0,89                         |
| 1.880.000,00  | OneMain Finance Corp 7.125% 15-03-2026         | 2.143.200,00               | 1,63                         | 310.000,00  | Caesars Resort Collection LL 5.75% 01-07-2025  | 324.769,95                 | 0,25                         |
| 340.000,00  | OneMain Finance Corp 8.875% 01-06-2025         | 363.800,00                 | 0,28                         | 2.000.000,00  | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4% 01-03-2023     | 2.000.080,00               | 1,52                         |
| 955.000,00  | Penske Automotive Group Inc 3.5% 01-09-2025    | 976.487,50                 | 0,74                         | 250.000,00  | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 5.5% 01-05-2026   | 256.875,00                 | 0,20                         |
| 580.000,00  | Sealed Air Corp 5.125% 01-12-2024              | 620.600,00                 | 0,47                         | 1.520.000,00  | CD&R Smokey Buyer Inc 6.75% 15-07-2025         | 1.596.000,00               | 1,21                         |
| 775.000,00  | Service Properties Trust 4.65% 15-03-2024      | 765.312,50                 | 0,58                         | 1.300.000,00  | CDW LLC / CDW Finance Corp 4.125% 01-05-2025   | 1.335.750,00               | 1,02                         |
| 700.000,00  | Service Properties Trust 5% 15-08-2022         | 699.216,00                 | 0,53                         | 340.000,00  | Centene Corp 4.625% 15-12-2029                 | 365.075,00                 | 0,28                         |
| 650.000,00  | SPCM SA 3.125% 15-03-2027                      | 642.317,00                 | 0,49                         | 340.000,00  | CHS/Community Health Systems 6.625% 15-02-2025 | 351.900,00                 | 0,27                         |
| 2.215.000,00  | Sprint Communications Inc 6% 15-11-2022        | 2.305.449,53               | 1,75                         | 306.000,00  | Clarios Global LP 6.75% 15-05-2025             | 321.300,00                 | 0,24                         |
| 1.485.000,00  | Tenet Healthcare Corp 4.625% 15-07-2024        | 1.508.492,70               | 1,15                         | 1.155.000,00  | Clean Harbors Inc 4.875% 15-07-2027            | 1.189.650,00               | 0,91                         |
| 479.000,00  | Teva Pharmaceutical Finance 2.95% 18-12-2022   | 480.995,04                 | 0,37                         | 105.000,00  | Clearway Energy Operating LL 4.75% 15-03-2028  | 110.381,25                 | 0,08                         |
| 590.000,00  | Teva Pharmaceutical Finance 4.75% 09-05-2027   | 592.950,00                 | 0,45                         | 900.000,00  | Cogent Communications Group 3.5% 01-05-2026    | 922.450,50                 | 0,70                         |
| 515.000,00  | T-Mobile USA Inc 2.25% 15-02-2026              | 516.287,50                 | 0,39                         | 2.000.000,00  | CSC Holdings LLC 5.5% 15-04-2027               | 2.067.500,00               | 1,57                         |
| 1.000.000,00  | Toll Brothers Finance Corp 4.375% 15-04-2023   | 1.032.500,00               | 0,79                         | 292.000,00  | Dell International LLC / EMC 5.45% 15-06-2023  | 308.052,66                 | 0,23                         |
| 900.000,00  | TRI Pointe Group Inc / TRI P 5.875% 15-06-2024 | 979.875,00                 | 0,75                         | 1.000.000,00  | Delta Air Lines Inc 7% 01-05-2025              | 1.143.863,42               | 0,87                         |
|   |  |                            |                              | 905.000,00  | Directv Financing LLC / Dire 5.875% 15-08-2027 | 928.602,40                 | 0,71                         |
|   |  |                            |                              | 660.000,00  | DISH DBS Corp 5.25% 01-12-2026                 | 671.550,00                 | 0,51                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal                                | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------------------|------------------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 1.100.000,00 DISH DBS Corp 7.75% 01-07-2026                    | 1.160.500,00               | 0,88                         | 214.000,00 Tenet Healthcare Corp 7.5%<br>01-04-2025  | 225.224,31                 | 0,17                         |
| 675.000,00 Edgewell Personal Care Co 5.5%<br>01-06-2028        | 713.812,50                 | 0,54                         | 300.000,00 Teva Pharmaceutical Finance<br>7.125% 31-01-2025  | 321.964,50                 | 0,25                         |
| 870.000,00 Fair Isaac Corp 5.25% 15-05-2026                    | 955.912,50                 | 0,73                         | 760.000,00 TripAdvisor Inc 7% 15-07-2025   | 801.800,00                 | 0,61                         |
| 1.160.000,00 Fortress Transportation and 6.5%<br>01-10-2025    | 1.200.600,00               | 0,91                         | 1.000.000,00 Triumph Group Inc 6.25% 15-<br>09-2024  | 1.006.250,00               | 0,77                         |
| 1.300.000,00 GFL Environmental Inc 3.75%<br>01-08-2025         | 1.319.500,00               | 1,00                         | 511.000,00 Triumph Group Inc 8.875% 01-<br>06-2024   | 559.095,32                 | 0,43                         |
| 1.765.000,00 GFL Environmental Inc 4.25%<br>01-06-2025         | 1.804.712,50               | 1,37                         | 750.000,00 Uber Technologies Inc 7.5%<br>15-05-2025  | 789.828,75                 | 0,60                         |
| 930.000,00 Go Daddy Operating Co LLC /<br>5.25% 01-12-2027     | 961.387,50                 | 0,73                         | 800.000,00 Uber Technologies Inc 8% 01-<br>11-2026   | 851.999,99                 | 0,65                         |
| 1.500.000,00 Hanesbrands Inc 4.625% 15-05-<br>2024             | 1.570.710,00               | 1,20                         | 325.000,00 United Airlines Inc 4.375% 15-<br>04-2026   | 337.593,75                 | 0,26                         |
| 1.000.000,00 Herc Holdings Inc 5.5% 15-07-<br>2027             | 1.040.000,00               | 0,79                         | 4.250.000,00 US Airways 2010-1 Class A Pa<br>6.25% 22-04-2023  | 1.402.408,90               | 1,07                         |
| 1.120.000,00 IHS Markit Ltd 5% 01-11-2022                      | 1.151.920,01               | 0,88                         | 1.305.000,00 US Foods Inc 6.25% 15-04-2025   | 1.358.831,25               | 1,03                         |
| 1.180.000,00 International Game Technolog<br>4.125% 15-04-2026 | 1.215.482,60               | 0,93                         | 805.000,00 VICI Properties LP / VICI No 3.5%<br>15-02-2025   | 821.005,43                 | 0,62                         |
| 335.000,00 IRB Holding Corp 7% 15-06-2025                      | 353.425,00                 | 0,27                         | 1.155.000,00 WASH Multifamily Acquisition<br>5.75% 15-04-2026  | 1.213.847,25               | 0,92                         |
| 1.170.000,00 Iron Mountain Inc 4.875% 15-<br>09-2027           | 1.213.266,60               | 0,92                         | 1.270.000,00 WESCO Distribution Inc 7.125%<br>15-06-2025   | 1.350.264,00               | 1,03                         |
| 250.000,00 JetBlue 2020-1 Class B Pass<br>7.75% 15-11-2028     | 259.674,89                 | 0,20                         | 1.500.000,00 XPO Logistics Inc 6.25% 01-05-<br>2025  | 1.569.375,00               | 1,19                         |
| 1.195.000,00 KAR Auction Services Inc 5.125%<br>01-06-2025     | 1.212.925,00               | 0,92                         |  | <b>84.757.614,53</b>       | <b>64,51</b>                 |
| 1.750.000,00 Kraft Heinz Foods Co 3.875%<br>15-05-2027         | 1.891.263,33               | 1,44                         | <b>Summe Anleihen</b>  | <b>84.757.614,53</b>       | <b>64,51</b>                 |
| 945.000,00 Kronos Acquisition Holdings 5%<br>31-12-2026        | 933.499,35                 | 0,71                         | <b>Summe an einem anderen<br/>geregeltten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b> | <b>84.757.614,53</b>       | <b>64,51</b>                 |
| 310.000,00 LD Holdings Group LLC 6.5%<br>01-11-2025            | 304.172,00                 | 0,23                         | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>   | <b>117.963.772,80</b>      | <b>89,78</b>                 |
| 539.000,00 Match Group Holdings II LLC 5%<br>15-12-2027        | 560.560,00                 | 0,43                         | <b>Bankguthaben</b>  | <b>11.986.136,25</b>       | <b>9,12</b>                  |
| 735.000,00 Mattel Inc 3.375% 01-04-2026                        | 755.212,50                 | 0,57                         | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>  | <b>1.436.216,71</b>        | <b>1,09</b>                  |
| 1.500.000,00 Mauser Packaging Solutions H<br>5.5% 15-04-2024   | 1.513.755,00               | 1,15                         | <b>Summe Nettovermögen</b>   | <b>131.386.125,76</b>      | <b>100,00</b>                |
| 635.000,00 Newell Brands Inc 4.875% 01-<br>06-2025             | 692.150,00                 | 0,53                         |  |                            |                              |
| 1.405.000,00 NMI Holdings Inc 7.375% 01-<br>06-2025            | 1.595.377,50               | 1,21                         |  |                            |                              |
| 900.000,00 NOVA Chemicals Corp 4.875%<br>01-06-2024            | 930.375,00                 | 0,71                         |  |                            |                              |
| 965.000,00 Novelis Corp 3.25% 15-11-2026                       | 973.443,75                 | 0,74                         |  |                            |                              |
| 1.250.000,00 Owens-Brockway Glass Contain<br>5.875% 15-08-2023 | 1.309.375,00               | 1,00                         |  |                            |                              |
| 600.000,00 Pactiv Evergreen Group Issue 4%<br>15-10-2027       | 583.500,00                 | 0,44                         |  |                            |                              |
| 1.025.000,00 Park Intermediate Holdings L 7.5%<br>01-06-2025   | 1.083.138,01               | 0,82                         |  |                            |                              |
| 330.000,00 PennyMac Financial Services<br>5.375% 15-10-2025    | 339.075,00                 | 0,26                         |  |                            |                              |
| 1.000.000,00 Performance Food Group Inc<br>6.875% 01-05-2025   | 1.045.000,07               | 0,80                         |  |                            |                              |
| 798.000,00 Picasso Finance Sub Inc 6.125%<br>15-06-2025        | 832.912,51                 | 0,63                         |  |                            |                              |
| 750.000,00 PRA Health Sciences Inc 2.875%<br>15-07-2026        | 750.937,50                 | 0,57                         |  |                            |                              |
| 550.000,00 Prime Security Services Borr<br>5.25% 15-04-2024    | 582.312,50                 | 0,44                         |  |                            |                              |
| 975.000,00 PTC Inc 3.625% 15-02-2025                           | 988.406,26                 | 0,75                         |  |                            |                              |
| 1.178.000,00 Realogy Group LLC / Realogy<br>7.625% 15-06-2025  | 1.251.625,00               | 0,95                         |  |                            |                              |
| 2.093.000,00 Scientific Games Internation 5%<br>15-10-2025     | 2.150.557,50               | 1,64                         |  |                            |                              |
| 2.118.000,00 Sensata Technologies BV 4.875%<br>15-10-2023      | 2.223.900,00               | 1,69                         |  |                            |                              |
| 1.118.000,00 Service Properties Trust 7.5%<br>15-09-2025       | 1.211.765,94               | 0,92                         |  |                            |                              |
| 750.000,00 Sirius XM Radio Inc 3.125% 01-<br>09-2026           | 750.217,50                 | 0,57                         |  |                            |                              |
| 1.165.000,00 Sirius XM Radio Inc 4% 15-07-<br>2028             | 1.170.825,00               | 0,89                         |  |                            |                              |
| 165.000,00 Staples Inc 7.5% 15-04-2026                         | 168.712,50                 | 0,13                         |  |                            |                              |
| 600.000,00 Starwood Property Trust Inc<br>3.625% 15-07-2026    | 598.500,00                 | 0,46                         |  |                            |                              |
| 675.000,00 TEGNA Inc 4.75% 15-03-2026                          | 702.000,00                 | 0,53                         |  |                            |                              |
| 950.000,00 Tempo Acquisition LLC / Temp<br>5.75% 01-06-2025    | 983.250,00                 | 0,75                         |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| USA                    | 74,56        | Unternehmensanleihen | 89,78        |
| Kanada                 | 4,76         |                      |              |
| Niederlande            | 2,62         | <b>Summe</b>         | <b>89,78</b> |
| Frankreich             | 1,81         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich | 1,47         |                      |              |
| Länderübergreifend     | 1,25         |                      |              |
| Jersey                 | 0,95         |                      |              |
| Bermuda                | 0,88         |                      |              |
| Deutschland            | 0,86         |                      |              |
| Curaçao                | 0,37         |                      |              |
| Irland                 | 0,26         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>89,78</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 19.385.619,21                                     | EUR               | 21.838.568,82      | USD                | 130.708,02   | 28.01.2022 |
| 127.358.172,52                                    | NOK               | 14.222.863,06      | USD                | 218.281,55   | 28.01.2022 |
| 36.207.802,64                                     | SEK               | 4.026.904,80       | USD                | (25.703,72)  | 28.01.2022 |
| 332.941,10  | USD               | 294.059,45         | EUR                | (309,76)   | 28.01.2022 |
| 589.737,45  | USD               | 5.357.503,74       | NOK                | (17.749,60)  | 28.01.2022 |
| 63.546,21   | USD               | 577.999,21         | SEK                | (326,48)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>304.900,01</b>  |            |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>           |                   |                    |                    |  |            |
| 2.369.455,13                                      | USD               | 2.065.000,00       | EUR                | 28.285,06  | 17.02.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>28.285,06</b>   |            |
|   |                   |                    |                    | <b>333.185,07</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/ Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (USD) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (USD) |
|--|------------|---------|--------------------------------|--------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                |                          |   |  |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (80,00)                        | (9.681.874,64)           | (3.749,60)  | 31.875,04  |
|  |            |         |                                |                          | <b>(3.749,60)</b>   | <b>31.875,04</b>   |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Nordic Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |
| <b>DKK</b>  |   |                            |                              |
| 30.449,00   | Carlsberg B   | 4.624.899,93               | 1,84                         |
| 127.447,00  | Chr. Hansen Holding   | 8.833.180,44               | 3,52                         |
| 235.003,00  | Novo Nordisk B  | 23.227.572,07              | 9,24                         |
| 723.182,00  | Tryg  | 15.705.913,65              | 6,25                         |
| 305.880,00  | Vestas Wind Systems   | 8.226.671,35               | 3,27                         |
|   |   | <b>60.618.237,44</b>       | <b>24,12</b>                 |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |
| 144.155,00  | Huhtamäki   | 5.606.187,95               | 2,23                         |
| 268.693,00  | Kesko B   | 7.883.452,62               | 3,14                         |
| 197.659,00  | Neste   | 8.570.494,24               | 3,41                         |
| 137.518,00  | Nokian Renkaat  | 4.579.349,40               | 1,82                         |
| 1.738.321,00  | Nokia   | 9.689.401,25               | 3,86                         |
| 686.579,00  | Nordea Bank   | 7.405.441,09               | 2,95                         |
| 420.020,00  | Sampo A   | 18.506.081,20              | 7,36                         |
| 219.416,00  | Terveystalo Plc   | 2.597.885,44               | 1,03                         |
| 81.560,00   | UPM-Kymmene   | 2.728.997,60               | 1,09                         |
|   |   | <b>67.567.290,79</b>       | <b>26,89</b>                 |
| <b>NOK</b>  |   |                            |                              |
| 139.524,00  | Bakkafrost  | 8.155.648,02               | 3,25                         |
| 566.899,00  | Gjensidige Forsikring   | 12.151.048,01              | 4,84                         |
| 67.229,00   | Schibsted ser. B  | 1.999.895,82               | 0,80                         |
| 105.146,00  | Tomra Systems   | 6.645.327,48               | 2,64                         |
|   |   | <b>28.951.919,33</b>       | <b>11,52</b>                 |
| <b>SEK</b>  |   |                            |                              |
| 85.157,00   | ABB Ltd   | 2.869.083,60               | 1,14                         |
| 163.529,00  | Atlas Copco A   | 9.982.305,48               | 3,97                         |
| 171.863,00  | Elekta B  | 1.920.339,43               | 0,76                         |
| 11.066,00   | EQT   | 532.154,94                 | 0,21                         |
| 493.047,00  | Essity B  | 14.206.900,14              | 5,65                         |
| 119.841,00  | Evolution   | 15.035.381,28              | 5,98                         |
| 535.908,00  | Hennes & Mauritz B  | 9.309.061,59               | 3,70                         |
| 971.679,00  | Kindred Group SDB   | 10.207.961,81              | 4,06                         |
| 213.791,00  | Nordea Bank   | 2.304.370,00               | 0,92                         |
| 345.419,00  | SECTRA B  | 6.745.448,21               | 2,68                         |
| 408.943,00  | Storskogen Group B  | 2.431.291,35               | 0,97                         |
| 860.973,00  | Telia Company   | 2.973.408,97               | 1,18                         |
| 499.872,00  | Volvo B   | 10.222.431,14              | 4,07                         |
|   |   | <b>88.740.137,94</b>       | <b>35,32</b>                 |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>245.877.585,50</b>      | <b>97,85</b>                 |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>245.877.585,50</b>      | <b>97,85</b>                 |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>245.877.585,50</b>      | <b>97,85</b>                 |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>6.563.035,24</b>        | <b>2,61</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(1.167.320,81)</b>      | <b>(0,46)</b>                |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>251.273.299,93</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Nordic Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land         | Sektor   |
|--------------|--|
| Schweden     | Mehrsparversicherungen                               |
| Finnland     | Casinos und Glücksspiel                              |
| Dänemark     | Pharmazeutika  |
| Norwegen     | Sach- und Unfallversicherung                         |
| Malta        | Haushaltsprodukte                                    |
| Färöer       | Baummaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW |
| Schweiz      | Industriemaschinen                                   |
| <b>Summe</b> | <b>Summe</b>   |
| 29,19        | 12,20  |
| 27,81        | 10,05  |
| 24,12        | 9,24   |
| 8,28         | 6,25   |
| 4,06         | 5,65   |
| 3,25         | 4,07   |
| 1,14         | 3,97   |
| <b>97,85</b> | 3,86   |
|              | 3,86   |
|              | 3,70   |
|              | 3,52   |
|              | 3,41   |
|              | 3,27   |
|              | 3,25   |
|              | 3,14   |
|              | 2,68   |
|              | 2,64   |
|              | 2,23   |
|              | 1,84   |
|              | 1,82   |
|              | 1,18   |
|              | 1,14   |
|              | 1,09   |
|              | 1,03   |
|              | 0,97   |
|              | 0,80   |
|              | 0,76   |
|              | 0,21   |
|              | <b>97,85</b>   |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung              | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------------------------|----------------------------|------------------------------|--------------------|---------------------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |                                 |                            |                              | <b>SEK</b>         |                           |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |                                 |                            |                              | <b>SEK</b>         |                           |                            |                              |
| <b>DKK</b>  |                                 |                            |                              | <b>SEK</b>         |                           |                            |                              |
| 1.432,00  | ALK-Abelló B                    | 660.511,23                 | 0,37                         | 411.982,00         | AcadeMedia                | 2.230.343,43               | 1,25                         |
| 15.450,00   | Alm. Brand                      | 26.469,21                  | 0,01                         | 7.458,00           | AFRY                      | 185.508,18                 | 0,10                         |
| 130.044,00  | Bang & Olufsen                  | 487.907,61                 | 0,27                         | 1.264,00           | Annehem Fastigheter B     | 4.598,93                   | 0,00                         |
| 2.957,00  | Flügger group B                 | 259.263,87                 | 0,14                         | 970,00             | AQ Group                  | 34.204,29                  | 0,02                         |
| 3.276,00  | H+H International               | 101.324,58                 | 0,06                         | 120,00             | Atrium Ljungberg B        | 2.337,54                   | 0,00                         |
| 28.884,00   | Harboes Bryggeri B              | 349.577,05                 | 0,20                         | 32.473,00          | Avanza                    | 1.052.258,78               | 0,59                         |
| 62,00   | ISS                             | 1.042,18                   | 0,00                         | 149.362,00         | Axfood                    | 3.793.862,76               | 2,12                         |
| 29.473,00   | Jeudan                          | 1.089.933,77               | 0,61                         | 228.026,00         | Bactiguard B              | 3.670.023,37               | 2,05                         |
| 60.633,00   | Jyske Bank                      | 2.747.780,45               | 1,54                         | 109.346,00         | Beijer Alma B             | 2.927.829,39               | 1,64                         |
| 5.000,00  | Matas                           | 83.710,98                  | 0,05                         | 310.100,00         | Beijer Electronics        | 2.359.374,52               | 1,32                         |
| 1.711,00  | MT Højgaard Holding A/S         | 50.159,08                  | 0,03                         | 19.119,00          | BillerudKorsnäs           | 318.345,86                 | 0,18                         |
| 78.577,00   | NKT                             | 3.334.843,89               | 1,86                         | 56.100,00          | Boliden                   | 1.915.276,24               | 1,07                         |
| 9.150,00  | NNIT                            | 141.255,72                 | 0,08                         | 27.439,00          | Boule Diagnostics         | 130.613,67                 | 0,07                         |
| 64.281,00   | Per Aarsleff Holding B          | 2.640.808,50               | 1,48                         | 70.500,00          | Bravida Holding           | 873.360,11                 | 0,49                         |
| 11.511,00   | Schouw & Co.                    | 880.781,92                 | 0,49                         | 75.200,00          | BTS Group B               | 2.956.129,14               | 1,65                         |
| 38.980,00   | Solar B                         | 4.167.273,79               | 2,33                         | 64.747,00          | Bulten                    | 587.358,31                 | 0,33                         |
| 48.906,00   | Sydbank                         | 1.360.052,74               | 0,76                         | 15.076,00          | Bure Equity               | 644.405,17                 | 0,36                         |
| 9.794,00  | Topdanmark                      | 483.358,36                 | 0,27                         | 184.161,00         | Careium                   | 541.608,53                 | 0,30                         |
|   |                                 | <b>18.866.054,93</b>       | <b>10,55</b>                 | 22.000,00          | Cary Group                | 230.047,75                 | 0,13                         |
| <b>EUR</b>  |                                 |                            |                              | 185.453,00         | Cavotec                   | 361.796,51                 | 0,20                         |
| 158.322,00  | Alma Media                      | 1.713.044,04               | 0,96                         | 318.024,00         | Clas Ohlson B             | 4.259.228,59               | 2,38                         |
| 26.884,00   | Apetit Plc                      | 345.459,40                 | 0,19                         | 100.000,00         | Cloetta                   | 255.565,25                 | 0,14                         |
| 48.014,00   | Aspo                            | 545.439,04                 | 0,30                         | 94.275,00          | Concentric                | 2.584.064,66               | 1,44                         |
| 20.000,00   | CapMan                          | 60.700,00                  | 0,03                         | 207.760,00         | COOR Service Management   | 1.674.963,36               | 0,94                         |
| 142,00  | Cargotec B                      | 6.225,28                   | 0,00                         | 14.845,00          | CTEK                      | 292.648,99                 | 0,16                         |
| 14.904,00   | Enento Group Plc                | 491.832,00                 | 0,27                         | 32.100,00          | DevPort B                 | 101.136,54                 | 0,06                         |
| 30.283,00   | Fiskars                         | 696.509,00                 | 0,39                         | 184.161,00         | Doro                      | 555.081,38                 | 0,31                         |
| 808.905,00  | F-Secure                        | 4.016.213,33               | 2,24                         | 191.485,00         | Duni                      | 2.181.615,04               | 1,22                         |
| 232.610,00  | Glaston                         | 265.175,40                 | 0,15                         | 19.708,00          | Dustin Group              | 203.966,32                 | 0,11                         |
| 13.726,00   | Honkarakenne B                  | 100.474,32                 | 0,06                         | 4.100,00           | Electrolux B              | 87.784,71                  | 0,05                         |
| 118.915,00  | Kemira                          | 1.585.136,95               | 0,89                         | 189.942,00         | Electrolux Professional B | 1.162.613,21               | 0,65                         |
| 370,00  | Konecranes                      | 13.009,20                  | 0,01                         | 47.927,00          | Eltel                     | 72.929,86                  | 0,04                         |
| 112.559,00  | Lassila&Tikkanen                | 1.512.792,96               | 0,85                         | 160.367,00         | Fagerhult                 | 952.648,78                 | 0,53                         |
| 13.201,00   | Marimekko                       | 1.118.124,70               | 0,62                         | 2.995,00           | Fastpartner A             | 35.466,31                  | 0,02                         |
| 1.622,00  | Martela A                       | 3.714,38                   | 0,00                         | 266,00             | Fastpartner D             | 2.143,20                   | 0,00                         |
| 14.330,00   | NoHo Partners Oyj               | 109.194,60                 | 0,06                         | 50.839,00          | Fenix Outdoor Int. B      | 6.079.781,70               | 3,40                         |
| 37.228,00   | Nokian Renkaat                  | 1.239.692,40               | 0,69                         | 37.047,00          | Ferroamp Elektronik       | 292.710,69                 | 0,16                         |
| 21.485,00   | Optomed Oyj                     | 210.553,00                 | 0,12                         | 13.542,00          | Filo Mining Corp.         | 114.921,84                 | 0,06                         |
| 87.835,00   | Ponsse                          | 3.706.637,00               | 2,07                         | 9.512,00           | FM Mattsson Mora Group B  | 226.392,58                 | 0,13                         |
| 136,00  | Puulio                          | 1.271,60                   | 0,00                         | 58.360,00          | Garó                      | 1.229.616,13               | 0,69                         |
| 419.304,00  | Rapala VMC                      | 3.656.330,88               | 2,04                         | 51,00              | Getinge B                 | 1.965,52                   | 0,00                         |
| 10.000,00   | Robit plc                       | 40.300,00                  | 0,02                         | 27.272,00          | Gränges                   | 282.249,31                 | 0,16                         |
| 176.257,00  | Suominen                        | 913.011,26                 | 0,51                         | 72.687,00          | Haldex                    | 375.779,54                 | 0,21                         |
| 7.473,00  | Terveystalo Plc                 | 88.480,32                  | 0,05                         | 202.343,00         | Holmen B                  | 8.579.823,25               | 4,80                         |
| 170.261,00  | Uponor                          | 3.565.265,34               | 1,99                         | 287,00             | Hufvudstaden A            | 3.784,94                   | 0,00                         |
| 118.331,00  | Vaisala A                       | 6.307.042,30               | 3,53                         | 55.006,00          | Husqvarna B               | 777.193,36                 | 0,43                         |
| 95.976,00   | Verkkokauppa Oyj                | 684.308,88                 | 0,38                         | 100,00             | Instalco                  | 4.237,31                   | 0,00                         |
| 21.269,00   | Wulff-Group                     | 104.643,48                 | 0,06                         | 14.000,00          | Intrum                    | 318.734,74                 | 0,18                         |
|   |                                 | <b>33.100.581,06</b>       | <b>18,50</b>                 | 42.564,00          | ITAB Shop Concept         | 55.717,99                  | 0,03                         |
| <b>NOK</b>  |                                 |                            |                              | 71.908,00          | KABE B                    | 1.935.917,33               | 1,08                         |
| 21.002,00   | AKVA Group                      | 185.534,00                 | 0,10                         | 4.024,00           | Karnov Group              | 26.298,64                  | 0,01                         |
| 60.225,00   | Borregaard                      | 1.339.134,06               | 0,75                         | 47.124,00          | Kjell Group               | 272.582,11                 | 0,15                         |
| 3.336,00  | Cadeler A/S                     | 12.189,20                  | 0,01                         | 2.149,00           | Knowit                    | 78.713,07                  | 0,04                         |
| 49.136,00   | Elopak                          | 131.870,55                 | 0,07                         | 28.421,00          | Lexington                 | 90.654,14                  | 0,05                         |
| 35,00   | Flyr AS                         | 6,08                       | 0,00                         | 95.522,00          | Linc                      | 927.659,96                 | 0,52                         |
| 492.169,00  | Kitron                          | 1.163.377,15               | 0,65                         | 5.087,00           | Lindab International      | 159.480,70                 | 0,09                         |
| 38.847,00   | Kongsberg Gruppen               | 1.112.801,73               | 0,62                         | 10.043,00          | Lundin Mining             | 69.064,22                  | 0,04                         |
| 127.285,00  | Lerøy Seafood Group             | 879.161,68                 | 0,49                         | 14.938,00          | Malmbergs Elektriska B    | 94.420,87                  | 0,05                         |
| 106.651,00  | Navamedic                       | 363.193,55                 | 0,20                         | 30.000,00          | MedCap                    | 520.884,91                 | 0,29                         |
| 66.137,00   | Norse Atlantic                  | 99.033,00                  | 0,06                         | 331.344,00         | Medivir B                 | 361.990,90                 | 0,20                         |
| 533.774,00  | NRC Group                       | 1.285.780,30               | 0,72                         | 56.437,00          | Mekonomen                 | 864.849,66                 | 0,48                         |
| 37.264,00   | Otovo AS A                      | 103.573,04                 | 0,06                         | 110.571,00         | Midsona B                 | 583.497,53                 | 0,33                         |
| 150.257,00  | Polaris Media                   | 1.399.625,78               | 0,78                         | 233.679,00         | Midsummer                 | 348.747,93                 | 0,19                         |
| 26.901,00   | SpareBank 1 SR-Bank             | 358.894,60                 | 0,20                         | 183.890,00         | MTG B                     | 1.657.412,46               | 0,93                         |
| 7.713,00  | SpareBank 1 Sørst-Norge         | 50.523,72                  | 0,03                         | 156.773,00         | NCC B                     | 2.564.512,66               | 1,43                         |
| 3.000,00  | SpareBank 1 Østfold Akershus    | 104.567,03                 | 0,06                         | 116.254,00         | NENT Group B              | 5.320.671,23               | 2,97                         |
| 10.015,00   | SpareBank 1 Østlandet           | 146.051,69                 | 0,08                         | 52.784,00          | Nolato B                  | 555.551,42                 | 0,31                         |
| 93.526,00   | Storebrand                      | 829.216,70                 | 0,46                         | 9,00               | Nordnet                   | 152,40                     | 0,00                         |
| 27.706,00   | Treasury                        | 49.673,09                  | 0,03                         | 204.691,00         | OEM International B       | 3.701.766,27               | 2,07                         |
| 51.418,00   | Wallenius Wilhelmsen            | 260.591,33                 | 0,15                         | 28.000,00          | Ogunsen B                 | 120.174,20                 | 0,07                         |
| 70.000,00   | Webstep                         | 235.576,30                 | 0,13                         | 4.694,00           | Pandox                    | 66.849,24                  | 0,04                         |
| 19.386,00   | Wilh. Wilhelmsen Holding ser. A | 401.932,22                 | 0,22                         | 39.017,00          | Peab B                    | 434.630,79                 | 0,24                         |
| 24.006,00   | Wilh. Wilhelmsen Holding ser. B | 480.888,14                 | 0,27                         | 217.176,00         | Poolia B                  | 379.197,42                 | 0,21                         |
| 6.000,00  | Zaptect AS/Norway               | 36.207,84                  | 0,02                         | 1.805,00           | Precio Fishbone B         | 11.655,63                  | 0,01                         |
|   |                                 | <b>11.029.402,78</b>       | <b>6,16</b>                  | 76.132,00          | Ratos B                   | 430.349,39                 | 0,24                         |
|   |                                 |                            |                              | 113.307,00         | Rejlers B                 | 1.611.442,38               | 0,90                         |
|   |                                 |                            |                              | 1.000,00           | Resurs Holding            | 3.708,62                   | 0,00                         |
|   |                                 |                            |                              | 48.782,00          | Scandi Standard           | 195.094,03                 | 0,11                         |
|   |                                 |                            |                              | 15.000,00          | Scandic Hotels Group      | 53.390,70                  | 0,03                         |
|   |                                 |                            |                              | 707.831,00         | SECTRA B                  | 13.822.740,93              | 7,73                         |
|   |                                 |                            |                              | 467,00             | Securitas B               | 5.678,19                   | 0,00                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 130.066,00         | Semcon  | 1.608.731,46               | 0,90                         |
| 100,00             | Solid Försäkringsaktiebolag   | 573,07                     | 0,00                         |
| 38.685,00          | SSAB A  | 197.881,78                 | 0,11                         |
| 480.811,00         | SSAB B  | 2.139.119,19               | 1,20                         |
| 228.514,00         | Svedbergs B   | 1.916.954,39               | 1,07                         |
| 20.182,00          | Sweco B   | 335.061,30                 | 0,19                         |
| 213.728,00         | Systemair   | 2.124.399,17               | 1,19                         |
| 100.490,00         | SAAB B  | 2.257.445,64               | 1,26                         |
| 51.828,00          | Tele2 B   | 652.666,33                 | 0,36                         |
| 617,00             | TF Bank   | 13.812,38                  | 0,01                         |
| 20.003,00          | Tobii Dynavox   | 62.847,26                  | 0,04                         |
| 20.003,00          | Tobii   | 71.647,05                  | 0,04                         |
| 86.050,00          | Trelleborg B  | 1.996.012,43               | 1,12                         |
| 9.703,00           | Troax Group   | 438.688,54                 | 0,25                         |
| 60.738,00          | VBG Group B   | 1.113.829,85               | 0,62                         |
| 2.000,00           | Veoneer SDB   | 62.623,24                  | 0,04                         |
| 1.600,00           | Xvivo Perfusion   | 43.465,60                  | 0,02                         |
| 41.000,00          | AAK   | 781.063,99                 | 0,44                         |
|                    |   | <b>110.670.610,18</b>      | <b>61,86</b>                 |
|                    | <b>Summe Aktien</b>   | <b>173.666.648,95</b>      | <b>97,07</b>                 |
|                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>173.666.648,95</b>      | <b>97,07</b>                 |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Aktien</b>   |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>  |                            |                              |
| 3.148,00           | Efecte Plc  | 41.238,80                  | 0,02                         |
| 11.000,00          | Herantis Pharma Plc   | 26.400,00                  | 0,01                         |
|                    |   | <b>67.638,80</b>           | <b>0,04</b>                  |
|                    | <b>SEK</b>  |                            |                              |
| 1.463,00           | Alpha Helix   | 366,76                     | 0,00                         |
| 72.737,00          | Bahnhof B   | 275.642,97                 | 0,15                         |
| 229.064,00         | Eurocon Consulting  | 156.406,72                 | 0,09                         |
|                    |   | <b>432.416,45</b>          | <b>0,24</b>                  |
|                    | <b>Summe Aktien</b>   | <b>500.055,25</b>          | <b>0,28</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>500.055,25</b>          | <b>0,28</b>                  |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
|                    | <b>Aktien</b>   |                            |                              |
|                    | <b>SEK</b>  |                            |                              |
| 62.730,00          | Midsummer TEMP  | 93.619,70                  | 0,05                         |
|                    |   | <b>93.619,70</b>           | <b>0,05</b>                  |
|                    | <b>Summe Aktien</b>   | <b>93.619,70</b>           | <b>0,05</b>                  |
|                    | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                     | <b>93.619,70</b>           | <b>0,05</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>174.260.323,90</b>      | <b>97,40</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>5.446.046,83</b>        | <b>3,04</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(798.453,14)</b>        | <b>(0,45)</b>                |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>178.907.917,59</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land         |              | Sektor  |              |
|--------------|--------------|---|--------------|
| Schweden     | 58,41        | Gesundheitswesen: Technologie                       | 7,81         |
| Finnland     | 18,54        | Hersteller von Elektronikausrüstung                 | 4,84         |
| Dänemark     | 10,55        | Papierprodukte                                      | 4,80         |
| Norwegen     | 6,16         | Bauprodukte   | 4,47         |
| Schweiz      | 3,60         | Handelsgesellschaften und Großhändler               | 4,45         |
| Kanada       | 0,10         | Bau- und Ingenieurwesen                             | 4,14         |
| USA          | 0,04         | Industriemaschinen                                  | 4,01         |
| <b>Summe</b> | <b>97,40</b> | Elektrische Komponenten und Ausrüstung              | 3,51         |
|              |              | Spezialgeschäfte                                    | 3,45         |
|              |              | Rundfunk  | 2,97         |
|              |              | Landwirtschafts- und Landmaschinen                  | 2,61         |
|              |              | Verschiedene Banken                                 | 2,39         |
|              |              | Einzelhandel: Heimwerker und Garten                 | 2,38         |
|              |              | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 2,30         |
|              |              | Forschungs- und Beratungsleistungen                 | 2,27         |
|              |              | Systemsoftware                                      | 2,24         |
|              |              | Lebensmitteleinzelhandel                            | 2,12         |
|              |              | Gesundheitswesen: Produkte                          | 2,08         |
|              |              | Freizeitartikel                                     | 2,04         |
|              |              | Personalwesen und Personaldienstleistungen          | 1,93         |
|              |              | Luftfahrt und Verteidigung                          | 1,88         |
|              |              | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 1,87         |
|              |              | Verlage   | 1,74         |
|              |              | Haushaltswaren und Fachgeschäfte                    | 1,61         |
|              |              | Verschiedene Support-Leistungen                     | 1,60         |
|              |              | Stahl   | 1,31         |
|              |              | Bildungsdienstleistungen                            | 1,25         |
|              |              | Vermögensverwaltung und Depotbanken                 | 1,15         |
|              |              | Verschiedene Metall- und Bergbaubetriebe            | 1,13         |
|              |              | Automobilhersteller                                 | 1,08         |
|              |              | Interaktives Home Entertainment                     | 0,93         |
|              |              | Verschiedene Chemikalien                            | 0,89         |
|              |              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 0,85         |
|              |              | Spezialchemikalien                                  | 0,75         |
|              |              | Reifen und Gummi                                    | 0,69         |
|              |              | Immobilien: REOC                                    | 0,67         |
|              |              | Dienste für die Herstellung elektronischer Geräte   | 0,65         |
|              |              | Schifffahrt   | 0,64         |
|              |              | Bekleidung, Accessoires und Luxusgüter              | 0,62         |
|              |              | Industriekonglomerate                               | 0,62         |
|              |              | Investmentbanken und Broker                         | 0,59         |
|              |              | Pharmazeutika                                       | 0,59         |
|              |              | Haushaltsprodukte                                   | 0,51         |
|              |              | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 0,50         |
|              |              | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 0,49         |
|              |              | Kraftfahrzeugeinzelhandel                           | 0,48         |
|              |              | Lebens- und Krankenversicherung                     | 0,46         |
|              |              | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie    | 0,39         |
|              |              | Autoteile und -zubehör                              | 0,36         |
|              |              | Drahtlose Telekommunikationsdienste                 | 0,36         |
|              |              | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 0,33         |
|              |              | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen      | 0,29         |
|              |              | Regionale Banken                                    | 0,29         |
|              |              | Unterhaltungselektronik                             | 0,27         |
|              |              | Mehrsparversicherungen                              | 0,27         |
|              |              | Papierverpackungen                                  | 0,25         |
|              |              | Halbleiter-Ausrüstung                               | 0,25         |
|              |              | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen           | 0,24         |
|              |              | Biotechnologie                                      | 0,20         |
|              |              | Brauereien  | 0,20         |
|              |              | Aluminium   | 0,16         |
|              |              | Computer und Elektronik-Einzelhandel                | 0,15         |
|              |              | Integrierte Telekommunikationsdienste               | 0,15         |
|              |              | Rohstoffchemikalien                                 | 0,14         |
|              |              | Spezialisierte Verbraucherdienste                   | 0,13         |
|              |              | Fluggesellschaften                                  | 0,06         |
|              |              | Baumaterialien                                      | 0,06         |
|              |              | Großhändler   | 0,06         |
|              |              | Hausbau   | 0,06         |
|              |              | Restaurants   | 0,06         |
|              |              | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  | 0,05         |
|              |              | Haushaltsgeräte                                     | 0,05         |
|              |              | Textilien   | 0,05         |
|              |              | Kupfer  | 0,04         |
|              |              | Luftfracht und Logistik                             | 0,03         |
|              |              | Hotels, Ferienanlagen und Kreuzfahrtrlinien         | 0,03         |
|              |              | Bürodienstleistungen und Bürobedarf                 | 0,03         |
|              |              | Anwendungssoftware                                  | 0,02         |
|              |              | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 0,01         |
|              |              | Sach- und Unfallversicherung                        | 0,01         |
|              |              | <b>Summe</b>  | <b>97,40</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>vom 30.12.2021 bis 31.12.2021<br>in der Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                      |                             |   |  |
| OMXS30 IND FUTURE 1/2022               | 21.01.2022 | SEK     | 103,00                               | 24.964.625,00               | 4.521,16  | 111.220,63   |
|  |            |         |                                      |                             | <b>4.521,16</b>   | <b>111.220,63</b>  |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |
| <b>DKK</b>  |   |                            |                              |
| 42.297,00   | Chr. Hansen Holding   | 2.931.548,28               | 3,74                         |
| 73.983,00   | Novo Nordisk B  | 7.312.440,54               | 9,32                         |
| 268.776,00  | Tryg  | 5.837.220,30               | 7,44                         |
| 101.156,00  | Vestas Wind Systems   | 2.720.600,13               | 3,47                         |
|   |   | <b>18.801.809,25</b>       | <b>23,97</b>                 |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |
| 883.062,00  | F-Secure  | 4.384.402,83               | 5,59                         |
| 48.100,00   | Huhtamäki   | 1.870.609,00               | 2,39                         |
| 101.629,00  | Kesko B   | 2.981.794,86               | 3,80                         |
| 43.397,00   | Musti Group   | 1.343.571,12               | 1,71                         |
| 64.521,00   | Neste   | 2.797.630,56               | 3,57                         |
| 559.077,00  | Nokia   | 3.116.295,20               | 3,97                         |
| 268.363,00  | Nordea Bank   | 2.894.563,32               | 3,69                         |
| 130.764,00  | Sampo A   | 5.761.461,84               | 7,35                         |
| 25.457,00   | UPM-Kymmene   | 851.791,22                 | 1,09                         |
|   |   | <b>26.002.119,95</b>       | <b>33,15</b>                 |
| <b>NOK</b>  |   |                            |                              |
| 48.658,00   | Bakkafrost  | 2.844.224,09               | 3,63                         |
| 180.151,00  | Gjensidige Forsikring   | 3.861.399,38               | 4,92                         |
| 48.172,00   | Tomra Systems   | 3.044.516,34               | 3,88                         |
|   |   | <b>9.750.139,81</b>        | <b>12,43</b>                 |
| <b>SEK</b>  |   |                            |                              |
| 62.373,00   | Atlas Copco A   | 3.807.436,84               | 4,85                         |
| 126.640,00  | Elektro B   | 1.415.032,82               | 1,80                         |
| 129.625,00  | Essity B  | 3.735.078,87               | 4,76                         |
| 40.020,00   | Evolution   | 5.020.952,42               | 6,40                         |
| 113.178,00  | Hennes & Mauritz B  | 1.965.973,59               | 2,51                         |
| 313.476,00  | Kindred Group SDB   | 3.293.218,27               | 4,20                         |
| 156.501,00  | Volvo B   | 3.200.460,71               | 4,08                         |
|   |   | <b>22.438.153,52</b>       | <b>28,61</b>                 |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>76.992.222,53</b>       | <b>98,17</b>                 |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>76.992.222,53</b>       | <b>98,17</b>                 |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>76.992.222,53</b>       | <b>98,17</b>                 |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>1.756.784,73</b>        | <b>2,24</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(322.216,87)</b>        | <b>(0,41)</b>                |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>78.426.790,39</b>       | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land         | Sektor  |
|--------------|---|
| Finnland     | Mehrsparversicherungen                              |
| Schweden     | Casinos und Glücksspiel                             |
| Dänemark     | Pharmazeutika                                       |
| Norwegen     | Sach- und Unfallversicherung                        |
| Malta        | Systemsoftware                                      |
| Färöer       | Industriemaschinen                                  |
| <b>Summe</b> | <b>Summe</b>  |
| 33,15        | 12,27   |
| 24,41        | 10,60   |
| 23,97        | 9,32  |
| 8,81         | 7,44  |
| 4,20         | 5,59  |
| 3,63         | 4,85  |
| 98,17        | 4,76  |
|              | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW |
|              | Kommunikationsanlagen                               |
|              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           |
|              | Lebensmitteleinzelhandel                            |
|              | Spezialchemikalien                                  |
|              | Verschiedene Banken                                 |
|              | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 |
|              | Öl- und Gasraffinerien und -marketing               |
|              | Elektrische Anlagen                                 |
|              | Bekleidung-Einzelhandel                             |
|              | Papierverpackungen                                  |
|              | Gesundheitswesen: Ausstattung                       |
|              | Spezialgeschäfte                                    |
|              | Papierprodukte                                      |
|              | 4,08  |
|              | 3,97  |
|              | 3,88  |
|              | 3,80  |
|              | 3,74  |
|              | 3,69  |
|              | 3,63  |
|              | 3,57  |
|              | 3,47  |
|              | 2,51  |
|              | 2,39  |
|              | 1,80  |
|              | 1,71  |
|              | 1,09  |
|              | 98,17   |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Nordic Stars Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |
| <b>DKK</b>  |   |                            |                              |
| 112.969,00  | Chr. Hansen Holding   | 7.829.729,70               | 3,12                         |
| 234.513,00  | Novo Nordisk B  | 23.179.140,73              | 9,23                         |
| 580.333,00  | Tryg  | 12.603.549,30              | 5,02                         |
| 274.621,00  | Vestas Wind Systems   | 7.385.957,61               | 2,94                         |
|   |   | <b>50.998.377,34</b>       | <b>20,30</b>                 |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |
| 145.198,00  | Enento Group Plc  | 4.791.534,00               | 1,91                         |
| 1.665.818,00  | F-Secure  | 8.270.786,37               | 3,29                         |
| 116.809,00  | Huhtamäki   | 4.542.702,01               | 1,81                         |
| 253.256,00  | Kesko B   | 7.430.531,04               | 2,96                         |
| 115.176,00  | Musti Group   | 3.565.848,96               | 1,42                         |
| 206.937,00  | Neste   | 8.972.788,32               | 3,57                         |
| 1.657.676,00  | Nokia   | 9.239.886,02               | 3,68                         |
| 368.528,00  | Nordea Bank   | 3.974.943,01               | 1,58                         |
| 352.598,00  | Sampo A   | 15.535.467,88              | 6,18                         |
| 89.303,00   | UPM-Kymmene   | 2.988.078,38               | 1,19                         |
| 180.054,00  | Uponor  | 3.770.330,76               | 1,50                         |
| 195.539,00  | Vaisala A   | 10.422.228,70              | 4,15                         |
|   |   | <b>83.505.125,45</b>       | <b>33,24</b>                 |
| <b>NOK</b>  |   |                            |                              |
| 141.453,00  | Bakkafrost  | 8.268.404,57               | 3,29                         |
| 551.462,00  | Gjensidige Forsikring   | 11.820.167,68              | 4,70                         |
| 142.834,00  | Tomra Systems   | 9.027.245,02               | 3,59                         |
|   |   | <b>29.115.817,27</b>       | <b>11,59</b>                 |
| <b>SEK</b>  |   |                            |                              |
| 121.807,00  | Atlas Copco A   | 7.435.468,23               | 2,96                         |
| 320.050,00  | Elekta B  | 3.576.131,18               | 1,42                         |
| 468.673,00  | Essity B  | 13.504.575,65              | 5,38                         |
| 46.442,00   | Fenix Outdoor Int. B  | 5.553.949,17               | 2,21                         |
| 326.113,00  | Hennes & Mauritz B  | 5.664.789,48               | 2,25                         |
| 219.364,00  | Holmen B  | 9.301.554,03               | 3,70                         |
| 161.094,00  | NENT Group B  | 7.372.892,22               | 2,93                         |
| 413.721,00  | Nordea Bank   | 4.459.337,68               | 1,77                         |
| 271.680,00  | Rejlers B   | 3.863.809,53               | 1,54                         |
| 547.750,00  | SECTRA B  | 10.696.630,05              | 4,26                         |
| 488.134,00  | Volvo B   | 9.982.387,89               | 3,97                         |
|   |   | <b>81.411.525,11</b>       | <b>32,40</b>                 |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>245.030.845,17</b>      | <b>97,53</b>                 |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>245.030.845,17</b>      | <b>97,53</b>                 |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>245.030.845,17</b>      | <b>97,53</b>                 |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>6.629.296,46</b>        | <b>2,64</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(415.003,20)</b>        | <b>(0,17)</b>                |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>251.245.138,43</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Nordic Stars Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land         |              | Sektor  |              |
|--------------|--------------|---|--------------|
| Finnland     | 35,01        | Mehrsparversicherungen                              | 10,89        |
| Schweden     | 28,42        | Pharmazeutika                                       | 9,23         |
| Dänemark     | 20,30        | Haushaltsprodukte                                   | 5,38         |
| Norwegen     | 8,30         | Sach- und Unfallversicherung                        | 5,02         |
| Färöer       | 3,29         | Papierprodukte                                      | 4,89         |
| Schweiz      | 2,21         | Gesundheitswesen: Technologie                       | 4,26         |
|              |              | Hersteller von Elektronikausrüstung                 | 4,15         |
| <b>Summe</b> | <b>97,53</b> | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 3,97         |
|              |              | Kommunikationsanlagen                               | 3,68         |
|              |              | Spezialgeschäfte                                    | 3,63         |
|              |              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 3,59         |
|              |              | Öl- und Gasraffinerien und -marketing               | 3,57         |
|              |              | Forschungs- und Beratungsleistungen                 | 3,44         |
|              |              | Verschiedene Banken                                 | 3,36         |
|              |              | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 3,29         |
|              |              | Systemsoftware                                      | 3,29         |
|              |              | Spezialchemikalien                                  | 3,12         |
|              |              | Lebensmitteleinzelhandel                            | 2,96         |
|              |              | Industriemaschinen                                  | 2,96         |
|              |              | Elektrische Anlagen                                 | 2,94         |
|              |              | Rundfunk  | 2,93         |
|              |              | Bekleidung-Einzelhandel                             | 2,25         |
|              |              | Papierverpackungen                                  | 1,81         |
|              |              | Bauprodukte   | 1,50         |
|              |              | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 1,42         |
|              |              | <b>Summe</b>  | <b>97,53</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.225.000,00  | AerCap Global Aviation 6.500% MULTI 15-06-2045  | 1.323.000,02               | 0,17                         | 866.000,00         | Encompass Health Corp 4.5% 01-02-2028           | 890.897,50                 | 0,12                         |
| 1.000.000,00  | Ally Financial Inc 5.75% 20-11-2025             | 1.128.278,35               | 0,15                         | 226.000,00         | Encompass Health Corp 4.625% 01-04-2031         | 229.955,00                 | 0,03                         |
| 1.861.000,00  | Altice France SA/France 5.5% 15-10-2029         | 1.833.085,00               | 0,24                         | 1.491.000,00       | Encompass Health Corp 4.75% 01-02-2030          | 1.535.730,00               | 0,20                         |
| 1.798.000,00  | Altice France SA/France 8.125% 01-02-2027       | 1.917.117,50               | 0,25                         | 744.000,00         | Ford Motor Credit Co LLC 2.7% 10-08-2026        | 750.510,00                 | 0,10                         |
| 791.000,00  | Apache Corp 4.625% 15-11-2025                   | 846.370,00                 | 0,11                         | 200.000,00         | Ford Motor Credit Co LLC 3.35% 01-11-2022       | 202.500,00                 | 0,03                         |
| 1.649.000,00  | ARD Finance SA 6.5% P-I-K 30-06-2027            | 1.698.470,00               | 0,22                         | 1.146.000,00       | Ford Motor Credit Co LLC 3.375% 13-11-2025      | 1.190.602,32               | 0,15                         |
| 445.000,00  | Ashtead Capital Inc 4% 01-05-2028               | 465.214,27                 | 0,06                         | 1.100.000,00       | Ford Motor Credit Co LLC 4% 13-11-2030          | 1.181.125,00               | 0,15                         |
| 716.000,00  | Ashtead Capital Inc 4.25% 01-11-2029            | 764.033,14                 | 0,10                         | 784.000,00         | Ford Motor Credit Co LLC 4.375% 06-08-2023      | 815.689,28                 | 0,11                         |
| 2.095.023,00  | Avation Capital SA 31-10-2026                   | 1.738.869,09               | 0,23                         | 1.493.000,00       | Ford Motor Credit Co LLC 4.389% 08-01-2026      | 1.608.707,50               | 0,21                         |
| 546.000,00  | Avis Budget Car Rental LLC / 5.375% 01-03-2029  | 575.931,72                 | 0,07                         | 600.000,00         | Ford Motor Credit Co LLC 5.596% 07-01-2022      | 600.420,00                 | 0,08                         |
| 3.951.000,00  | Ball Corp 2.875% 15-08-2030                     | 3.832.470,00               | 0,50                         | 1.459.000,00       | Freeport-McMoRan Inc 4.125% 01-03-2028          | 1.513.712,50               | 0,20                         |
| 2.599.000,00  | Barclays PLC 7.750% MULTI Perp FC2023           | 2.789.038,88               | 0,36                         | 980.000,00         | Freeport-McMoRan Inc 4.25% 01-03-2030           | 1.031.450,00               | 0,13                         |
| 1.327.000,00  | Barclays PLC 8.000% MULTI Perp FC2024           | 1.466.706,56               | 0,19                         | 1.555.000,00       | Freeport-McMoRan Inc 4.375% 01-08-2028          | 1.630.806,25               | 0,21                         |
| 1.498.000,00  | Bath & Body Works Inc 5.25% 01-02-2028          | 1.655.290,00               | 0,22                         | 847.000,00         | Freeport-McMoRan Inc 4.55% 14-11-2024           | 904.172,50                 | 0,12                         |
| 1.027.000,00  | Bath & Body Works Inc 6.75% 01-07-2036          | 1.268.345,00               | 0,16                         | 805.000,00         | Freeport-McMoRan Inc 4.625% 01-08-2030          | 863.362,50                 | 0,11                         |
| 702.000,00  | Bath & Body Works Inc 6.875% 01-11-2035         | 872.235,00                 | 0,11                         | 1.379.000,00       | Freeport-McMoRan Inc 5.45% 15-03-2043           | 1.735.816,25               | 0,23                         |
| 518.000,00  | Bath & Body Works Inc 7.5% 15-06-2029           | 586.635,00                 | 0,08                         | 796.000,00         | Goodyear Tire & Rubber Co/Th 4.875% 15-03-2027  | 841.770,00                 | 0,11                         |
| 228.000,00  | Bausch Health Cos Inc 5.25% 15-02-2031          | 200.355,00                 | 0,03                         | 1.252.000,00       | Goodyear Tire & Rubber Co/Th 5% 31-05-2026      | 1.284.865,00               | 0,17                         |
| 1.360.000,00  | Bausch Health Cos Inc 7% 15-01-2028             | 1.353.200,00               | 0,18                         | 1.883.000,00       | Goodyear Tire & Rubber Co/Th 9.5% 31-05-2025    | 2.035.504,17               | 0,26                         |
| 1.128.000,00  | Beazer Homes USA Inc 5.875% 15-10-2027          | 1.180.170,00               | 0,15                         | 1.577.000,00       | Grifols Escrow Issuer SA 4.75% 15-10-2028       | 1.608.886,94               | 0,21                         |
| 1.814.000,00  | Beazer Homes USA Inc 6.75% 15-03-2025           | 1.861.617,50               | 0,24                         | 2.048.000,00       | HCA Inc 3.5% 01-09-2030                         | 2.155.008,00               | 0,28                         |
| 2.669.000,00  | Callon Petroleum Co 6.125% 01-10-2024           | 2.628.965,00               | 0,34                         | 553.000,00         | HCA Inc 5.875% 01-02-2029                       | 658.927,15                 | 0,09                         |
| 2.175.000,00  | Calpine Corp 3.75% 01-03-2031                   | 2.109.750,00               | 0,27                         | 4.723.000,00       | HCA Inc 5.875% 15-02-2026                       | 5.342.775,68               | 0,69                         |
| 2.322.000,00  | Canpack SA / Canpack US LLC 3.875% 15-11-2029   | 2.266.852,50               | 0,29                         | 237.000,00         | HCA Inc 7.5% 06-11-2033                         | 340.095,00                 | 0,04                         |
| 711.000,00  | Carnival Corp 7.625% 01-03-2026                 | 746.948,16                 | 0,10                         | 1.663.000,00       | Iliad Holding SASU 7% 15-10-2028                | 1.741.992,50               | 0,23                         |
| 877.000,00  | CIT Group Inc 4.75% 16-02-2024                  | 925.235,00                 | 0,12                         | 1.687.000,00       | iStar Inc 4.25% 01-08-2025                      | 1.734.809,58               | 0,23                         |
| 600.000,00  | CIT Group Inc 5% 15-08-2022                     | 613.500,00                 | 0,08                         | 2.165.000,00       | iStar Inc 5.5% 15-02-2026                       | 2.246.187,50               | 0,29                         |
| 2.496.000,00  | Citigroup Inc 5.000% MULTI Perp FC2024          | 2.570.880,00               | 0,33                         | 2.190.000,00       | Ithaca Energy North Sea PLC 9% 15-07-2026       | 2.244.749,98               | 0,29                         |
| 850.000,00  | Credit Suisse Group AG 5.250% MULTI Perp FC2027 | 877.625,00                 | 0,11                         | 818.000,00         | JPMorgan Chase & Co MULTI Perpetual             | 818.000,00                 | 0,11                         |
| 200.000,00  | Credit Suisse Group AG 6.250% MULTI Perp FC2024 | 213.000,00                 | 0,03                         | 1.662.000,00       | KB Home 7.5% 15-09-2022                         | 1.732.635,00               | 0,23                         |
| 1.884.000,00  | Credit Suisse Group AG 6.375% MULTI Perp FC2026 | 2.030.575,20               | 0,26                         | 1.403.000,00       | KB Home 7.625% 15-05-2023                       | 1.474.903,75               | 0,19                         |
| 980.000,00  | Credit Suisse Group AG 7.250% MULTI Perp FC2025 | 1.076.902,40               | 0,14                         | 677.000,00         | Kinder Morgan Inc 7.75% 15-01-2032              | 956.184,58                 | 0,12                         |
| 740.000,00  | Credit Suisse Group AG 7.500% MULTI Perp FC2023 | 782.550,00                 | 0,10                         | 50.000,00          | Kinder Morgan Inc 8.05% 15-10-2030              | 68.073,73                  | 0,01                         |
| 3.241.000,00  | Credit Suisse Group AG 7.500% MULTI Perp FC2023 | 3.500.280,00               | 0,45                         | 949.000,00         | Kraft Heinz Foods Co 4.875% 01-10-2049          | 1.189.512,25               | 0,15                         |
| 2.507.000,00  | Crowdstrike Holdings Inc 3% 15-02-2029          | 2.481.930,00               | 0,32                         | 753.000,00         | Kraft Heinz Foods Co 5% 04-06-2042              | 927.271,19                 | 0,12                         |
| 1.639.000,00  | Dana Inc 4.5% 15-02-2032                        | 1.634.902,50               | 0,21                         | 2.797.000,00       | Kraft Heinz Foods Co 5% 15-07-2035              | 3.422.276,26               | 0,44                         |
| 1.460.000,00  | Dana Inc 5.375% 15-11-2027                      | 1.531.569,20               | 0,20                         | 536.000,00         | Kraft Heinz Foods Co 6.875% 26-01-2039          | 784.335,56                 | 0,10                         |
| 600.000,00  | Deutsche Bank AG 6.000% MULTI Perp FC2025       | 623.250,00                 | 0,08                         | 925.000,00         | Level 3 Financing Inc 5.375% 01-05-2025         | 945.132,63                 | 0,12                         |
| 1.196.000,00  | Deutsche Bank AG/New Yo 3.729% MULTI 14-01-2032 | 1.223.659,38               | 0,16                         | 937.000,00         | Lloyds Banking Group P 7.500% MULTI Perp FC2024 | 1.035.956,57               | 0,13                         |
| 1.830.000,00  | DISH DBS Corp 5% 15-03-2023                     | 1.868.887,50               | 0,24                         | 830.000,00         | Lloyds Banking Group P 7.500% MULTI Perp FC2025 | 938.433,24                 | 0,12                         |
| 680.000,00  | DISH DBS Corp 5.875% 15-07-2022                 | 690.200,00                 | 0,09                         | 1.777.000,00       | Lumen Technologies Inc 4.5% 15-01-2029          | 1.719.247,50               | 0,22                         |
|   |   |                            |                              | 2.962.000,00       | Lumen Technologies Inc 7.5% 01-04-2024          | 3.243.390,00               | 0,42                         |
|   |   |                            |                              | 740.000,00         | Meritage Homes Corp 5.125% 06-06-2027           | 815.850,01                 | 0,11                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 307.000,00         | Antero Resources Corp 8.375% 15-07-2026        | 349.537,92                 | 0,05                         | 1.261.000,00       | Cascades Inc/Cascades USA In 5.125% 15-01-2026 | 1.311.440,00               | 0,17                         |
| 1.702.000,00       | Arches Buyer Inc 4.25% 01-06-2028              | 1.700.468,20               | 0,22                         | 2.723.000,00       | Cascades Inc/Cascades USA In 5.375% 15-01-2028 | 2.791.075,00               | 0,36                         |
| 1.806.000,00       | Archrock Partners LP / Archr 6.25% 01-04-2028  | 1.883.152,32               | 0,24                         | 1.618.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.25% 01-02-2031  | 1.634.180,00               | 0,21                         |
| 1.438.000,00       | Ardagh Metal Packaging Finan 3.25% 01-09-2028  | 1.421.858,45               | 0,18                         | 1.349.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.25% 15-01-2034  | 1.327.183,30               | 0,17                         |
| 928.000,00         | Ardagh Metal Packaging Finan 4% 01-09-2029     | 921.968,00                 | 0,12                         | 2.156.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.5% 01-05-2032   | 2.209.900,00               | 0,29                         |
| 1.013.000,00       | Ardagh Packaging Finance PLC 5.25% 15-08-2027  | 1.019.331,25               | 0,13                         | 2.565.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.5% 15-08-2030   | 2.626.457,40               | 0,34                         |
| 651.000,00         | Ashton Woods USA LLC / Ashto 4.625% 01-04-2030 | 643.715,31                 | 0,08                         | 2.501.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.75% 01-03-2030  | 2.601.040,00               | 0,34                         |
| 605.000,00         | Ashton Woods USA LLC / Ashto 4.625% 01-08-2029 | 597.437,50                 | 0,08                         | 2.724.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 5% 01-02-2028     | 2.832.960,00               | 0,37                         |
| 1.234.000,00       | Ashton Woods USA LLC / Ashto 6.625% 15-01-2028 | 1.301.870,00               | 0,17                         | 785.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 5.375% 01-06-2029 | 845.342,95                 | 0,11                         |
| 1.506.000,00       | Associated Materials LLC / A 9% 01-09-2025     | 1.605.697,20               | 0,21                         | 916.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 5.5% 01-05-2026   | 941.190,00                 | 0,12                         |
| 5.761.000,00       | Avaya Inc 6.125% 15-09-2028                    | 6.106.660,00               | 0,79                         | 195.000,00         | Centene Corp 3.375% 15-02-2030                 | 199.387,50                 | 0,03                         |
| 385.000,00         | Avient Corp 5.75% 15-05-2025                   | 401.362,50                 | 0,05                         | 660.000,00         | Centene Corp 4.25% 15-12-2027                  | 688.050,00                 | 0,09                         |
| 1.655.000,00       | Avis Budget Car Rental LLC / 5.75% 15-07-2027  | 1.717.062,50               | 0,22                         | 479.000,00         | Centene Corp 4.625% 15-12-2029                 | 514.326,25                 | 0,07                         |
| 360.000,00         | Avolon Holdings Funding Ltd 5.25% 15-05-2024   | 386.121,14                 | 0,05                         | 1.102.000,00       | Central Garden & Pet Co 4.125% 30-04-2031      | 1.107.510,00               | 0,14                         |
| 798.000,00         | Bath & Body Works Inc 6.625% 01-10-2030        | 903.735,00                 | 0,12                         | 2.698.000,00       | Century Communities Inc 3.875% 15-08-2029      | 2.718.235,00               | 0,35                         |
| 189.000,00         | Bath & Body Works Inc 9.375% 01-07-2025        | 230.580,00                 | 0,03                         | 1.377.000,00       | Century Communities Inc 6.75% 01-06-2027       | 1.445.850,00               | 0,19                         |
| 1.472.000,00       | Bausch Health Americas Inc 8.5% 31-01-2027     | 1.545.600,00               | 0,20                         | 394.000,00         | Charles River Laboratories I 3.75% 15-03-2029  | 397.940,00                 | 0,05                         |
| 329.000,00         | Bausch Health Americas Inc 9.25% 01-04-2026    | 347.506,25                 | 0,05                         | 394.000,00         | Charles River Laboratories I 4% 15-03-2031     | 403.696,34                 | 0,05                         |
| 684.000,00         | Bausch Health Cos Inc 5% 15-02-2029            | 603.630,00                 | 0,08                         | 962.000,00         | Cheniere Corpus Christi Hold 5.875% 31-03-2025 | 1.066.804,78               | 0,14                         |
| 270.000,00         | Bausch Health Cos Inc 5% 30-01-2028            | 248.400,00                 | 0,03                         | 734.000,00         | Cheniere Energy Inc 4.625% 15-10-2028          | 774.370,00                 | 0,10                         |
| 270.000,00         | Bausch Health Cos Inc 5.25% 30-01-2030         | 237.600,00                 | 0,03                         | 1.949.000,00       | Cheniere Energy Partners LP 4% 01-03-2031      | 2.046.450,04               | 0,27                         |
| 625.000,00         | Bausch Health Cos Inc 5.5% 01-11-2025          | 631.250,00                 | 0,08                         | 1.201.000,00       | CHS/Community Health Systems 5.625% 15-03-2027 | 1.271.054,33               | 0,17                         |
| 1.120.000,00       | Bausch Health Cos Inc 6.125% 15-04-2025        | 1.140.999,99               | 0,15                         | 1.972.000,00       | CHS/Community Health Systems 6.625% 15-02-2025 | 2.041.020,02               | 0,27                         |
| 1.806.000,00       | Beazer Homes USA Inc 7.25% 15-10-2029          | 2.009.175,00               | 0,26                         | 238.000,00         | CHS/Community Health Systems 6.875% 15-04-2029 | 242.462,50                 | 0,03                         |
| 1.444.000,00       | Big River Steel LLC / BRS FI 6.625% 31-01-2029 | 1.561.325,00               | 0,20                         | 3.992.000,00       | CHS/Community Health Systems 8% 15-03-2026     | 4.196.590,00               | 0,55                         |
| 1.744.000,00       | Boise Cascade Co 4.875% 01-07-2030             | 1.839.920,02               | 0,24                         | 927.000,00         | Civitas Resources Inc 5% 15-10-2026            | 938.494,80                 | 0,12                         |
| 81.000,00          | Boyd Gaming Corp 4.75% 01-12-2027              | 83.207,25                  | 0,01                         | 302.463,00         | Civitas Resources Inc 7.5% 30-04-2026          | 302.463,00                 | 0,04                         |
| 1.255.000,00       | Boyd Gaming Corp 4.75% 15-06-2031              | 1.287.968,85               | 0,17                         | 1.317.000,00       | Clarios Global LP / Clarios 6.25% 15-05-2026   | 1.377.911,25               | 0,18                         |
| 262.000,00         | Boyd Gaming Corp 8.625% 01-06-2025             | 280.340,00                 | 0,04                         | 2.295.000,00       | Clarios Global LP / Clarios 8.5% 15-05-2027    | 2.432.700,00               | 0,32                         |
| 1.691.000,00       | Boyne USA Inc 4.75% 15-05-2029                 | 1.751.512,44               | 0,23                         | 1.694.000,00       | Clear Channel Outdoor Holdin 7.5% 01-06-2029   | 1.816.815,00               | 0,24                         |
| 562.000,00         | Builders FirstSource Inc 4.25% 01-02-2032      | 584.480,00                 | 0,08                         | 751.000,00         | Clear Channel Outdoor Holdin 7.75% 15-04-2028  | 809.202,50                 | 0,11                         |
| 268.000,00         | Builders FirstSource Inc 5% 01-03-2030         | 287.430,00                 | 0,04                         | 3.021.000,00       | Clear Channel Worldwide Hold 5.125% 15-08-2027 | 3.111.630,00               | 0,40                         |
| 1.594.000,00       | Builders FirstSource Inc 6.75% 01-06-2027      | 1.681.670,00               | 0,22                         | 934.000,00         | Clearway Energy Operating LL 3.75% 15-02-2031  | 934.896,64                 | 0,12                         |
| 456.000,00         | Cablevision Lightpath LLC 3.875% 15-09-2027    | 442.320,00                 | 0,06                         | 1.497.000,00       | Clearway Energy Operating LL 4.75% 15-03-2028  | 1.573.721,25               | 0,20                         |
| 245.000,00         | Cablevision Lightpath LLC 5.625% 15-09-2028    | 241.523,45                 | 0,03                         | 2.110.000,00       | Cleveland-Cliffs Inc 6.75% 15-03-2026          | 2.223.412,50               | 0,29                         |
| 1.932.000,00       | Caesars Entertainment Inc 4.625% 15-10-2029    | 1.938.394,92               | 0,25                         | 2.327.000,00       | CommScope Inc 4.75% 01-09-2029                 | 2.303.730,00               | 0,30                         |
| 741.000,00         | Callon Petroleum Co 6.375% 01-07-2026          | 715.065,00                 | 0,09                         | 1.538.000,00       | CommScope Inc 6% 01-03-2026                    | 1.584.140,00               | 0,21                         |
| 2.548.000,00       | Callon Petroleum Co 8.25% 15-07-2025           | 2.509.780,00               | 0,33                         | 1.419.000,00       | CommScope Inc 8.25% 01-03-2027                 | 1.450.927,50               | 0,19                         |
| 2.133.000,00       | Calpine Corp 4.5% 15-02-2028                   | 2.207.655,00               | 0,29                         | 2.343.000,00       | CommScope Technologies LLC 6% 15-06-2025       | 2.343.000,00               | 0,30                         |
| 488.000,00         | Calpine Corp 5% 01-02-2031                     | 488.000,00                 | 0,06                         | 783.000,00         | Comstock Resources Inc 5.875% 15-01-2030       | 802.575,00                 | 0,10                         |
| 1.703.000,00       | Calpine Corp 5.125% 15-03-2028                 | 1.728.817,48               | 0,22                         | 2.286.000,00       | Conduent Business Services L 6% 01-11-2029     | 2.260.282,50               | 0,29                         |
| 377.000,00         | Calpine Corp 5.25% 01-06-2026                  | 386.896,25                 | 0,05                         |                    |  |                            |                              |
| 808.000,00         | Carnival Corp 10.5% 01-02-2026                 | 920.110,00                 | 0,12                         |                    |  |                            |                              |
| 1.783.000,00       | Carnival Corp 6% 01-05-2029                    | 1.774.085,00               | 0,23                         |                    |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 2.303.000,00       | Connect Finco SARL / Connect 6.75% 01-10-2026      | 2.421.028,75               | 0,31                         | 542.000,00         | EQM Midstream Partners LP 6% 01-07-2025        | 585.360,00                 | 0,08                         |
| 1.814.000,00       | Constellium SE 5.625% 15-06-2028                   | 1.907.475,42               | 0,25                         | 1.051.000,00       | EQM Midstream Partners LP 6.5% 01-07-2027      | 1.177.120,00               | 0,15                         |
| 3.246.000,00       | Constellium SE 5.875% 15-02-2026                   | 3.298.747,50               | 0,43                         | 1.729.000,00       | First Quantum Minerals Ltd 7.25% 01-04-2023    | 1.748.883,50               | 0,23                         |
| 3.383.000,00       | Continental Airlines 2007-1 6.903% 19-04-2022      | 68.255,41                  | 0,01                         | 429.000,00         | First Quantum Minerals Ltd 7.5% 01-04-2025     | 441.312,30                 | 0,06                         |
| 2.108.000,00       | Cornerstone Building Brands 6.125% 15-01-2029      | 2.260.830,00               | 0,29                         | 1.497.000,00       | Flex Acquisition Co Inc 6.875% 15-01-2025      | 1.498.796,41               | 0,19                         |
| 1.705.000,00       | Coty Inc 5% 15-04-2026                             | 1.749.756,25               | 0,23                         | 1.906.000,00       | Flex Acquisition Co Inc 7.875% 15-07-2026      | 1.977.475,00               | 0,26                         |
| 1.411.000,00       | Coty Inc 6.5% 15-04-2026                           | 1.449.802,50               | 0,19                         | 839.000,00         | Frontier Communications Hold 5% 01-05-2028     | 859.975,00                 | 0,11                         |
| 1.012.000,00       | Covanta Holding Corp 5% 01-09-2030                 | 1.031.425,34               | 0,13                         | 1.077.000,00       | Frontier Communications Hold 5.875% 15-10-2027 | 1.138.927,50               | 0,15                         |
| 200.000,00         | Covert Mergeco Inc 4.875% 01-12-2029               | 203.000,00                 | 0,03                         | 1.694.000,00       | Frontier Communications Hold 6% 15-01-2030     | 1.685.530,00               | 0,22                         |
| 3.952.000,00       | Crown Americas LLC / Crown A 4.75% 01-02-2026      | 4.050.800,00               | 0,53                         | 2.352.000,00       | Frontier Communications Hold 6.75% 01-05-2029  | 2.434.320,00               | 0,32                         |
| 72.000,00          | CrownRock LP / CrownRock Fin 5% 01-05-2029         | 74.700,00                  | 0,01                         | 2.126.000,00       | FXI Holdings Inc 12.25% 15-11-2026             | 2.389.198,80               | 0,31                         |
| 4.957.000,00       | CrownRock LP / CrownRock Fin 5.625% 15-10-2025     | 5.068.532,50               | 0,66                         | 367.000,00         | Gap Inc/The 3.625% 01-10-2029                  | 361.495,00                 | 0,05                         |
| 880.000,00         | CSC Holdings LLC 4.125% 01-12-2030                 | 859.100,00                 | 0,11                         | 367.000,00         | Gap Inc/The 3.875% 01-10-2031                  | 361.953,75                 | 0,05                         |
| 1.386.000,00       | CSC Holdings LLC 4.5% 15-11-2031                   | 1.368.675,00               | 0,18                         | 2.330.000,00       | Garda World Security Corp 4.625% 15-02-2027    | 2.330.000,00               | 0,30                         |
| 4.206.000,00       | CSC Holdings LLC 4.625% 01-12-2030                 | 3.979.927,50               | 0,52                         | 1.467.000,00       | Garda World Security Corp 6% 01-06-2029        | 1.409.919,03               | 0,18                         |
| 1.075.000,00       | CSC Holdings LLC 5.375% 01-02-2028                 | 1.113.968,75               | 0,14                         | 775.000,00         | Garda World Security Corp 9.5% 01-11-2027      | 829.250,00                 | 0,11                         |
| 729.000,00         | CSC Holdings LLC 6.5% 01-02-2029                   | 780.030,00                 | 0,10                         | 461.000,00         | Gartner Inc 3.625% 15-06-2029                  | 466.094,05                 | 0,06                         |
| 1.225.000,00       | CSC Holdings LLC 7.5% 01-04-2028                   | 1.313.812,50               | 0,17                         | 790.000,00         | Gartner Inc 3.75% 01-10-2030                   | 807.696,00                 | 0,10                         |
| 587.000,00         | CSI Compressco LP / CSI Comp 7.5% 01-04-2025       | 591.402,50                 | 0,08                         | 1.637.000,00       | Gartner Inc 4.5% 01-07-2028                    | 1.709.658,25               | 0,22                         |
| 557.000,00         | CSI Compressco LP / CSI Comp 7.5% 01-04-2025       | 561.177,50                 | 0,07                         | 2.787.000,00       | Glatfelter Corp 4.75% 15-11-2029               | 2.874.093,75               | 0,37                         |
| 1.909.454,00       | CSI Compressco LP / CSI Compressco Finance Inc 01- | 1.871.264,92               | 0,24                         | 1.850.000,00       | Global Atlantic Fin Co 4.700% MULTI 15-10-2051 | 1.875.093,38               | 0,24                         |
| 1.414.000,00       | Cushman & Wakefield US Borro 6.75% 15-05-2028      | 1.523.726,40               | 0,20                         | 1.316.000,00       | Goodyear Tire & Rubber Co/Th 5% 15-07-2029     | 1.413.647,20               | 0,18                         |
| 4.674.000,00       | Dana Financing Luxembourg Sa 5.75% 15-04-2025      | 4.785.007,50               | 0,62                         | 830.000,00         | Graphic Packaging Internatio 3.5% 01-03-2029   | 823.775,00                 | 0,11                         |
| 4.164.000,00       | DaVita Inc 3.75% 15-02-2031                        | 4.049.490,00               | 0,53                         | 2.187.000,00       | Graphic Packaging Internatio 3.5% 15-03-2028   | 2.181.532,50               | 0,28                         |
| 1.288.000,00       | DaVita Inc 4.625% 01-06-2030                       | 1.318.590,00               | 0,17                         | 1.725.000,00       | Gray Escrow II Inc 5.375% 15-11-2031           | 1.772.247,75               | 0,23                         |
| 2.502.000,00       | DCP Midstream LP 7.375% MULTI Perp FC2022          | 2.470.725,00               | 0,32                         | 2.703.000,00       | Gray Television Inc 4.75% 15-10-2030           | 2.689.485,00               | 0,35                         |
| 1.766.000,00       | DCP Midstream Operating LP 5.375% 15-07-2025       | 1.940.092,28               | 0,25                         | 2.880.000,00       | Gray Television Inc 7% 15-05-2027              | 3.078.000,00               | 0,40                         |
| 3.662.000,00       | Diamond Sports Group LLC / D 5.375% 15-08-2026     | 1.859.197,40               | 0,24                         | 2.879.000,00       | Greif Inc 6.5% 01-03-2027                      | 2.986.962,64               | 0,39                         |
| 318.000,00         | Diamond Sports Group LLC / D 6.625% 15-08-2027     | 89.040,00                  | 0,01                         | 3.561.000,00       | Hartford Financial Services FRN 12-02-2047     | 3.392.640,51               | 0,44                         |
| 3.559.000,00       | Directv Financing LLC / Dire 5.875% 15-08-2027     | 3.651.818,72               | 0,47                         | 1.952.000,00       | HAT Holdings I LLC / HAT Hol 3.375% 15-06-2026 | 1.961.760,02               | 0,25                         |
| 1.394.000,00       | DISH DBS Corp 5.25% 01-12-2026                     | 1.418.395,00               | 0,18                         | 1.015.000,00       | HAT Holdings I LLC / HAT Hol 6% 15-04-2025     | 1.053.062,50               | 0,14                         |
| 1.427.000,00       | DISH DBS Corp 5.75% 01-12-2028                     | 1.437.702,50               | 0,19                         | 2.378.000,00       | Helios Software Holdings Inc 4.625% 01-05-2028 | 2.330.440,00               | 0,30                         |
| 1.449.000,00       | DISH DBS Corp 7.375% 01-07-2028                    | 1.467.112,50               | 0,19                         | 3.420.000,00       | Herc Holdings Inc 5.5% 15-07-2027              | 3.556.800,00               | 0,46                         |
| 1.802.000,00       | DISH DBS Corp 7.75% 01-07-2026                     | 1.901.110,00               | 0,25                         | 218.000,00         | Hertz Corp/The 4.625% 01-12-2026               | 219.362,50                 | 0,03                         |
| 1.936.000,00       | Domtar Corp 6.75% 01-10-2028                       | 1.984.400,00               | 0,26                         | 442.000,00         | Hertz Corp/The 5% 01-12-2029                   | 442.377,91                 | 0,06                         |
| 1.119.000,00       | DT Midstream Inc 4.125% 15-06-2029                 | 1.145.576,25               | 0,15                         | 95.000,00          | Hess Midstream Operations LP 4.25% 15-02-2030  | 94.287,50                  | 0,01                         |
| 280.000,00         | DT Midstream Inc 4.375% 15-06-2031                 | 291.200,00                 | 0,04                         | 2.112.000,00       | Hess Midstream Operations LP 5.125% 15-06-2028 | 2.199.120,00               | 0,29                         |
| 2.523.000,00       | Eagle Intermediate Global Ho 7.5% 01-05-2025       | 2.284.828,80               | 0,30                         | 2.631.000,00       | Hexion Inc 7.875% 15-07-2027                   | 2.775.705,00               | 0,36                         |
| 2.161.000,00       | eG Global Finance PLC 6.75% 07-02-2025             | 2.188.012,50               | 0,28                         | 1.190.000,00       | Hilton Domestic Operating Co 4.875% 15-01-2030 | 1.271.812,50               | 0,17                         |
| 681.000,00         | eG Global Finance PLC 8.5% 30-10-2025              | 705.686,25                 | 0,09                         | 103.000,00         | Hilton Domestic Operating Co 5.375% 01-05-2025 | 107.181,80                 | 0,01                         |
| 2.850.000,00       | Elwood Energy LLC 8.159% 05-07-2026                | 592.237,13                 | 0,08                         | 910.000,00         | Hilton Domestic Operating Co 5.75% 01-05-2028  | 964.600,00                 | 0,13                         |
| 1.504.000,00       | Endo Dac / Endo Finance LLC 6% 30-06-2028          | 1.123.848,96               | 0,15                         | 1.848.000,00       | Hilton Grand Vacations Borro 4.875% 01-07-2031 | 1.857.240,00               | 0,24                         |
| 1.417.000,00       | Endo Dac / Endo Finance LLC 9.5% 31-07-2027        | 1.442.392,60               | 0,19                         | 876.000,00         | Hilton Grand Vacations Borro 5% 01-06-2029     | 897.900,00                 | 0,12                         |
| 1.365.000,00       | Endo Luxembourg Finance Co I 6.125% 01-04-2029     | 1.330.875,00               | 0,17                         | 221.000,00         | Hughes Satellite Systems Cor 5.25% 01-08-2026  | 241.718,75                 | 0,03                         |
|                    |  |                            |                              | 1.717.000,00       | Hughes Satellite Systems Cor 6.625% 01-08-2026 | 1.923.040,00               | 0,25                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 1.250.000,00       | iHeartCommunications Inc 6.375% 01-05-2026     | 1.296.875,00               | 0,17                         | 1.023.000,00       | NCL Corp Ltd 12.25% 15-05-2024                 | 1.212.255,00               | 0,16                         |
| 2.329.211,00       | iHeartCommunications Inc 8.375% 01-05-2027     | 2.457.317,61               | 0,32                         | 1.873.000,00       | NCL Corp Ltd 3.625% 15-12-2024                 | 1.779.350,00               | 0,23                         |
| 1.807.000,00       | Iliad Holding SASU 6.5% 15-10-2026             | 1.898.669,11               | 0,25                         | 584.000,00         | NCL Corp Ltd 5.875% 15-03-2026                 | 585.354,88                 | 0,08                         |
| 1.129.000,00       | Intelsat Jackson Holdings SA 15-10-2024        | 517.403,77                 | 0,07                         | 946.000,00         | NCR Corp 5% 01-10-2028                         | 972.015,00                 | 0,13                         |
| 644.000,00         | International Game Technolog 4.125% 15-04-2026 | 663.365,08                 | 0,09                         | 1.491.000,00       | NCR Corp 5.125% 15-04-2029                     | 1.539.457,50               | 0,20                         |
| 284.000,00         | International Game Technolog 5.25% 15-01-2029  | 301.366,60                 | 0,04                         | 1.125.000,00       | NCR Corp 5.25% 01-10-2030                      | 1.155.937,50               | 0,15                         |
| 2.374.000,00       | International Game Technolog 6.5% 15-02-2025   | 2.599.411,30               | 0,34                         | 789.000,00         | NCR Corp 5.75% 01-09-2027                      | 822.532,50                 | 0,11                         |
| 218.000,00         | Intesa Sanpaolo SpA 4.198% MULTI 01-06-2032    | 220.071,61                 | 0,03                         | 2.500.000,00       | Netflix Inc 3.625% 15-06-2025                  | 2.634.500,00               | 0,34                         |
| 1.825.000,00       | Intesa Sanpaolo SpA 5.71% 15-01-2026           | 2.019.544,93               | 0,26                         | 628.000,00         | Netflix Inc 4.875% 15-06-2030                  | 730.835,00                 | 0,09                         |
| 666.000,00         | Iron Mountain Inc 4.5% 15-02-2031              | 673.119,54                 | 0,09                         | 359.000,00         | New Gold Inc 6.375% 15-05-2025                 | 368.872,50                 | 0,05                         |
| 2.987.000,00       | Iron Mountain Inc 5.25% 15-03-2028             | 3.106.480,00               | 0,40                         | 2.920.000,00       | New Gold Inc 7.5% 15-07-2027                   | 3.102.500,00               | 0,40                         |
| 1.160.000,00       | Iron Mountain Information Ma 5% 15-07-2032     | 1.188.605,60               | 0,15                         | 1.259.000,00       | Nielsen Finance LLC / Nielse 4.5% 15-07-2029   | 1.238.528,66               | 0,16                         |
| 1.708.000,00       | Kraft Heinz Foods Co 3.875% 15-05-2027         | 1.845.873,01               | 0,24                         | 1.896.000,00       | Nielsen Finance LLC / Nielse 5.625% 01-10-2028 | 1.952.880,00               | 0,25                         |
| 1.610.000,00       | Ladder Capital Finance Holdi 4.25% 01-02-2027  | 1.615.313,00               | 0,21                         | 575.000,00         | Nielsen Finance LLC / Nielse 5.875% 01-10-2030 | 603.031,25                 | 0,08                         |
| 1.576.000,00       | Ladder Capital Finance Holdi 5.25% 01-10-2025  | 1.595.700,02               | 0,21                         | 1.633.000,00       | NOVA Chemicals Corp 4.875% 01-06-2024          | 1.688.113,75               | 0,22                         |
| 1.284.000,00       | LCPR Senior Secured Financin 5.125% 15-07-2029 | 1.290.420,00               | 0,17                         | 3.418.000,00       | NOVA Chemicals Corp 5.25% 01-06-2027           | 3.640.170,00               | 0,47                         |
| 2.469.000,00       | LCPR Senior Secured Financin 6.75% 15-10-2027  | 2.592.450,00               | 0,34                         | 210.000,00         | Novelis Corp 3.25% 15-11-2026                  | 211.837,50                 | 0,03                         |
| 1.735.000,00       | Level 3 Financing Inc 3.625% 15-01-2029        | 1.648.250,00               | 0,21                         | 215.000,00         | Novelis Corp 3.875% 15-08-2031                 | 213.656,25                 | 0,03                         |
| 1.101.000,00       | Level 3 Financing Inc 3.75% 15-07-2029         | 1.045.950,00               | 0,14                         | 1.443.000,00       | Novelis Corp 4.75% 30-01-2030                  | 1.516.953,75               | 0,20                         |
| 1.533.000,00       | Level 3 Financing Inc 4.25% 01-07-2028         | 1.517.670,00               | 0,20                         | 1.021.000,00       | NRG Energy Inc 3.625% 15-02-2031               | 995.475,00                 | 0,13                         |
| 4.913.000,00       | Lincoln National Corp FRN 17-05-2066           | 4.360.287,50               | 0,57                         | 665.000,00         | NRG Energy Inc 3.875% 15-02-2032               | 651.700,00                 | 0,08                         |
| 1.915.000,00       | Lions Gate Capital Holdings 5.5% 15-04-2029    | 1.953.300,00               | 0,25                         | 3.124.000,00       | Oasis Midstream Partners LP 8% 01-04-2029      | 3.400.161,60               | 0,44                         |
| 1.895.000,00       | LPL Holdings Inc 4% 15-03-2029                 | 1.940.006,25               | 0,25                         | 1.119.000,00       | Oasis Petroleum Inc 6.375% 01-06-2026          | 1.169.355,00               | 0,15                         |
| 2.102.000,00       | LSF9 Atlantis Holdings LLC / 7.75% 15-02-2026  | 2.125.479,34               | 0,28                         | 1.439.000,00       | Occidental Petroleum Corp 6.2% 15-03-2040      | 1.769.970,00               | 0,23                         |
| 1.649.000,00       | Lumen Technologies Inc 5.125% 15-12-2026       | 1.718.225,02               | 0,22                         | 3.425.000,00       | Occidental Petroleum Corp 6.45% 15-09-2036     | 4.366.875,00               | 0,57                         |
| 1.735.000,00       | Lumen Technologies Inc 5.375% 15-06-2029       | 1.735.000,00               | 0,23                         | 339.000,00         | Occidental Petroleum Corp 6.6% 15-03-2046      | 439.852,50                 | 0,06                         |
| 1.112.000,00       | Madison IAQ LLC 4.125% 30-06-2028              | 1.114.780,00               | 0,14                         | 2.217.000,00       | Ohio National Financial Serv 5.8% 24-01-2030   | 2.512.014,44               | 0,33                         |
| 328.000,00         | Madison IAQ LLC 5.875% 30-06-2029              | 327.999,96                 | 0,04                         | 1.415.000,00       | Organon & Co / Organon Forei 4.125% 30-04-2028 | 1.437.993,75               | 0,19                         |
| 565.000,00         | Marriott Ownership Resorts I 4.5% 15-06-2029   | 568.683,80                 | 0,07                         | 720.000,00         | Organon & Co / Organon Forei 5.125% 30-04-2031 | 750.600,00                 | 0,10                         |
| 481.000,00         | Mattel Inc 3.15% 15-03-2023                    | 489.417,50                 | 0,06                         | 1.730.000,00       | Owens-Brockway Glass Contain 5.875% 15-08-2023 | 1.812.175,00               | 0,24                         |
| 389.000,00         | Mattel Inc 5.45% 01-11-2041                    | 463.882,50                 | 0,06                         | 1.789.000,00       | Pactiv Evergreen Group Issue 4% 15-10-2027     | 1.739.802,50               | 0,23                         |
| 2.413.000,00       | Mauser Packaging Solutions H 5.5% 15-04-2024   | 2.435.127,21               | 0,32                         | 3.068.000,00       | Par Pharmaceutical Inc 7.5% 01-04-2027         | 3.133.195,00               | 0,41                         |
| 305.000,00         | Meritor Inc 4.5% 15-12-2028                    | 305.762,50                 | 0,04                         | 410.000,00         | Park Aerospace Holdings Ltd 5.25% 15-08-2022   | 418.989,94                 | 0,05                         |
| 1.184.000,00       | MGM Growth Properties Operat 3.875% 15-02-2029 | 1.247.790,96               | 0,16                         | 1.096.000,00       | Park Intermediate Holdings L 5.875% 01-10-2028 | 1.146.196,80               | 0,15                         |
| 559.000,00         | MGM Growth Properties Operat 4.625% 15-06-2025 | 595.335,00                 | 0,08                         | 2.499.000,00       | Park Intermediate Holdings L 7.5% 01-06-2025   | 2.640.743,30               | 0,34                         |
| 1.074.000,00       | MGM Growth Properties Operat 5.75% 01-02-2027  | 1.210.935,00               | 0,16                         | 652.000,00         | Parkland Corp 4.5% 01-10-2029                  | 648.740,00                 | 0,08                         |
| 2.482.000,00       | Mineral Resources Ltd 8.125% 01-05-2027        | 2.676.042,76               | 0,35                         | 354.000,00         | Parkland Corp 4.625% 01-05-2030                | 351.787,50                 | 0,05                         |
| 946.000,00         | Moss Creek Resources Holding 10.5% 15-05-2027  | 947.182,50                 | 0,12                         | 1.584.000,00       | Parkland Corp 5.875% 15-07-2027                | 1.673.242,56               | 0,22                         |
| 282.000,00         | Moss Creek Resources Holding 7.5% 15-01-2026   | 264.375,00                 | 0,03                         | 2.178.000,00       | Patrick Industries Inc 7.5% 15-10-2027         | 2.319.570,00               | 0,30                         |
| 2.709.000,00       | Mozart Debt Merger Sub Inc 3.875% 01-04-2029   | 2.695.455,00               | 0,35                         | 1.634.000,00       | PDC Energy Inc 6.125% 15-09-2024               | 1.654.425,00               | 0,21                         |
| 2.795.000,00       | MSCI Inc 3.625% 01-09-2030                     | 2.857.887,50               | 0,37                         | 1.534.000,00       | Post Holdings Inc 4.625% 15-04-2030            | 1.562.379,00               | 0,20                         |
| 3.154.000,00       | Navient Corp 5.875% 25-10-2024                 | 3.359.010,00               | 0,44                         | 4.173.000,00       | Post Holdings Inc 5.5% 15-12-2029              | 4.376.433,75               | 0,57                         |
| 693.000,00         | NCL Corp Ltd 10.25% 01-02-2026                 | 805.612,50                 | 0,10                         | 1.317.000,00       | Post Holdings Inc 5.625% 15-01-2028            | 1.386.142,50               | 0,18                         |
|                    |  |                            |                              | 2.812.000,00       | Rackspace Technology Global 3.5% 15-02-2028    | 2.657.340,00               | 0,35                         |
|                    |  |                            |                              | 2.344.000,00       | Rite Aid Corp 7.5% 01-07-2025                  | 2.409.632,07               | 0,31                         |
|                    |  |                            |                              | 1.788.000,00       | Rite Aid Corp 8% 15-11-2026                    | 1.823.760,00               | 0,24                         |
|                    |  |                            |                              | 600.000,00         | Royal Caribbean Cruises Ltd 10.875% 01-06-2023 | 655.500,00                 | 0,09                         |
|                    |  |                            |                              | 571.000,00         | Royal Caribbean Cruises Ltd 11.5% 01-06-2025   | 639.520,01                 | 0,08                         |
|                    |  |                            |                              | 508.000,00         | Royal Caribbean Cruises Ltd 4.25% 01-07-2026   | 488.950,00                 | 0,06                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |
| 174.000,00  | Ultra Resources Inc/US 15-04-2022 NEW Escrow                            | 0,00                       | 0,00                         |
| 1.494.000,00  | Ultra Resources Inc/US 15-04-2025 NEW Escrow                            | 0,01                       | 0,00                         |
|   |   | <b>0,01</b>                | <b>0,00</b>                  |
|   | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>0,01</b>                | <b>0,00</b>                  |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |
| 68.871,00   | Homer City Generation - LLC unit  | 0,07                       | 0,00                         |
| 573.197,76  | New AMI I, LLC  | 3.324.547,02               | 0,43                         |
|   |   | <b>3.324.547,09</b>        | <b>0,43</b>                  |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>3.324.547,09</b>        | <b>0,43</b>                  |
|   | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>3.324.547,10</b>        | <b>0,43</b>                  |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>737.693.161,33</b>      | <b>95,84</b>                 |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>20.760.969,41</b>       | <b>2,70</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>                                     | <b>11.286.781,05</b>       | <b>1,47</b>                  |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>769.740.911,79</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor                                 |              |
|------------------------|--------------|--|--------------|
| USA                    | 76,38        | Unternehmensanleihen                   | 95,10        |
| Vereinigtes Königreich | 3,45         | Sonstige                               | 0,43         |
| Kanada                 | 3,32         | Spezialchemikalien                     | 0,23         |
| Länderübergreifend     | 2,87         | Öl- und Gaserschließung und Produktion | 0,08         |
| Luxemburg              | 1,70         |  |              |
| Frankreich             | 1,64         | <b>Summe</b>                           | <b>95,84</b> |
| Niederlande            | 1,59         |  |              |
| Bermuda                | 1,18         |  |              |
| Schweiz                | 1,10         |  |              |
| Irland                 | 0,50         |  |              |
| Panama                 | 0,45         |  |              |
| Liberia                | 0,39         |  |              |
| Australien             | 0,35         |  |              |
| Italien                | 0,29         |  |              |
| Deutschland            | 0,24         |  |              |
| Spanien                | 0,21         |  |              |
| Kaimaninseln           | 0,18         |  |              |
| <b>Summe</b>           | <b>95,84</b> |  |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 1.589.000.670,55                                  | DKK               | 240.727.107,17     | USD                | 1.438.318,91   | 28.01.2022 |
| 25.934.575,35                                     | EUR               | 29.215.301,03      | USD                | 175.757,35   | 28.01.2022 |
| 169.866.120,68                                    | SEK               | 18.888.488,49      | USD                | (117.161,65)   | 28.01.2022 |
| 2.753.560,03                                      | USD               | 18.122.880,18      | DKK                | (8.386,89)   | 28.01.2022 |
| 337.419,05  | USD               | 298.717,42         | EUR                | (1.110,60)   | 28.01.2022 |
| 388.070,09  | USD               | 3.518.879,04       | SEK                | (789,12)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>1.486.628,00</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.105.000,00  | Ashtead Capital Inc 4.25% 01-11-2029            | 1.179.129,36               | 0,15                         | 2.455.000,00       | Meritage Homes Corp 6% 01-06-2025   | 2.727.259,50               | 0,35                         |
| 200.000,00  | Barclays PLC 5.088% MULTI 20-06-2030            | 227.013,95                 | 0,03                         | 5.909.000,00       | MPT Operating Partnership LP 3.5% 15-03-2031  | 5.990.248,75               | 0,77                         |
| 2.068.000,00  | Barclays PLC 7.750% MULTI Perp FC2023           | 2.219.212,16               | 0,29                         | 272.000,00         | Netflix Inc 4.875% 15-04-2028   | 310.826,64                 | 0,04                         |
| 2.784.000,00  | Barclays PLC 8.000% MULTI Perp FC2024           | 3.077.099,52               | 0,40                         | 10.160.000,00      | Primo Water Holdings Inc 4.375% 30-04-2029  | 10.058.400,00              | 1,30                         |
| 15.000,00   | Bausch Health Cos Inc 5.25% 15-02-2031          | 13.181,25                  | 0,00                         | 1.419.000,00       | Seagate HDD Cayman 4.875% 01-03-2024  | 1.493.497,50               | 0,19                         |
| 176.000,00  | Bausch Health Cos Inc 7% 15-01-2028             | 175.120,00                 | 0,02                         | 8.749.000,00       | Sprint Corp 7.875% 15-09-2023   | 9.642.404,14               | 1,25                         |
| 689.000,00  | Beazer Homes USA Inc 6.75% 15-03-2025           | 707.086,25                 | 0,09                         | 792.000,00         | Standard Industries Inc/NJ 3.375% 15-01-2031  | 754.380,00                 | 0,10                         |
| 1.097.000,00  | CIT Group Inc 4.75% 16-02-2024                  | 1.157.335,00               | 0,15                         | 622.000,00         | Telecom Italia Capital SA 6% 30-09-2034   | 657.864,52                 | 0,08                         |
| 325.000,00  | Citigroup Inc 4.000% MULTI Perp FC2025          | 327.437,50                 | 0,04                         | 619.000,00         | Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-11-2033   | 666.539,20                 | 0,09                         |
| 2.058.000,00  | Citigroup Inc 5.000% MULTI Perp FC2024          | 2.119.740,00               | 0,27                         | 1.295.000,00       | Tenet Healthcare Corp 4.25% 01-06-2029  | 1.311.187,50               | 0,17                         |
| 3.688.000,00  | Dana Inc 4.5% 15-02-2032                        | 3.678.780,00               | 0,48                         | 290.000,00         | Tenet Healthcare Corp 6.75% 15-06-2023  | 309.937,50                 | 0,04                         |
| 791.000,00  | Dana Inc 5.375% 15-11-2027                      | 829.774,82                 | 0,11                         | 1.500.000,00       | T-Mobile USA Inc 3.375% 15-04-2029  | 1.528.844,96               | 0,20                         |
| 4.251.000,00  | Dana Inc 5.625% 15-06-2028                      | 4.516.687,50               | 0,58                         | 2.199.000,00       | Travel + Leisure Co 5.65% 01-04-2024  | 2.336.437,50               | 0,30                         |
| 200.000,00  | Deutsche Bank AG 6.000% MULTI Perp FC2025       | 207.750,00                 | 0,03                         | 1.272.000,00       | Travel + Leisure Co 6% 01-04-2027   | 1.382.371,44               | 0,18                         |
| 1.388.000,00  | DISH DBS Corp 5% 15-03-2023                     | 1.417.495,00               | 0,18                         | 546.000,00         | Travel + Leisure Co 6.6% 01-10-2025   | 607.818,12                 | 0,08                         |
| 121.000,00  | Encompass Health Corp 4.5% 01-02-2028           | 124.478,75                 | 0,02                         | 873.000,00         | Trivium Packaging Finance BV 5.5% 15-08-2026  | 907.920,00                 | 0,12                         |
| 1.286.000,00  | Encompass Health Corp 4.625% 01-04-2031         | 1.308.505,00               | 0,17                         | 1.067.000,00       | United Airlines Holdings Inc 4.875% 15-01-2025  | 1.097.676,25               | 0,14                         |
| 4.996.000,00  | Encompass Health Corp 4.75% 01-02-2030          | 5.145.880,00               | 0,66                         | 2.644.000,00       | United Rentals North America 3.75% 15-01-2032   | 2.662.514,61               | 0,34                         |
| 342.000,00  | Encompass Health Corp 5.75% 15-09-2025          | 347.985,00                 | 0,04                         | 6.649.000,00       | United Rentals North America 4% 15-07-2030  | 6.854.321,12               | 0,89                         |
| 534.000,00  | Ford Motor Credit Co LLC 2.7% 10-08-2026        | 538.672,50                 | 0,07                         | 805.000,00         | United Wholesale Mortgage LL 5.5% 15-04-2029  | 788.900,00                 | 0,10                         |
| 1.334.000,00  | Ford Motor Credit Co LLC 3.37% 17-11-2023       | 1.369.044,18               | 0,18                         | 1.394.000,00       | Virgin Media Secured Finance 5.5% 15-05-2029  | 1.456.730,00               | 0,19                         |
| 1.251.000,00  | Ford Motor Credit Co LLC 3.375% 13-11-2025      | 1.299.688,92               | 0,17                         | 5.176.000,00       | Western Digital Corp 4.75% 15-02-2026   | 5.654.780,00               | 0,73                         |
| 2.887.000,00  | Ford Motor Credit Co LLC 4% 13-11-2030          | 3.099.916,25               | 0,40                         | 2.200.000,00       | Ziggo Bond Co BV 6% 15-01-2027  | 2.266.000,00               | 0,29                         |
| 2.100.000,00  | Goodyear Tire & Rubber Co/Th 4.875% 15-03-2027  | 2.220.750,00               | 0,29                         |                    |   | <b>141.004.761,89</b>      | <b>18,21</b>                 |
| 5.639.000,00  | Grifols Escrow Issuer SA 4.75% 15-10-2028       | 5.753.020,58               | 0,74                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>141.004.761,89</b>      | <b>18,21</b>                 |
| 3.528.000,00  | HCA Inc 3.5% 01-09-2030                         | 3.712.338,00               | 0,48                         |                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>141.004.761,89</b>      | <b>18,21</b>                 |
| 1.760.000,00  | HCA Inc 5.375% 01-02-2025                       | 1.934.240,00               | 0,25                         |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
| 1.625.000,00  | HCA Inc 5.875% 15-02-2026                       | 1.838.240,63               | 0,24                         |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
| 1.510.000,00  | Iliad Holding SASU 7% 15-10-2028                | 1.581.725,00               | 0,20                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 1.286.000,00  | iStar Inc 5.5% 15-02-2026                       | 1.334.225,00               | 0,17                         | 787.000,00         | 1011778 BC ULC / New Red Fin 3.875% 15-01-2028  | 796.837,50                 | 0,10                         |
| 1.506.000,00  | JPMorgan Chase & Co 4.600% MULTI Perp FC2025    | 1.545.532,50               | 0,20                         | 4.012.000,00       | 1011778 BC ULC / New Red Fin 4% 15-10-2030  | 3.941.790,00               | 0,51                         |
| 1.969.000,00  | JPMorgan Chase & Co MULTI Perpetual             | 1.969.000,00               | 0,25                         | 2.465.000,00       | Acadia Healthcare Co Inc 5% 15-04-2029  | 2.532.787,50               | 0,33                         |
| 2.321.000,00  | KB Home 4.8% 15-11-2029                         | 2.512.482,50               | 0,32                         | 104.000,00         | AdaptHealth LLC 4.625% 01-08-2029   | 104.000,01                 | 0,01                         |
| 1.451.000,00  | KB Home 7.5% 15-09-2022                         | 1.512.667,50               | 0,20                         | 320.000,00         | AdaptHealth LLC 5.125% 01-03-2030   | 325.600,00                 | 0,04                         |
| 1.166.000,00  | KB Home 7.625% 15-05-2023                       | 1.225.757,50               | 0,16                         | 4.598.000,00       | AdaptHealth LLC 6.125% 01-08-2028   | 4.873.880,00               | 0,63                         |
| 3.811.000,00  | Kraft Heinz Foods Co 4.875% 01-10-2049          | 4.776.850,58               | 0,62                         | 7.421.000,00       | Advanced Drainage Systems In 5% 30-09-2027  | 7.671.458,75               | 0,99                         |
| 436.000,00  | Kraft Heinz Foods Co 5% 04-06-2042              | 536.906,03                 | 0,07                         | 1.125.000,00       | Arches Buyer Inc 4.25% 01-06-2028   | 1.123.987,50               | 0,15                         |
| 280.000,00  | Kraft Heinz Foods Co 5% 15-07-2035              | 342.594,69                 | 0,04                         | 1.520.000,00       | Ashton Woods USA LLC / Ashto 4.625% 01-04-2030  | 1.502.991,20               | 0,19                         |
| 101.000,00  | Kraft Heinz Foods Co 6.875% 26-01-2039          | 147.794,57                 | 0,02                         | 925.000,00         | Ashton Woods USA LLC / Ashto 4.625% 01-08-2029  | 913.437,50                 | 0,12                         |
| 4.233.000,00  | Lloyds Banking Group P 7.500% MULTI Perp FC2024 | 4.680.047,13               | 0,60                         | 3.143.000,00       | Ashton Woods USA LLC / Ashto 6.625% 15-01-2028  | 3.315.865,00               | 0,43                         |
| 396.000,00  | Lumen Technologies Inc 5.8% 15-03-2022          | 398.970,00                 | 0,05                         |                    |   |                            |                              |
| 3.946.000,00  | Lumen Technologies Inc 7.5% 01-04-2024          | 4.320.870,00               | 0,56                         |                    |   |                            |                              |
| 1.911.000,00  | Meritage Homes Corp 5.125% 06-06-2027           | 2.106.877,52               | 0,27                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 5.063.000,00       | Atkore Inc 4.25% 01-06-2031                    | 5.189.575,00               | 0,67                         | 1.896.000,00       | Conduent Business Services L 6% 01-11-2029     | 1.874.670,00               | 0,24                         |
| 4.216.000,00       | ATS Automation Tooling Syste 4.125% 15-12-2028 | 4.267.646,00               | 0,55                         | 12.731.000,00      | Cornerstone Building Brands 6.125% 15-01-2029  | 13.653.997,50              | 1,76                         |
| 4.590.000,00       | Avaya Inc 6.125% 15-09-2028                    | 4.865.400,00               | 0,63                         | 1.366.000,00       | Coty Inc 5% 15-04-2026                         | 1.401.857,50               | 0,18                         |
| 1.475.000,00       | Avis Budget Car Rental LLC / 5.75% 15-07-2027  | 1.530.312,50               | 0,20                         | 1.071.000,00       | Coty Inc 6.5% 15-04-2026                       | 1.100.452,50               | 0,14                         |
| 180.000,00         | Bausch Health Americas Inc 9.25% 01-04-2026    | 190.125,00                 | 0,02                         | 7.331.000,00       | Covanta Holding Corp 5% 01-09-2030             | 7.471.718,55               | 0,97                         |
| 2.315.000,00       | Bausch Health Cos Inc 5% 15-02-2029            | 2.042.987,50               | 0,26                         | 3.750.000,00       | CSC Holdings LLC 4.5% 15-11-2031               | 3.703.125,00               | 0,48                         |
| 1.118.000,00       | Bausch Health Cos Inc 5.25% 30-01-2030         | 983.840,00                 | 0,13                         | 3.750.000,00       | CSC Holdings LLC 4.625% 01-12-2030             | 3.548.437,50               | 0,46                         |
| 515.000,00         | Bausch Health Cos Inc 5.5% 01-11-2025          | 520.150,00                 | 0,07                         | 1.327.000,00       | Cushman & Wakefield US Borro 6.75% 15-05-2028  | 1.429.975,20               | 0,18                         |
| 1.601.000,00       | Bausch Health Cos Inc 6.125% 15-04-2025        | 1.631.018,73               | 0,21                         | 4.865.000,00       | Dana Financing Luxembourg Sa 5.75% 15-04-2025  | 4.980.543,75               | 0,64                         |
| 1.318.000,00       | Bausch Health Cos Inc 9% 15-12-2025            | 1.377.310,00               | 0,18                         | 6.812.000,00       | Darling Ingredients Inc 5.25% 15-04-2027       | 7.024.875,27               | 0,91                         |
| 1.757.000,00       | Beazer Homes USA Inc 7.25% 15-10-2029          | 1.954.662,50               | 0,25                         | 2.249.000,00       | DaVita Inc 3.75% 15-02-2031                    | 2.187.152,50               | 0,28                         |
| 2.901.000,00       | Big River Steel LLC / BRS Fi 6.625% 31-01-2029 | 3.136.706,25               | 0,41                         | 2.592.000,00       | DaVita Inc 4.625% 01-06-2030                   | 2.653.560,00               | 0,34                         |
| 8.423.000,00       | Boise Cascade Co 4.875% 01-07-2030             | 8.886.265,08               | 1,15                         | 1.189.000,00       | Diamond Sports Group LLC / D 5.375% 15-08-2026 | 603.655,30                 | 0,08                         |
| 5.477.000,00       | Boyne USA Inc 4.75% 15-05-2029                 | 5.672.994,45               | 0,73                         | 172.000,00         | Diamond Sports Group LLC / D 6.625% 15-08-2027 | 48.160,00                  | 0,01                         |
| 860.000,00         | Builders FirstSource Inc 4.25% 01-02-2032      | 894.400,00                 | 0,12                         | 2.191.000,00       | Directv Financing LLC / Dire 5.875% 15-08-2027 | 2.248.141,28               | 0,29                         |
| 2.607.000,00       | Builders FirstSource Inc 5% 01-03-2030         | 2.796.007,50               | 0,36                         | 1.097.000,00       | DISH DBS Corp 5.25% 01-12-2026                 | 1.116.197,50               | 0,14                         |
| 2.209.000,00       | Builders FirstSource Inc 6.75% 01-06-2027      | 2.330.495,00               | 0,30                         | 1.673.000,00       | DISH DBS Corp 5.75% 01-12-2028                 | 1.685.547,50               | 0,22                         |
| 4.033.000,00       | Cascades Inc/Cascades USA In 5.125% 15-01-2026 | 4.194.320,00               | 0,54                         | 611.000,00         | DISH DBS Corp 7.375% 01-07-2028                | 618.637,50                 | 0,08                         |
| 5.582.000,00       | Cascades Inc/Cascades USA In 5.375% 15-01-2028 | 5.721.550,00               | 0,74                         | 2.482.000,00       | DISH DBS Corp 7.75% 01-07-2026                 | 2.618.510,00               | 0,34                         |
| 3.340.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.25% 01-02-2031  | 3.373.400,00               | 0,44                         | 2.010.000,00       | Enviva Partners LP / Enviva 6.5% 15-01-2026    | 2.075.325,02               | 0,27                         |
| 644.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.25% 15-01-2034  | 633.584,91                 | 0,08                         | 1.371.000,00       | First Quantum Minerals Ltd 7.25% 01-04-2023    | 1.386.766,50               | 0,18                         |
| 1.434.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.5% 01-05-2032   | 1.469.850,00               | 0,19                         | 1.894.000,00       | Frontier Communications Hold 5% 01-05-2028     | 1.941.350,00               | 0,25                         |
| 922.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.5% 01-06-2033   | 940.652,07                 | 0,12                         | 1.880.000,00       | Frontier Communications Hold 6% 15-01-2030     | 1.870.600,00               | 0,24                         |
| 182.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 4.75% 01-03-2030  | 189.280,00                 | 0,02                         | 986.000,00         | Frontier Communications Hold 6.75% 01-05-2029  | 1.020.510,00               | 0,13                         |
| 492.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 5% 01-02-2028     | 511.680,00                 | 0,07                         | 925.000,00         | FXI Holdings Inc 12.25% 15-11-2026             | 1.039.515,00               | 0,13                         |
| 100.000,00         | CCO Holdings LLC / CCO Holdi 5.5% 01-05-2026   | 102.750,00                 | 0,01                         | 276.000,00         | Gap Inc/The 3.625% 01-10-2029                  | 271.860,00                 | 0,04                         |
| 318.000,00         | Centene Corp 4.25% 15-12-2027                  | 331.515,00                 | 0,04                         | 426.000,00         | Gap Inc/The 3.875% 01-10-2031                  | 420.142,50                 | 0,05                         |
| 214.000,00         | Centene Corp 4.625% 15-12-2029                 | 229.782,50                 | 0,03                         | 3.990.000,00       | Garda World Security Corp 4.625% 15-02-2027    | 3.990.000,00               | 0,52                         |
| 2.814.000,00       | Century Communities Inc 3.875% 15-08-2029      | 2.835.105,00               | 0,37                         | 1.232.000,00       | Garda World Security Corp 6% 01-06-2029        | 1.184.062,88               | 0,15                         |
| 6.627.000,00       | Century Communities Inc 6.75% 01-06-2027       | 6.958.350,00               | 0,90                         | 211.000,00         | Gartner Inc 3.625% 15-06-2029                  | 213.331,55                 | 0,03                         |
| 1.895.000,00       | Charles River Laboratories I 3.75% 15-03-2029  | 1.913.950,00               | 0,25                         | 685.000,00         | Gartner Inc 3.75% 01-10-2030                   | 700.344,00                 | 0,09                         |
| 1.855.000,00       | Charles River Laboratories I 4% 15-03-2031     | 1.900.651,55               | 0,25                         | 1.103.000,00       | Gartner Inc 4.5% 01-07-2028                    | 1.151.956,66               | 0,15                         |
| 250.000,00         | CIT Bank NA 2.969% MULTI 27-09-2025            | 257.500,00                 | 0,03                         | 2.723.000,00       | Glatfelter Corp 4.75% 15-11-2029               | 2.808.093,75               | 0,36                         |
| 1.070.000,00       | Clarios Global LP / Clarios 6.25% 15-05-2026   | 1.119.487,50               | 0,14                         | 1.290.000,00       | Goodyear Tire & Rubber Co/Th 5% 15-07-2029     | 1.385.718,00               | 0,18                         |
| 1.531.000,00       | Clarios Global LP / Clarios 8.5% 15-05-2027    | 1.622.860,00               | 0,21                         | 3.320.000,00       | Graphic Packaging Internatio 3.5% 01-03-2029   | 3.295.100,00               | 0,43                         |
| 1.697.000,00       | Clear Channel Outdoor Holdin 7.5% 01-06-2029   | 1.820.032,50               | 0,24                         | 1.434.000,00       | Graphic Packaging Internatio 3.5% 15-03-2028   | 1.430.415,00               | 0,18                         |
| 642.000,00         | Clear Channel Outdoor Holdin 7.75% 15-04-2028  | 691.755,00                 | 0,09                         | 1.855.000,00       | Gray Escrow II Inc 5.375% 15-11-2031           | 1.905.808,45               | 0,25                         |
| 3.725.000,00       | Clear Channel Worldwide Hold 5.125% 15-08-2027 | 3.836.750,00               | 0,50                         | 7.304.000,00       | Gray Television Inc 4.75% 15-10-2030           | 7.267.480,00               | 0,94                         |
| 1.934.000,00       | Clearway Energy Operating LL 3.75% 15-02-2031  | 1.935.856,64               | 0,25                         | 3.609.000,00       | Gray Television Inc 7% 15-05-2027              | 3.857.118,75               | 0,50                         |
| 10.112.000,00      | Clearway Energy Operating LL 4.75% 15-03-2028  | 10.630.240,00              | 1,37                         | 5.428.000,00       | Greif Inc 6.5% 01-03-2027                      | 5.631.550,27               | 0,73                         |
| 4.237.000,00       | CommScope Inc 4.75% 01-09-2029                 | 4.194.630,00               | 0,54                         | 6.298.000,00       | Harsco Corp 5.75% 31-07-2027                   | 6.416.087,50               | 0,83                         |
| 3.742.000,00       | CommScope Inc 6% 01-03-2026                    | 3.854.260,00               | 0,50                         | 2.037.000,00       | Hartford Financial Services FRN 12-02-2047     | 1.940.693,27               | 0,25                         |
| 2.767.000,00       | CommScope Technologies LLC 6% 15-06-2025       | 2.767.000,00               | 0,36                         | 4.677.000,00       | HAT Holdings I LLC / HAT Hol 3.375% 15-06-2026 | 4.700.385,05               | 0,61                         |
|                    |  |                            |                              | 3.678.000,00       | HAT Holdings I LLC / HAT Hol 3.75% 15-09-2030  | 3.664.207,50               | 0,47                         |
|                    |  |                            |                              | 1.727.000,00       | HAT Holdings I LLC / HAT Hol 6% 15-04-2025     | 1.791.762,50               | 0,23                         |
|                    |  |                            |                              | 1.500.000,00       | Helios Software Holdings Inc 4.625% 01-05-2028 | 1.470.000,00               | 0,19                         |
|                    |  |                            |                              | 2.194.000,00       | Herc Holdings Inc 5.5% 15-07-2027              | 2.281.760,00               | 0,29                         |
|                    |  |                            |                              | 1.510.000,00       | Hexion Inc 7.875% 15-07-2027                   | 1.593.050,00               | 0,21                         |
|                    |  |                            |                              | 7.702.000,00       | Hilton Domestic Operating Co 4.875% 15-01-2030 | 8.231.512,50               | 1,06                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal | Marktwert<br>(Anmerkung 2)                        | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/ Beschreibung<br>Nominal | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens                      |               |      |
|---------------------------------|---|------------------------------|---------------------------------|----------------------------|---|---------------|------|
| 776.000,00                      | Hilton Domestic Operating Co<br>5.375% 01-05-2025 | 807.505,60                   | 0,10                            | 1.339.000,00               | Netflix Inc 4.875% 15-06-2030                     | 1.558.261,25  | 0,20 |
| 509.000,00                      | Hilton Domestic Operating Co<br>5.75% 01-05-2028  | 539.540,00                   | 0,07                            | 28.000,00                  | Netflix Inc 5.375% 15-11-2029                     | 33.250,00     | 0,00 |
| 5.879.000,00                    | Hilton Grand Vacations Borro<br>4.875% 01-07-2031 | 5.908.395,00                 | 0,76                            | 788.000,00                 | New Gold Inc 6.375% 15-05-2025                    | 809.670,00    | 0,10 |
| 1.550.000,00                    | Hilton Grand Vacations Borro 5%<br>01-06-2029     | 1.588.750,00                 | 0,21                            | 5.843.000,00               | New Gold Inc 7.5% 15-07-2027                      | 6.208.187,50  | 0,80 |
| 334.000,00                      | Hughes Satellite Systems Cor<br>5.25% 01-08-2026  | 365.312,50                   | 0,05                            | 4.493.000,00               | Newell Brands Inc 4.875% 01-<br>06-2025           | 4.897.370,00  | 0,63 |
| 3.359.000,00                    | Hughes Satellite Systems Cor<br>6.625% 01-08-2026 | 3.762.080,00                 | 0,49                            | 735.000,00                 | Nexstar Media Inc 4.75% 01-11-<br>2028            | 749.700,00    | 0,10 |
| 3.764.418,00                    | iHeartCommunications Inc 6.375%<br>01-05-2026     | 3.905.583,68                 | 0,50                            | 3.023.000,00               | Nexstar Media Inc 5.625% 15-<br>07-2027           | 3.174.150,00  | 0,41 |
| 4.987.724,00                    | iHeartCommunications Inc 8.375%<br>01-05-2027     | 5.262.048,82                 | 0,68                            | 3.686.000,00               | Nielsen Finance LLC / Nielse 4.5%<br>15-07-2029   | 3.626.065,64  | 0,47 |
| 1.622.000,00                    | Iliad Holding SASU 6.5% 15-10-<br>2026            | 1.704.284,06                 | 0,22                            | 6.256.000,00               | Nielsen Finance LLC / Nielse<br>5.625% 01-10-2028 | 6.443.680,00  | 0,83 |
| 4.900.000,00                    | Intesa Sanpaolo SpA 4.198%<br>MULTI 01-06-2032    | 4.946.563,77                 | 0,64                            | 1.190.000,00               | Novelis Corp 3.25% 15-11-2026                     | 1.200.412,50  | 0,16 |
| 2.024.000,00                    | Intesa Sanpaolo SpA 5.71% 15-<br>01-2026          | 2.239.758,32                 | 0,29                            | 2.326.000,00               | Novelis Corp 3.875% 15-08-2031                    | 2.311.462,50  | 0,30 |
| 2.177.000,00                    | Iron Mountain Inc 4.5% 15-02-<br>2031             | 2.200.272,13                 | 0,28                            | 2.017.000,00               | Novelis Corp 4.75% 30-01-2030                     | 2.120.371,25  | 0,27 |
| 6.173.000,00                    | Iron Mountain Inc 5.25% 15-03-<br>2028            | 6.419.920,00                 | 0,83                            | 1.459.000,00               | Ohio National Financial Serv 5.8%<br>24-01-2030   | 1.653.147,98  | 0,21 |
| 1.153.000,00                    | Iron Mountain Information Ma 5%<br>15-07-2032     | 1.181.432,98                 | 0,15                            | 1.291.000,00               | Park Intermediate Holdings L<br>5.875% 01-10-2028 | 1.350.127,80  | 0,17 |
| 1.621.000,00                    | Kraft Heinz Foods Co 3.875%<br>15-05-2027         | 1.751.850,20                 | 0,23                            | 2.912.000,00               | Park Intermediate Holdings L 7.5%<br>01-06-2025   | 3.077.168,67  | 0,40 |
| 392.000,00                      | Ladder Capital Finance Holdi<br>4.25% 01-02-2027  | 393.293,60                   | 0,05                            | 3.566.000,00               | Patrick Industries Inc 7.5% 15-<br>10-2027        | 3.797.790,00  | 0,49 |
| 1.193.000,00                    | Ladder Capital Finance Holdi<br>5.25% 01-10-2025  | 1.207.912,51                 | 0,16                            | 13.689.000,00              | Pattern Energy Operations LP<br>4.5% 15-08-2028   | 14.217.669,18 | 1,84 |
| 969.000,00                      | LCPR Senior Secured Financin<br>5.125% 15-07-2029 | 973.845,00                   | 0,13                            | 4.109.000,00               | Post Holdings Inc 4.5% 15-09-2031                 | 4.078.182,50  | 0,53 |
| 6.412.000,00                    | LCPR Senior Secured Financin<br>6.75% 15-10-2027  | 6.732.600,00                 | 0,87                            | 2.819.000,00               | Post Holdings Inc 4.625% 15-<br>04-2030           | 2.871.151,50  | 0,37 |
| 1.043.000,00                    | Lennar Corp 5% 15-06-2027                         | 1.179.467,16                 | 0,15                            | 1.905.000,00               | Post Holdings Inc 5.5% 15-12-2029                 | 1.997.868,75  | 0,26 |
| 647.000,00                      | Level 3 Financing Inc 3.625%<br>15-01-2029        | 614.650,00                   | 0,08                            | 1.992.000,00               | Rackspace Technology Global<br>3.5% 15-02-2028    | 1.882.440,00  | 0,24 |
| 1.597.000,00                    | Level 3 Financing Inc 3.75%<br>15-07-2029         | 1.517.150,00                 | 0,20                            | 1.466.000,00               | Rite Aid Corp 7.5% 01-07-2025                     | 1.507.048,04  | 0,19 |
| 3.248.000,00                    | Level 3 Financing Inc 4.25%<br>01-07-2028         | 3.215.520,00                 | 0,42                            | 2.247.000,00               | Rite Aid Corp 8% 15-11-2026                       | 2.291.940,00  | 0,30 |
| 5.288.000,00                    | Lincoln National Corp FRN 17-<br>05-2066          | 4.693.100,00                 | 0,61                            | 2.851.000,00               | Sally Holdings LLC / Sally C 8.75%<br>30-04-2025  | 3.036.315,00  | 0,39 |
| 2.421.000,00                    | Lions Gate Capital Holdings 5.5%<br>15-04-2029    | 2.469.420,00                 | 0,32                            | 8.825.000,00               | SBA Communications Corp 3.125%<br>01-02-2029      | 8.472.000,00  | 1,09 |
| 7.389.000,00                    | LPL Holdings Inc 4% 15-03-2029                    | 7.564.488,75                 | 0,98                            | 650.000,00                 | SBA Communications Corp<br>3.875% 15-02-2027      | 669.500,00    | 0,09 |
| 1.687.000,00                    | LPL Holdings Inc 4.625% 15-11-<br>2027            | 1.746.045,00                 | 0,23                            | 172.000,00                 | Scripps Escrow II Inc 3.875%<br>15-01-2029        | 170.925,00    | 0,02 |
| 1.215.000,00                    | LSF9 Atlantis Holdings LLC /<br>7.75% 15-02-2026  | 1.228.571,55                 | 0,16                            | 2.150.000,00               | Sensata Technologies BV 4%<br>15-04-2029          | 2.195.687,50  | 0,28 |
| 4.715.000,00                    | Lumen Technologies Inc 5.125%<br>15-12-2026       | 4.912.935,70                 | 0,63                            | 2.702.000,00               | Sensata Technologies BV 4.875%<br>15-10-2023      | 2.837.100,00  | 0,37 |
| 1.867.000,00                    | Lumen Technologies Inc 5.375%<br>15-06-2029       | 1.867.000,00                 | 0,24                            | 55.000,00                  | Sensata Technologies Inc 3.75%<br>15-02-2031      | 54.862,50     | 0,01 |
| 4.171.000,00                    | Madison IAQ LLC 4.125% 30-<br>06-2028             | 4.181.427,50                 | 0,54                            | 2.248.000,00               | Sensata Technologies Inc 4.375%<br>15-02-2030     | 2.360.400,00  | 0,30 |
| 1.131.000,00                    | Madison IAQ LLC 5.875% 30-<br>06-2029             | 1.130.999,88                 | 0,15                            | 1.914.000,00               | Sinclair Television Group In 5.5%<br>01-03-2030   | 1.856.580,00  | 0,24 |
| 2.599.000,00                    | Marriott Ownership Resorts I 4.5%<br>15-06-2029   | 2.615.945,48                 | 0,34                            | 987.000,00                 | Sirius XM Radio Inc 3.125% 01-<br>09-2026         | 987.286,23    | 0,13 |
| 732.000,00                      | Mattel Inc 5.45% 01-11-2041                       | 872.910,00                   | 0,11                            | 2.826.000,00               | Sirius XM Radio Inc 4.125% 01-<br>07-2030         | 2.826.000,03  | 0,37 |
| 1.794.000,00                    | Mauser Packaging Solutions H<br>5.5% 15-04-2024   | 1.810.450,98                 | 0,23                            | 1.336.000,00               | Sirius XM Radio Inc 5.5% 01-07-<br>2029           | 1.439.540,00  | 0,19 |
| 2.273.000,00                    | Meritor Inc 4.5% 15-12-2028                       | 2.278.682,50                 | 0,29                            | 415.000,00                 | Standard Industries Inc/NJ 4.375%<br>15-07-2030   | 422.781,25    | 0,05 |
| 4.009.000,00                    | Meritor Inc 6.25% 01-06-2025                      | 4.179.382,50                 | 0,54                            | 1.340.000,00               | Standard Industries Inc/NJ 5%<br>15-02-2027       | 1.373.674,20  | 0,18 |
| 1.460.000,00                    | Mineral Resources Ltd 8.125%<br>01-05-2027        | 1.574.142,80                 | 0,20                            | 2.730.000,00               | Stericycle Inc 5.375% 15-07-2024                  | 2.798.250,00  | 0,36 |
| 2.599.000,00                    | Mozart Debt Merger Sub Inc<br>3.875% 01-04-2029   | 2.586.005,00                 | 0,33                            | 3.738.000,00               | Summer BC Bidco B LLC 5.5%<br>31-10-2026          | 3.826.665,36  | 0,49 |
| 2.545.000,00                    | MSCI Inc 3.625% 01-09-2030                        | 2.602.262,50                 | 0,34                            | 8.580.000,00               | Sunnova Energy Corp 5.875%<br>01-09-2026          | 8.751.599,91  | 1,13 |
| 150.000,00                      | NCR Corp 5% 01-10-2028                            | 154.125,00                   | 0,02                            | 3.089.000,00               | Switch Ltd 3.75% 15-09-2028                       | 3.112.167,50  | 0,40 |
| 1.044.000,00                    | NCR Corp 5.125% 15-04-2029                        | 1.077.930,00                 | 0,14                            | 2.686.000,00               | Switch Ltd 4.125% 15-06-2029                      | 2.746.435,00  | 0,35 |
| 1.105.000,00                    | NCR Corp 5.25% 01-10-2030                         | 1.135.387,50                 | 0,15                            | 1.530.000,00               | Taylor Morrison Communities<br>5.875% 15-06-2027  | 1.713.600,00  | 0,22 |
| 117.000,00                      | NCR Corp 5.75% 01-09-2027                         | 121.972,50                   | 0,02                            | 808.000,00                 | Taylor Morrison Communities<br>6.625% 15-07-2027  | 852.286,50    | 0,11 |
| 2.868.000,00                    | NCR Corp 6.125% 01-09-2029                        | 3.064.867,09                 | 0,40                            | 3.666.000,00               | TEGNA Inc 4.625% 15-03-2028                       | 3.705.556,14  | 0,48 |
| 819.000,00                      | Netflix Inc 3.625% 15-06-2025                     | 863.062,20                   | 0,11                            | 306.000,00                 | TEGNA Inc 4.75% 15-03-2026                        | 318.240,00    | 0,04 |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 144.000,00         | Tenet Healthcare Corp 5.125% 01-11-2027  | 150.120,00                 | 0,02                         |
| 5.731.000,00       | Tenet Healthcare Corp 6.125% 01-10-2028  | 6.053.139,51               | 0,78                         |
| 2.850.000,00       | Travel + Leisure Co 4.5% 01-12-2029  | 2.874.182,25               | 0,37                         |
| 551.000,00         | Trident TPI Holdings Inc 9.25% 01-08-2024  | 575.795,00                 | 0,07                         |
| 2.379.000,00       | Uber Technologies Inc 4.5% 15-08-2029  | 2.420.632,50               | 0,31                         |
| 81.000,00          | Uber Technologies Inc 6.25% 15-01-2028   | 86.670,00                  | 0,01                         |
| 769.000,00         | Uber Technologies Inc 7.5% 15-09-2027  | 834.434,21                 | 0,11                         |
| 3.529.000,00       | Uber Technologies Inc 8% 01-11-2026  | 3.758.384,96               | 0,49                         |
| 3.424.000,00       | UniCredit SpA 5.459% MULTI 30-06-2035  | 3.732.738,93               | 0,48                         |
| 1.050.000,00       | UniCredit SpA 6.572% 14-01-2022  | 1.051.603,86               | 0,14                         |
| 454.000,00         | Unifrax Escrow Issuer Corp 5.25% 30-09-2028  | 458.880,50                 | 0,06                         |
| 500.000,00         | Unifrax Escrow Issuer Corp 7.5% 30-09-2029   | 505.000,00                 | 0,07                         |
| 3.168.000,00       | United Wholesale Mortgage LL 5.5% 15-11-2025   | 3.227.400,00               | 0,42                         |
| 757.000,00         | United Wholesale Mortgage LL 5.75% 15-06-2027  | 758.695,68                 | 0,10                         |
| 1.505.000,00       | Univision Communications Inc 6.625% 01-06-2027   | 1.621.509,58               | 0,21                         |
| 569.000,00         | Univision Communications Inc 9.5% 01-05-2025   | 608.118,75                 | 0,08                         |
| 3.373.000,00       | UPC Broadband Finco BV 4.875% 15-07-2031   | 3.440.460,00               | 0,44                         |
| 1.385.000,00       | UPC Holding BV 5.5% 15-01-2028   | 1.436.937,50               | 0,19                         |
| 3.052.000,00       | Vertiv Group Corp 4.125% 15-11-2028  | 3.082.520,00               | 0,40                         |
| 4.046.000,00       | Virgin Media Finance PLC 5% 15-07-2030   | 4.025.770,00               | 0,52                         |
| 5.689.000,00       | Virgin Media Secured Finance 4.5% 15-08-2030   | 5.660.555,00               | 0,73                         |
| 1.350.000,00       | Vmed O2 UK Financing I PLC 4.75% 15-07-2031  | 1.363.500,00               | 0,18                         |
| 5.263.000,00       | Wabash National Corp 4.5% 15-10-2028   | 5.315.630,00               | 0,69                         |
| 1.919.000,00       | WW International Inc 4.5% 15-04-2029   | 1.833.067,18               | 0,24                         |
| 3.868.000,00       | Zayo Group Holdings Inc 4% 01-03-2027  | 3.819.650,00               | 0,49                         |
| 1.553.000,00       | Ziggo BV 5.5% 15-01-2027   | 1.595.707,50               | 0,21                         |
|                    |  | <b>578.860.813,86</b>      | <b>74,77</b>                 |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>  | <b>578.860.813,86</b>      | <b>74,77</b>                 |
|                    | <b>Summe an einem anderen<br/>regulierten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b> | <b>578.860.813,86</b>      | <b>74,77</b>                 |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>   | <b>719.865.575,75</b>      | <b>92,98</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>  | <b>39.741.211,20</b>       | <b>5,13</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>  | <b>14.630.657,04</b>       | <b>1,89</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>   | <b>774.237.443,99</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| USA                    | 77,78        | Unternehmensanleihen | 92,98        |
| Kanada                 | 3,79         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich | 2,93         | <b>Summe</b>         | <b>92,98</b> |
| Niederlande            | 1,90         |                      |              |
| Länderübergreifend     | 1,63         |                      |              |
| Italien                | 1,55         |                      |              |
| Irland                 | 1,00         |                      |              |
| Luxemburg              | 0,81         |                      |              |
| Spanien                | 0,74         |                      |              |
| Frankreich             | 0,42         |                      |              |
| Australien             | 0,20         |                      |              |
| Kaimaninseln           | 0,19         |                      |              |
| Deutschland            | 0,03         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>92,98</b> |                      |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 322.655.914,18                                    | DKK               | 48.878.851,86      | USD                | 294.259,42   | 28.01.2022 |
| 226.047.070,15                                    | EUR               | 254.683.207,95     | USD                | 1.490.744,62   | 28.01.2022 |
| 1.640.492.001,07                                  | NOK               | 183.203.585,76     | USD                | 2.811.820,62   | 28.01.2022 |
| 1.628.161.180,92                                  | SEK               | 181.036.946,14     | USD                | (1.114.395,65)   | 28.01.2022 |
| 359.422,45  | USD               | 2.383.354,61       | DKK                | (3.803,32)   | 28.01.2022 |
| 3.126.073,92                                      | USD               | 2.769.853,48       | EUR                | (12.937,60)  | 28.01.2022 |
| 2.095.296,64                                      | USD               | 18.871.322,66      | NOK                | (44.522,36)  | 28.01.2022 |
| 1.511.806,64                                      | USD               | 13.769.294,56      | SEK                | (9.790,48)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>3.411.375,25</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.



# Nordea 1 - North American Small Cap Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land         |              | Sektor  |              |
|--------------|--------------|---|--------------|
| USA          | 85,72        | Anwendungssoftware                                  | 10,43        |
| Bermuda      | 8,86         | Sach- und Unfallversicherung                        | 4,99         |
| Israel       | 1,23         | Handelsgesellschaften und Großhändler               | 4,87         |
|              |              | Luftfracht und Logistik                             | 4,38         |
| <b>Summe</b> | <b>95,81</b> | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  | 4,36         |
|              |              | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 4,30         |
|              |              | Bau- und Ingenieurwesen                             | 4,12         |
|              |              | Branchenübergreifende Holdings                      | 3,99         |
|              |              | Lebens- und Krankenversicherung                     | 3,96         |
|              |              | Kraftfahrzeugeinzelhandel                           | 3,79         |
|              |              | Verschiedene Support-Leistungen                     | 3,78         |
|              |              | Großmärkte  | 3,69         |
|              |              | Elektrische Komponenten und Ausrüstung              | 3,49         |
|              |              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 2,84         |
|              |              | Personalwesen und Personaldienstleistungen          | 2,67         |
|              |              | Bauprodukte   | 2,53         |
|              |              | Spezialchemikalien                                  | 2,33         |
|              |              | Vermögensverwaltung und Depotbanken                 | 2,30         |
|              |              | Technologievertrieb                                 | 2,17         |
|              |              | Lebensmitteleinzelhandel                            | 1,99         |
|              |              | Öl- und Gaserschließung und Produktion              | 1,92         |
|              |              | Öl- und Gasraffinerien und -marketing               | 1,91         |
|              |              | Gasversorger  | 1,57         |
|              |              | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen           | 1,56         |
|              |              | Alternative Netzbetreiber                           | 1,54         |
|              |              | Gesundheitswesen: Vertrieb                          | 1,40         |
|              |              | Gesundheitswesen: Technologie                       | 1,37         |
|              |              | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 1,34         |
|              |              | Kommunikationsanlagen                               | 1,23         |
|              |              | Gesundheitswesen: Produkte                          | 1,05         |
|              |              | Luftfahrt und Verteidigung                          | 1,04         |
|              |              | Industriemaschinen                                  | 0,94         |
|              |              | Metall- und Glasverpackungen                        | 0,88         |
|              |              | Immobiliendienste                                   | 0,69         |
|              |              | Versicherungsmakler                                 | 0,42         |
|              |              | <b>Summe</b>  | <b>95,81</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - North American Small Cap Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 2.426.078,14                                      | EUR               | 2.733.960,88       | USD                | 15.459,69  | 28.01.2022 |
| 557.541,26  | USD               | 493.100,45         | EUR                | (1.278,67)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>14.181,02</b>   |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.





# Nordea 1 - North American Stars Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| USA                    | 92,91        | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 7,70         |
| Irland                 | 2,74         | Systemsoftware                                      | 6,62         |
| Schweiz                | 1,78         | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 6,06         |
| Vereinigtes Königreich | 1,33         | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 5,90         |
| Kaimaninseln           | 0,45         | Verschiedene Banken                                 | 5,83         |
|                        |              | Anwendungssoftware                                  | 5,10         |
| <b>Summe</b>           | <b>99,21</b> | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie    | 4,60         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 4,57         |
|                        |              | Spezialchemikalien                                  | 3,20         |
|                        |              | Biowissenschaften: Geräte und Dienstleistungen      | 3,15         |
|                        |              | Handelsgesellschaften und Großhändler               | 3,07         |
|                        |              | Sach- und Unfallversicherung                        | 2,91         |
|                        |              | Biotechnologie                                      | 2,85         |
|                        |              | Bauprodukte   | 2,51         |
|                        |              | Haushaltsprodukte                                   | 2,49         |
|                        |              | Halbleiter  | 2,21         |
|                        |              | Pharmazeutika                                       | 2,19         |
|                        |              | Börsen und Finanzdaten                              | 2,14         |
|                        |              | Forschungs- und Beratungsleistungen                 | 1,90         |
|                        |              | Autoteile und -zubehör                              | 1,84         |
|                        |              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 1,58         |
|                        |              | Stromversorger                                      | 1,44         |
|                        |              | Halbleiter-Ausrüstung                               | 1,40         |
|                        |              | Industriemaschinen                                  | 1,33         |
|                        |              | Investmentbanken und Broker                         | 1,30         |
|                        |              | Bekleidung-Einzelhandel                             | 1,29         |
|                        |              | Schuhe  | 1,29         |
|                        |              | Lebensmittelvertriebsunternehmen                    | 1,27         |
|                        |              | Verschiedene Support-Leistungen                     | 1,25         |
|                        |              | Kommunikationsanlagen                               | 1,18         |
|                        |              | Regionale Banken                                    | 1,18         |
|                        |              | Immobiliendienste                                   | 1,10         |
|                        |              | Immobilien: REITs (Gesundheitswesen)                | 1,02         |
|                        |              | Elektronische Komponenten                           | 1,00         |
|                        |              | Interaktives Home Entertainment                     | 0,88         |
|                        |              | Papierverpackungen                                  | 0,88         |
|                        |              | Konsumfinanzierungen                                | 0,86         |
|                        |              | Hersteller von Elektronikausrüstung                 | 0,80         |
|                        |              | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 0,78         |
|                        |              | Großhändler   | 0,53         |
|                        |              | <b>Summe</b>  | <b>99,21</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - North American Stars Equity Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 31.429,95   | CHF               | 33.788,10          | USD                | 700,97   | 28.01.2022 |
| 42.343.143,00                                     | EUR               | 47.742.428,79      | USD                | 244.116,74   | 28.01.2022 |
| 2.911,43  | USD               | 2.688,82           | CHF                | (39,08)  | 28.01.2022 |
| 4.112.371,24                                      | USD               | 3.643.982,47       | EUR                | (17.273,50)  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>227.505,13</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Nordea 1 - North American Value Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |
| 672.308,00  | AES   | 16.323.638,24              | 4,75                         |
| 665.948,00  | Alight  | 7.318.768,52               | 2,13                         |
| 167.449,00  | American Equity Investment Life Holding   | 6.532.185,49               | 1,90                         |
| 348.249,00  | Avaya Holdings  | 7.013.734,86               | 2,04                         |
| 363.358,00  | Axalta Coating Systems  | 11.965.378,94              | 3,48                         |
| 105.455,00  | Berkshire Hathaway  | 31.611.190,80              | 9,20                         |
| 179.631,00  | Bristol-Myers Squibb  | 11.261.067,39              | 3,28                         |
| 353.821,00  | Comcast   | 17.910.419,02              | 5,21                         |
| 113.976,00  | DR Horton   | 12.223.926,00              | 3,56                         |
| 501.918,00  | Dun & Bradstreet Holdings   | 10.234.108,02              | 2,98                         |
| 286.086,00  | Fidelity National Financial   | 15.005.210,70              | 4,37                         |
| 150.102,00  | Fiserv  | 15.654.137,58              | 4,56                         |
| 182.799,00  | Fomento Economico Mexicano ADR  | 14.168.750,49              | 4,13                         |
| 164.225,00  | Liberty Broadband   | 26.537.117,75              | 7,73                         |
| 433.677,00  | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM   | 22.139.210,85              | 6,45                         |
| 237.703,00  | LKQ   | 14.105.296,02              | 4,11                         |
| 40.611,00   | Meta Platforms  | 13.866.219,84              | 4,04                         |
| 372.738,00  | NCR   | 15.002.704,50              | 4,37                         |
| 586.770,00  | News  | 13.237.531,20              | 3,85                         |
| 227.607,00  | Premier   | 9.406.997,31               | 2,74                         |
| 106.896,00  | Progressive   | 11.016.701,76              | 3,21                         |
| 49.931,00   | QUALCOMM  | 9.156.846,09               | 2,67                         |
| 277.435,00  | Unilever ADR  | 14.856.644,25              | 4,33                         |
| 457.078,00  | Vistra  | 10.334.533,58              | 3,01                         |
| 29.470,00   | Willis Towers Watson  | 7.011.797,10               | 2,04                         |
|   |   | <b>343.894.116,30</b>      | <b>100,12</b>                |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>343.894.116,30</b>      | <b>100,12</b>                |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>343.894.116,30</b>      | <b>100,12</b>                |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>343.894.116,30</b>      | <b>100,12</b>                |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>1.190.344,90</b>        | <b>0,35</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  | <b>(1.613.632,15)</b>      | <b>(0,47)</b>                |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>343.470.829,05</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - North American Value Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   | Sektor  |
|------------------------|---|
| USA                    | Kabel und Satellitenübertragung                     |
| Vereinigtes Königreich | Branchenübergreifende Holdings                      |
| Mexiko                 | Unabhängige Energieerzeuger und -händler            |
| Bermuda                | Sach- und Unfallversicherung                        |
| Irland                 | Anwendungssoftware                                  |
|                        | Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen |
|                        | Produkte für den persönlichen Gebrauch              |
|                        | Alkoholfreie Getränke                               |
|                        | Großhändler   |
|                        | Interaktive Medien und Dienstleistungen             |
|                        | Verlage   |
|                        | Hausbau   |
|                        | Spezialchemikalien                                  |
|                        | Pharmazeutika                                       |
|                        | Forschungs- und Beratungsleistungen                 |
|                        | Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  |
|                        | Halbleiter  |
|                        | Personalwesen und Personaldienstleistungen          |
|                        | Versicherungsmakler                                 |
|                        | Lebens- und Krankenversicherung                     |
| <b>Summe</b>           | <b>Summe</b>  |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - North American Value Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 8.612.077,14                                      | EUR               | 9.705.566,49       | USD                | 54.309,51  | 28.01.2022 |
| 1.074.615,57                                      | USD               | 950.174,88         | EUR                | (2.196,62)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>52.112,89</b>   |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.



# Nordea 1 - Norwegian Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in NOK) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b> |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |
| <b>NOK</b>  |   |                            |                              |
| 7.000.000,00  | Jotun A/S 18/24 FRN   | 7.063.468,30               | 0,14                         |
| 20.000.000,00   | Jotun A/S 21/28 FRN FLOOR   | 19.916.910,00              | 0,40                         |
|   |   | <b>26.980.378,30</b>       | <b>0,55</b>                  |
|   | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>26.980.378,30</b>       | <b>0,55</b>                  |
|   | <b>Summe sonstige übertragbare<br/>Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b> | <b>26.980.378,30</b>       | <b>0,55</b>                  |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>4.907.947.274,75</b>    | <b>99,66</b>                 |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>57.413.932,41</b>       | <b>1,17</b>                  |
|   | <b>Sonstige<br/>Nettoverbindlichkeiten</b>                                      | <b>(40.784.126,54)</b>     | <b>(0,83)</b>                |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>4.924.577.080,62</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Norwegian Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| <b>Land</b>  |              | <b>Sektor</b>        |              |
|--------------|--------------|----------------------|--------------|
| Norwegen     | 91,08        | Unternehmensanleihen | 73,48        |
| Dänemark     | 3,49         | Staatsanleihen       | 25,13        |
| Schweden     | 2,63         | Hypothekenanleihen   | 1,04         |
| Finnland     | 2,47         |                      |              |
| <b>Summe</b> | <b>99,66</b> | <b>Summe</b>         | <b>99,66</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.



# Nordea 1 - Norwegian Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Zinsswaps

| Beschreibung                                     | Nominal          | Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) in der Basiswährung<br>des Teilfonds (NOK) | Fälligkeit |
|--|------------------|---------|--|------------|
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>               |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.9354%                     | 250.000.000,00   | NOK     | 1.315.221,81   | 18.11.2024 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>1.315.221,81</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Deutsche Bank AG</b>             |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 0.7770%                     | 150.000.000,00   | NOK     | (6.501.151,95)   | 14.04.2026 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>(6.501.151,95)</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.8680%                     | 300.000.000,00   | NOK     | 1.286.034,19   | 28.08.2024 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 0.7550%                     | 300.000.000,00   | NOK     | (20.267.046,23)  | 06.05.2028 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>(18.981.012,04)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>                 |                  |         |  |            |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              | (200.000.000,00) | NOK     | 353.074,38   | 05.04.2022 |
| Receiving fixed rate 1.4750%                     |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.8900%                     | 135.000.000,00   | NOK     | 12.829,13  | 09.01.2028 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 2.0275%                     | 100.000.000,00   | NOK     | 852.330,26   | 23.10.2023 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.6850%                     | 250.000.000,00   | NOK     | (95.248,13)  | 26.11.2024 |
| Paying floating rate OIBOR 3 months              |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>1.122.985,64</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b>              |                  |         |  |            |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              | (200.000.000,00) | NOK     | 3.893.048,34   | 29.10.2024 |
| Receiving fixed rate 2.4400%                     |                  |         |  |            |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              | (300.000.000,00) | NOK     | (1.422.207,38)   | 10.05.2024 |
| Receiving fixed rate 1.4700%                     |                  |         |  |            |
| Paying fixed rate 1.7650%                        | (200.000.000,00) | NOK     | (332.442,07)   | 29.07.2024 |
| Receiving floating rate OIBOR 6 months           |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.4250%                     | 80.000.000,00    | NOK     | (1.501.017,28)   | 19.08.2026 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.6550%                     | 150.000.000,00   | NOK     | (1.536.229,43)   | 26.02.2027 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 0.7160%                     | 300.000.000,00   | NOK     | (17.604.687,72)  | 06.05.2027 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 1.6775%                     | 100.000.000,00   | NOK     | (782.280,52)   | 01.10.2026 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>(19.285.816,06)</b>   |            |
| <b>Gegenpartei: Societe Generale SA</b>          |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 2.0950%                     | 60.000.000,00    | NOK     | 716.213,71   | 26.01.2028 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
| Receiving fixed rate 2.1125%                     | 180.000.000,00   | NOK     | 2.051.787,63   | 09.04.2026 |
| Paying floating rate OIBOR 6 months              |                  |         |  |            |
|  |                  |         | <b>2.768.001,34</b>  |            |
|  |                  |         | <b>(39.561.771,26)</b>   |            |

BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Zinsswaps 150.000,00 EUR gezahlt.  
 Deutsche Bank AG hat als Sicherheit für Zinsswaps 530.000,00 EUR erhalten.  
 Goldman Sachs International hat als Sicherheit für Zinsswaps 1.480.000,00 EUR erhalten.  
 J.P. Morgan SE hat als Sicherheit für Zinsswaps 660.000,00 EUR gezahlt.  
 Nordea Bank Abp hat als Sicherheit für Zinsswaps 1.280.000,00 EUR erhalten.  
 Société Générale hat als Sicherheit für Zinsswaps 640.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Norwegian Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in NOK)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|---|--------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 160.000,00  | ABN AMRO Bank   | 20.632.589,99              | 1,96                         |   |              |                            |                              |
| 30.000,00   | Koninklijke Ahold Delhaize  | 9.026.059,24               | 0,86                         |   |              |                            |                              |
| 8.454,00  | NN Group  | 4.018.520,18               | 0,38                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>33.677.169,41</b>       | <b>3,20</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>NOK</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 97.800,00   | Agilyx  | 3.515.910,00               | 0,33                         |   |              |                            |                              |
| 218.345,00  | Aker BP   | 59.302.502,00              | 5,64                         |   |              |                            |                              |
| 445.171,00  | Aker Clean Hydrogen AS  | 2.546.378,12               | 0,24                         |   |              |                            |                              |
| 28.830,00   | Aker  | 23.784.750,00              | 2,26                         |   |              |                            |                              |
| 300.153,00  | AKVA Group  | 26.473.494,60              | 2,52                         |   |              |                            |                              |
| 32.985,00   | Andfjord Salmon AS  | 1.391.967,00               | 0,13                         |   |              |                            |                              |
| 83.849,00   | Arctic Fish Holding   | 7.462.561,00               | 0,71                         |   |              |                            |                              |
| 419.066,00  | Atea  | 68.726.824,00              | 6,54                         |   |              |                            |                              |
| 250.646,00  | Austevoll Seafood   | 26.668.734,40              | 2,54                         |   |              |                            |                              |
| 426.414,00  | Axactor SE  | 3.219.425,70               | 0,31                         |   |              |                            |                              |
| 430.541,00  | BerGenBio   | 8.731.371,48               | 0,83                         |   |              |                            |                              |
| 204.574,00  | Borregaard  | 45.415.428,00              | 4,32                         |   |              |                            |                              |
| 558.620,00  | Bouvet  | 42.175.810,00              | 4,01                         |   |              |                            |                              |
| 302.302,00  | Cadeler A/S   | 11.027.976,96              | 1,05                         |   |              |                            |                              |
| 116.637,00  | DNB Bank  | 23.560.674,00              | 2,24                         |   |              |                            |                              |
| 113.821,00  | Edda Wind   | 3.858.531,90               | 0,37                         |   |              |                            |                              |
| 94.947,00   | Elektro Importoren  | 7.941.367,08               | 0,76                         |   |              |                            |                              |
| 677.657,00  | Elkem   | 20.207.731,74              | 1,92                         |   |              |                            |                              |
| 134.758,00  | Equinor   | 31.789.412,20              | 3,02                         |   |              |                            |                              |
| 90.226,00   | Europris  | 6.360.933,00               | 0,60                         |   |              |                            |                              |
| 124.290,00  | Fjordkraft Holding  | 5.923.661,40               | 0,56                         |   |              |                            |                              |
| 2.130,00  | Gjensidige Forsikring   | 455.820,00                 | 0,04                         |   |              |                            |                              |
| 102.778,00  | Goodtech  | 960.974,30                 | 0,09                         |   |              |                            |                              |
| 13.520,00   | Grieg Seafood   | 1.123.512,00               | 0,11                         |   |              |                            |                              |
| 153.000,00  | Havila Kystruten AS   | 3.519.000,00               | 0,33                         |   |              |                            |                              |
| 133.292,00  | Hexagon Composites  | 4.363.980,08               | 0,42                         |   |              |                            |                              |
| 50.000,00   | Integrated Wind Solutions AS  | 1.708.500,00               | 0,16                         |   |              |                            |                              |
| 484.928,00  | Kalera  | 5.741.547,52               | 0,55                         |   |              |                            |                              |
| 218.302,00  | Kid   | 24.580.805,20              | 2,34                         |   |              |                            |                              |
| 172.753,00  | Kitron  | 4.076.970,80               | 0,39                         |   |              |                            |                              |
| 129.500,00  | Klaveness Combination Carri   | 6.216.000,00               | 0,59                         |   |              |                            |                              |
| 1.387.045,00  | Kongsberg Automotive  | 4.202.746,35               | 0,40                         |   |              |                            |                              |
| 296.915,00  | Lerøy Seafood Group   | 20.475.258,40              | 1,95                         |   |              |                            |                              |
| 721.649,00  | Mintra Holding  | 2.760.307,43               | 0,26                         |   |              |                            |                              |
| 139.437,00  | Mowi  | 29.100.501,90              | 2,77                         |   |              |                            |                              |
| 60.843,00   | Nordic Aqua Partners  | 3.985.216,50               | 0,38                         |   |              |                            |                              |
| 195.814,00  | Nordic Nanovector   | 4.511.554,56               | 0,43                         |   |              |                            |                              |
| 351.043,00  | Norsk Hydro   | 24.404.509,36              | 2,32                         |   |              |                            |                              |
| 189.292,00  | Norske Skog   | 7.268.812,80               | 0,69                         |   |              |                            |                              |
| 1.392.000,00  | Norwegian Air Shuttle   | 14.964.000,00              | 1,42                         |   |              |                            |                              |
| 308.832,00  | NRC Group   | 7.427.409,60               | 0,71                         |   |              |                            |                              |
| 188.558,00  | Olav Thon Eiendomsselskap   | 36.881.944,80              | 3,51                         |   |              |                            |                              |
| 75.000,00   | Orkla   | 6.627.000,00               | 0,63                         |   |              |                            |                              |
| 35.823,00   | poLight   | 6.677.407,20               | 0,64                         |   |              |                            |                              |
| 97.405,00   | Protector Forsikring  | 10.558.702,00              | 1,00                         |   |              |                            |                              |
| 113.527,00  | Quantafuel AS   | 3.666.922,10               | 0,35                         |   |              |                            |                              |
| 62.783,00   | SallMar   | 38.172.064,00              | 3,63                         |   |              |                            |                              |
| 198.600,00  | SATS  | 4.190.460,00               | 0,40                         |   |              |                            |                              |
| 263.659,00  | Sbanken   | 24.704.848,30              | 2,35                         |   |              |                            |                              |
| 25.000,00   | Schibsted ser. B  | 7.425.000,00               | 0,71                         |   |              |                            |                              |
| 128.000,00  | SEAWAY 7  | 2.096.640,00               | 0,20                         |   |              |                            |                              |
| 40.421,00   | Sikri Holding   | 4.365.468,00               | 0,42                         |   |              |                            |                              |
| 94.715,00   | SpareBank 1 Helgeland   | 12.407.665,00              | 1,18                         |   |              |                            |                              |
| 379.944,00  | SpareBank 1 SMN   | 56.611.656,00              | 5,38                         |   |              |                            |                              |
| 241.201,00  | SpareBank 1 SR-Bank   | 32.127.973,20              | 3,06                         |   |              |                            |                              |
| 119.385,00  | SpareBank 1 Sørøst-Norge  | 7.807.779,00               | 0,74                         |   |              |                            |                              |
| 185.315,00  | Sparebanken Vest  | 18.568.563,00              | 1,77                         |   |              |                            |                              |
| 130.895,00  | Storebrand  | 11.586.825,40              | 1,10                         |   |              |                            |                              |
| 302.241,00  | Subsea 7 S.A.   | 19.095.586,38              | 1,82                         |   |              |                            |                              |
| 820.000,00  | Targovax  | 1.812.200,00               | 0,17                         |   |              |                            |                              |
| 516.499,00  | Treasure  | 9.245.332,10               | 0,88                         |   |              |                            |                              |
| 84.960,00   | Ultimovacs  | 9.583.488,00               | 0,91                         |   |              |                            |                              |
| 93.526,00   | Webstep   | 3.142.473,60               | 0,30                         |   |              |                            |                              |
| 8.724,00  | Wilh. Wilhelmsen Holding ser. A   | 1.805.868,00               | 0,17                         |   |              |                            |                              |
| 46.337,00   | Wilh. Wilhelmsen Holding ser. B   | 9.267.400,00               | 0,88                         |   |              |                            |                              |
| 112.483,00  | Yara International  | 50.054.935,00              | 4,76                         |   |              |                            |                              |
| 205.533,00  | Zalaris   | 11.098.782,00              | 1,06                         |   |              |                            |                              |
| 73.502,00   | Zaptec AS/Norway  | 4.428.495,50               | 0,42                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>1.005.944.349,96</b>    | <b>95,67</b>                 |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>SEK</b>  |              |                            |                              |
| 6.344,00  | Karnov Group  | 413.946,50                 | 0,04                         |   |              |                            |                              |
| 80.063,00   | Nordic Paper  | 2.962.932,05               | 0,28                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>3.376.878,55</b>        | <b>0,32</b>                  |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>1.042.998.397,92</b>    | <b>99,20</b>                 |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |              |                            |                              |
|   |   | <b>1.042.998.397,92</b>    | <b>99,20</b>                 |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |              |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| <b>CAD</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 20.000,00   | Stage Holdco  |                            | 0,00                         |   |              | 0,00                       | 0,00                         |
|   |   |                            |                              |   |              | <b>0,00</b>                | <b>0,00</b>                  |
| <b>NOK</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 665.730,00  | ZEG Power AS  | 3.914.492,40               | 0,37                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>3.914.492,40</b>        | <b>0,37</b>                  |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>3.914.492,40</b>        | <b>0,37</b>                  |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>3.914.492,40</b>        | <b>0,37</b>                  |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>1.046.912.890,32</b>    | <b>99,57</b>                 |   |              |                            |                              |
| <b>Bankguthaben</b>   |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>9.118.013,34</b>        | <b>0,87</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>Sonstige Nettverbindlichkeiten</b>   |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>(4.578.557,11)</b>      | <b>(0,44)</b>                |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>1.051.452.346,55</b>    | <b>100,00</b>                |   |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Norwegian Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land        |       | Sektor  |              |
|-------------|-------|---|--------------|
| Norwegen    | 92,80 | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch               | 12,84        |
| Niederlande | 3,20  | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen         | 10,85        |
| Luxemburg   | 1,82  | Regionale Banken                                  | 10,36        |
| Dänemark    | 1,43  | Verschiedene Banken                               | 8,32         |
| Schweden    | 0,32  | Spezialchemikalien                                | 6,24         |
|             |       | Öl- und Gaserschließung und Produktion            | 5,64         |
|             |       | Dünger und Chemikalien für die Landwirtschaft     | 4,76         |
|             |       | Immobilien: REOC                                  | 3,51         |
|             |       | Integrierte Öl- und Gasunternehmen                | 3,02         |
|             |       | Landwirtschafts- und Landmaschinen                | 2,52         |
|             |       | Biotechnologie                                    | 2,34         |
|             |       | Einzelhandel: Möbel und Einrichtung               | 2,34         |
|             |       | Aluminium   | 2,32         |
|             |       | Branchenübergreifende Holdings                    | 2,26         |
|             |       | Schifffahrt                                       | 2,21         |
|             |       | Bau- und Ingenieurwesen                           | 1,92         |
|             |       | Öl- und Gasanlagen und -dienstleistungen          | 1,82         |
|             |       | Lebens- und Krankenversicherung                   | 1,48         |
|             |       | Fluggesellschaften                                | 1,42         |
|             |       | Personalwesen und Personaldienstleistungen        | 1,06         |
|             |       | Mehrspartenversicherungen                         | 1,05         |
|             |       | Papierprodukte                                    | 0,97         |
|             |       | Luftfracht und Logistik                           | 0,88         |
|             |       | Lebensmitteleinzelhandel                          | 0,86         |
|             |       | Einzelhandel: Heimwerker und Garten               | 0,76         |
|             |       | Verlage   | 0,71         |
|             |       | Anwendungssoftware                                | 0,68         |
|             |       | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen         | 0,68         |
|             |       | Elektronische Komponenten                         | 0,64         |
|             |       | Warenhäuser                                       | 0,60         |
|             |       | Stromversorger                                    | 0,56         |
|             |       | Landwirtschaftliche Produkte                      | 0,55         |
|             |       | Industriemaschinen                                | 0,51         |
|             |       | Elektrische Komponenten und Ausrüstung            | 0,42         |
|             |       | Autoteile und -zubehör                            | 0,40         |
|             |       | Freizeiteinrichtungen                             | 0,40         |
|             |       | Dienste für die Herstellung elektronischer Geräte | 0,39         |
|             |       | Sonstige  | 0,37         |
|             |       | Hotels, Ferienanlagen und Kreuzfahrtlinien        | 0,33         |
|             |       | Konsumfinanzierungen                              | 0,31         |
|             |       | Industriegase                                     | 0,24         |
|             |       | Interaktive Medien und Dienstleistungen           | 0,04         |
|             |       | <b>Summe</b>                                      | <b>99,57</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.





# Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund

**Aufgliederung der Wertpapieranlagen  
nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021  
(in % des Nettovermögens)**

| Land         |              | Sektor               |              |
|--------------|--------------|----------------------|--------------|
| Norwegen     | 79,31        | Unternehmensanleihen | 96,17        |
| Dänemark     | 9,71         | Hypothekenanleihen   | 2,30         |
| Schweden     | 7,45         | Staatsanleihen       | 0,90         |
| Finnland     | 1,95         |                      |              |
| Niederlande  | 0,94         |                      |              |
| <b>Summe</b> | <b>99,36</b> | <b>Summe</b>         | <b>99,36</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|---|--------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| <b>Aktien</b>   |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| <b>BRL</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 2.419.940,00  | Banco Bradesco  | 8.345.969,01               | 1,80                         |   |              |                            |                              |
| 651.500,00  | CPFL Energia  | 3.138.194,79               | 0,68                         |   |              |                            |                              |
| 816.000,00  | Engie Brasil Energia  | 5.627.030,52               | 1,22                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>17.111.194,32</b>       | <b>3,70</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>CLP</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 10.970.405,00   | Aguas Andinas   | 1.996.680,18               | 0,43                         |   |              |                            |                              |
| 15.998.623,00   | Banco de Chile  | 1.250.403,17               | 0,27                         |   |              |                            |                              |
| 28.285,00   | Banco de Credito e Inversiones                                | 826.675,81                 | 0,18                         |   |              |                            |                              |
| 75.058.704,00   | Enel Chile  | 2.626.464,13               | 0,57                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>6.700.223,29</b>        | <b>1,45</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>EUR</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 88.944,00   | Prosus  | 7.407.590,26               | 1,60                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>7.407.590,26</b>        | <b>1,60</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>HKD</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 1.355.000,00  | Beijing Enterprises Holdings                                  | 4.673.492,20               | 1,01                         |   |              |                            |                              |
| 8.000,00  | Beijing Jingneng Clean Energy                                 | 2.595,14                   | 0,00                         |   |              |                            |                              |
| 2.331.750,00  | China Communications Construction                             | 1.267.645,41               | 0,27                         |   |              |                            |                              |
| 12.449.701,00   | China Communications Services                                 | 6.065.861,15               | 1,31                         |   |              |                            |                              |
| 11.096.000,00   | China Construction Bank                                       | 7.682.634,19               | 1,66                         |   |              |                            |                              |
| 7.801.177,00  | China Everbright Environment Group                            | 6.261.586,89               | 1,35                         |   |              |                            |                              |
| 2.615.400,00  | China Gas Holdings  | 5.432.541,85               | 1,17                         |   |              |                            |                              |
| 5.398.000,00  | China Longyuan Power Group                                    | 12.596.625,41              | 2,72                         |   |              |                            |                              |
| 1.840.500,00  | China Mobile  | 11.044.132,84              | 2,39                         |   |              |                            |                              |
| 4.903.500,00  | China Overseas Land & Investment                              | 11.606.140,48              | 2,51                         |   |              |                            |                              |
| 4.135.500,00  | China Railway Construction                                    | 2.704.258,15               | 0,58                         |   |              |                            |                              |
| 12.881.000,00   | China Railway Group   | 6.804.508,22               | 1,47                         |   |              |                            |                              |
| 918.000,00  | China Resources Land  | 3.860.703,70               | 0,83                         |   |              |                            |                              |
| 16.520.000,00   | China Telecom   | 5.507.231,56               | 1,19                         |   |              |                            |                              |
| 10.111.000,00   | CRRC  | 4.342.990,35               | 0,94                         |   |              |                            |                              |
| 3.400.000,00  | Fu Shou Yuan International Group                              | 2.672.325,39               | 0,58                         |   |              |                            |                              |
| 1.159.000,00  | Hengan International Group                                    | 5.966.490,21               | 1,29                         |   |              |                            |                              |
| 12.618.500,00   | Industrial & Commercial Bank of China                         | 7.118.858,41               | 1,54                         |   |              |                            |                              |
| 2.018.000,00  | Jiangsu Expressway  | 2.067.368,47               | 0,45                         |   |              |                            |                              |
| 1.772.500,00  | Ping An Insurance Group Co of China                           | 12.761.036,51              | 2,76                         |   |              |                            |                              |
| 2.413.200,00  | Shanghai Pharmaceuticals Holding                              | 4.573.173,70               | 0,99                         |   |              |                            |                              |
| 4.824.400,00  | Sinopharm Group   | 10.491.053,54              | 2,27                         |   |              |                            |                              |
| 1.866.000,00  | Yuexiu Transport Infrastructure                               | 1.105.359,53               | 0,24                         |   |              |                            |                              |
| 2.778.000,00  | Zhejiang Expressway   | 2.475.523,15               | 0,53                         |   |              |                            |                              |
| 69,00   | Zhuzhou CRRC Times Electric                                   | 399,44                     | 0,00                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>139.084.535,89</b>      | <b>30,05</b>                 |   |              |                            |                              |
| <b>IDR</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 12.714.793,00   | Indofood Sukses Makmur  | 5.642.593,63               | 1,22                         |   |              |                            |                              |
| 52.186.000,00   | Telkom Indonesia Persero                                      | 14.792.593,58              | 3,20                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>20.435.187,21</b>       | <b>4,41</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>INR</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 754.245,00  | HCL Technologies  | 13.384.218,47              | 2,89                         |   |              |                            |                              |
| 2.092.647,00  | NHPC  | 871.283,49                 | 0,19                         |   |              |                            |                              |
| 4.037.293,00  | Power Grid Corp of India                                      | 11.101.304,54              | 2,40                         |   |              |                            |                              |
| 525.672,00  | Sun TV Network  | 3.536.507,28               | 0,76                         |   |              |                            |                              |
| 940.225,00  | UPL   | 9.449.599,18               | 2,04                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>38.342.912,96</b>       | <b>8,28</b>                  |   |              |                            |                              |
| <b>KRW</b>  |   |                            |                              |   |              |                            |                              |
| 350.486,00  | BNK Financial Group   | 2.476.621,00               | 0,54                         |   |              |                            |                              |
| 274.487,00  | Cheil Worldwide   | 5.276.155,35               | 1,14                         |   |              |                            |                              |
| 93.480,00   | Coway   | 5.850.611,07               | 1,26                         |   |              |                            |                              |
| 118.775,00  | DB Insurance  | 5.395.458,90               | 1,17                         |   |              |                            |                              |
| 74.440,00   | Hyundai Glovis  | 10.520.230,02              | 2,27                         |   |              |                            |                              |
| 200.105,00  | Hyundai Greenfood   | 1.442.608,05               | 0,31                         |   |              |                            |                              |
| 48.090,00   | Hyundai Mobis   | 10.295.611,66              | 2,22                         |   |              |                            |                              |
| 66.179,00   | LG  | 4.503.791,86               | 0,97                         |   |              |                            |                              |
| 25.495,00   | LX Holdings   | 214.469,04                 | 0,05                         |   |              |                            |                              |
| 278.925,00  | Samsung Electronics   | 18.372.099,69              | 3,97                         |   |              |                            |                              |
| 69.886,00   | Samsung Fire & Marine Insurance                               | 11.875.479,19              | 2,57                         |   |              |                            |                              |
| 191.855,00  | SK Square   | 10.716.446,27              | 2,32                         |   |              |                            |                              |
| 179.384,00  | SK Telecom  | 8.737.191,55               | 1,89                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>95.676.773,65</b>       | <b>20,67</b>                 |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>MXN</b>  |              |                            |                              |
|   | 667.600,00 Arca Continental                                   | 4.244.593,09               | 0,92                         |   |              |                            |                              |
|   | 235.820,00 Coca-Cola Femsa                                    | 1.284.308,81               | 0,28                         |   |              |                            |                              |
|   | 192.900,00 Fomento Economico Mexicano                         | 1.491.809,07               | 0,32                         |   |              |                            |                              |
|   | 502.668,00 Grupo Financiero Banorte                           | 3.290.874,59               | 0,71                         |   |              |                            |                              |
|   | 982.700,00 Kimberly-Clark de Mexico                           | 1.499.864,98               | 0,32                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>11.811.450,54</b>       | <b>2,55</b>                  |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>PHP</b>  |              |                            |                              |
| 12.827.700,00   | Megaworld   | 792.415,65                 | 0,17                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>792.415,65</b>          | <b>0,17</b>                  |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>SGD</b>  |              |                            |                              |
| 14.641.000,00   | Thai Beverage   | 7.159.943,64               | 1,55                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>7.159.943,64</b>        | <b>1,55</b>                  |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>THB</b>  |              |                            |                              |
|   | 492.900,00 Advanced Info Service                              | 3.393.713,70               | 0,73                         |   |              |                            |                              |
|   | 237.200,00 Bangkok Bank                                       | 862.739,16                 | 0,19                         |   |              |                            |                              |
|   | 1.308.200,00 Bangkok Bank                                     | 4.758.159,22               | 1,03                         |   |              |                            |                              |
|   | 5.451.900,00 Thai Union Group                                 | 3.182.519,26               | 0,69                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>12.197.131,34</b>       | <b>2,64</b>                  |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>TRY</b>  |              |                            |                              |
| 13.674.734,00   | Akbank TAS  | 7.287.228,88               | 1,57                         |   |              |                            |                              |
|   | 766.068,00 BIM Birtelik Magazalar                             | 3.501.602,19               | 0,76                         |   |              |                            |                              |
|   | 3.023.350,00 Turkcell Iletisim Hizmetleri                     | 4.028.961,18               | 0,87                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>14.817.792,25</b>       | <b>3,20</b>                  |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>TWD</b>  |              |                            |                              |
|   | 629.000,00 Chicony Electronics                                | 1.871.062,85               | 0,40                         |   |              |                            |                              |
|   | 812.000,00 Taiwan Semiconductor Manufacturing                 | 18.049.660,63              | 3,90                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>19.920.723,48</b>       | <b>4,30</b>                  |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>USD</b>  |              |                            |                              |
|   | 51.742,00 Alibaba Group Holding ADR                           | 6.260.782,00               | 1,35                         |   |              |                            |                              |
|   | 38.380,00 Baidu ADR   | 5.753.162,00               | 1,24                         |   |              |                            |                              |
|   | 780.329,00 Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo AD | 5.751.024,73               | 1,24                         |   |              |                            |                              |
|   | 100.050,22 SK Telecom ADR                                     | 2.688.349,34               | 0,58                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>20.453.318,07</b>       | <b>4,42</b>                  |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>ZAR</b>  |              |                            |                              |
|   | 476.886,00 AVI  | 2.209.521,97               | 0,48                         |   |              |                            |                              |
|   | 263.345,00 FirstRand  | 1.003.848,03               | 0,22                         |   |              |                            |                              |
|   | 22.703,00 Naspers   | 3.518.609,15               | 0,76                         |   |              |                            |                              |
|   | 2.291.355,00 Netcare  | 2.281.298,90               | 0,49                         |   |              |                            |                              |
|   | 958.720,00 Sanlam   | 3.568.001,20               | 0,77                         |   |              |                            |                              |
|   | 611.723,00 SPAR Group   | 6.409.476,35               | 1,38                         |   |              |                            |                              |
|   | 419.168,00 Vodacom Group                                      | 3.537.830,48               | 0,76                         |   |              |                            |                              |
|   |   | <b>22.528.586,08</b>       | <b>4,87</b>                  |   |              |                            |                              |
|   | <b>Summe Aktien</b>   | <b>434.439.778,63</b>      | <b>93,86</b>                 |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |              |                            |                              |
|   |   | <b>434.439.778,63</b>      | <b>93,86</b>                 |   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>Aktien</b>   |              |                            |                              |
|   |   |                            |                              | <b>CNY</b>  |              |                            |                              |
|   | 1.612.819,00 Chengdu Xingrong Environment                     | 1.599.318,42               | 0,35                         |   |              |                            |                              |
|   | 1.155.915,00 China Resources Double Crane Pharmaceutical      | 2.424.876,01               | 0,52                         |   |              |                            |                              |
|   | 2.500.357,00 China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical  | 13.432.845,16              | 2,90                         |   |              |                            |                              |
|   | 139.149,00 Ping An Insurance Group Co of China                | 1.100.598,76               | 0,24                         |   |              |                            |                              |
|   | 1.142.200,00 Shandong Hi-speed                                | 924.749,46                 | 0,20                         |   |              |                            |                              |
|   | 1.159.900,00 Shanghai Tunnel Engineering                      | 979.118,05                 | 0,21                         |   |              |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 1.094.926,00       | Shenzhen Fuanna Bedding and Furnishing  | 1.467.151,19               | 0,32                         |
| 410.600,00         | Shenzhen Overseas Chinese Town  | 453.548,60                 | 0,10                         |
| 645.485,00         | Zhejiang Hangmin  | 563.109,92                 | 0,12                         |
|                    |   | <b>22.945.315,57</b>       | <b>4,96</b>                  |
|                    | <b>Summe Aktien</b>   | <b>22.945.315,57</b>       | <b>4,96</b>                  |
|                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>22.945.315,57</b>       | <b>4,96</b>                  |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>457.385.094,20</b>      | <b>98,82</b>                 |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>3.693.150,84</b>        | <b>0,80</b>                  |
|                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>1.783.231,30</b>        | <b>0,39</b>                  |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>462.861.476,34</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor  |              |
|------------------------|--------------|---|--------------|
| China                  | 23,64        | Verschiedene Banken                                 | 8,95         |
| Republik Korea         | 21,25        | Drahtlose Telekommunikationsdienste                 | 7,22         |
| Indien                 | 8,28         | Halbleiter  | 6,21         |
| Hongkong               | 7,26         | Integrierte Telekommunikationsdienste               | 4,39         |
| Kaimaninseln           | 5,30         | Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie    | 4,37         |
| Brasilien              | 4,94         | Erneuerbare Elektrizität                            | 4,13         |
| Südafrika              | 4,87         | Bau- und Ingenieurwesen                             | 3,85         |
| Indonesien             | 4,41         | Lebens- und Krankenversicherung                     | 3,77         |
| Taiwan, Provinz Chinas | 4,30         | Sach- und Unfallversicherung                        | 3,73         |
| Thailand               | 4,18         | Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 3,71         |
| Türkei                 | 3,20         | Stromversorger                                      | 3,64         |
| Mexiko                 | 2,55         | Immobilienentwicklung                               | 3,51         |
| Niederlande            | 1,60         | Pharmazeutika                                       | 3,43         |
| Chile                  | 1,45         | Gesundheitswesen: Vertrieb                          | 3,25         |
| Bermuda                | 1,41         | IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen           | 2,89         |
| Philippinen            | 0,17         | Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 2,38         |
|                        |              | Luftfracht und Logistik                             | 2,27         |
|                        |              | Autoteile und -zubehör                              | 2,22         |
|                        |              | Gasversorger  | 2,18         |
|                        |              | Dünger und Chemikalien für die Landwirtschaft       | 2,04         |
|                        |              | Wasserversorger                                     | 2,02         |
|                        |              | Lebensmittelvertriebsunternehmen                    | 1,70         |
|                        |              | Brennereien und Winzereien                          | 1,55         |
|                        |              | Alkoholfreie Getränke                               | 1,52         |
|                        |              | Straßen- und Schienennetze                          | 1,42         |
|                        |              | Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 1,35         |
|                        |              | Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 1,29         |
|                        |              | Haushaltsgeräte                                     | 1,26         |
|                        |              | Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 1,24         |
|                        |              | Werbung   | 1,14         |
|                        |              | Industriekonglomerate                               | 1,02         |
|                        |              | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 0,94         |
|                        |              | Rundfunk  | 0,76         |
|                        |              | Lebensmitteleinzelhandel                            | 0,76         |
|                        |              | Spezialisierte Verbraucherdienste                   | 0,58         |
|                        |              | Regionale Banken                                    | 0,54         |
|                        |              | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 0,49         |
|                        |              | Textilien   | 0,44         |
|                        |              | Haushaltsprodukte                                   | 0,32         |
|                        |              | Sonstige verschiedene Finanzdienstleistungen        | 0,22         |
|                        |              | Freizeiteinrichtungen                               | 0,10         |
|                        |              | <b>Summe</b>  | <b>98,82</b> |
| <b>Summe</b>           | <b>98,82</b> |   |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Stable Return Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>CHF</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 11.580.000,00   | Commerzbank Finance & Covere 2.5% 29-08-2025       | 12.192.608,41              | 0,16                         | 91.367,06          | Realkredit Danmark 3% 07-01-2046 SDRO S           | 13.404,71                  | 0,00                         |
| 11.130.000,00   | Commerzbank Finance & Covere 2.75% 09-02-2022      | 10.806.677,74              | 0,14                         | 6.836.303,21       | Realkredit Danmark 3% 10-01-2044 SDRO S           | 1.001.363,96               | 0,01                         |
| 14.950.000,00   | Kommunalkredit Austria AG 2.5% 14-02-2022          | 14.522.778,22              | 0,19                         | 5.516.390,31       | Realkredit Danmark 3.5% 04-01-2044 SDRO S         | 838.255,67                 | 0,01                         |
| 12.960.000,00   | Kommunalkredit Austria AG 3.375% 22-06-2026        | 14.490.299,72              | 0,19                         | 2.841.682,42       | Realkredit Danmark 4% 01-01-2038 RO               | 434.584,82                 | 0,01                         |
|   |  | <b>52.012.364,09</b>       | <b>0,68</b>                  | 35.660,59          | Realkredit Danmark 5% 01-01-2038 IO RO            | 5.649,07                   | 0,00                         |
| <b>DKK</b>  |  |                            |                              | <b>EUR</b>         |   |                            |                              |
| 105.000.000,00  | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2022 SDO A E         | 14.173.757,83              | 0,18                         | 1.000.000,00       | Aegon Bank NV 0.375% 09-06-2036                   | 978.854,00                 | 0,01                         |
| 50.000.000,00   | Jyske Realkredit A/S 1% 04-01-2026 SDO A E         | 6.996.653,54               | 0,09                         | 1.600.000,00       | Argenta Spaarbank NV 0.01% 11-02-2031             | 1.564.822,40               | 0,02                         |
| 56.570.588,23   | Jyske Realkredit A/S 1% 10-01-2053 SDO E           | 7.169.933,45               | 0,09                         | 1.800.000,00       | Bausparkasse Schwabebisch Hal 0.01% 22-10-2030    | 1.767.960,00               | 0,02                         |
| 88.497.606,36   | Jyske Realkredit A/S 1.5% 10-01-2053 SDO E         | 11.662.742,06              | 0,15                         | 9.000.000,00       | BPCE SFH SA 2.036% 17-04-2023                     | 9.282.506,94               | 0,12                         |
| 7.194.141,61  | Jyske Realkredit A/S 2% 10-01-2047 SDO E           | 1.003.472,55               | 0,01                         | 11.000.000,00      | Bundesrepublik Deutschland B 0.000000% 15-11-2027 | 11.273.160,80              | 0,15                         |
| 1.732.077,25  | Jyske Realkredit A/S 2.5% 04-01-2047 SDO E         | 249.284,67                 | 0,00                         | 10.000,00          | Bundesrepublik Deutschland B 1.5% 15-02-2023      | 10.252,20                  | 0,00                         |
| 83.041.329,13   | Nordea Kredit 1% 10-01-2050 SDRO 2                 | 10.664.505,78              | 0,14                         | 10.000,00          | Bundesrepublik Deutschland B 1.75% 15-02-2024     | 10.520,00                  | 0,00                         |
| 224.612.447,04  | Nordea Kredit 1% 10-01-2053 SDRO 2                 | 28.475.635,90              | 0,37                         | 5.100.000,00       | Caisse Francaise de Financem 0.01% 18-03-2031     | 4.976.620,80               | 0,06                         |
| 130.292.390,12  | Nordea Kredit 2% 10-01-2047 SDRO 2                 | 18.182.553,07              | 0,24                         | 1.900.000,00       | Canadian Imperial Bank of Co 0.01% 30-04-2029     | 1.873.966,20               | 0,02                         |
| 37.792.451,16   | Nordea Kredit 2.5% 04-01-2047 SDRO 2               | 5.435.367,59               | 0,07                         | 42.600.000,00      | Cie de Financement Foncier S 1.2% 29-04-2031      | 46.172.947,20              | 0,60                         |
| 2.268.218,09  | Nordea Kredit 2.5% 07-01-2036 SDRO 2               | 325.761,03                 | 0,00                         | 300.000,00         | Coventry Building Society 0.01% 07-07-2028        | 295.957,80                 | 0,00                         |
| 23.083,34   | Nordea Kredit 5% 01-01-2035 RO 1                   | 3.701,69                   | 0,00                         | 2.000.000,00       | DBS Bank Ltd 0.375% 23-01-2024                    | 2.025.392,00               | 0,03                         |
| 6.382,99  | Nordea Kredit 6% 04-01-2039 IO SDRO 2              | 1.028,10                   | 0,00                         | 5.000.000,00       | Deutsche Bank AG 0.05% 20-11-2024                 | 5.005.550,00               | 0,07                         |
| 137.986.777,01  | Nordea Kredit FRN 07-01-2022 IO CIBOR 6M SDRO A 2  | 18.585.711,59              | 0,24                         | 3.500.000,00       | DNB Boligkredit AS 0.01% 21-01-2031               | 3.421.985,00               | 0,04                         |
| 44.716.055,45   | Nordea Kredit FRN 07-01-2023 IO CITA-6M SDRO A 2   | 6.054.463,21               | 0,08                         | 3.000.000,00       | Korea Housing Finance Corp 0.01% 05-02-2025       | 3.000.822,00               | 0,04                         |
| 685.794.147,63  | Nykredit Realkredit 1% 10-01-2050 SDO E            | 87.888.033,28              | 1,14                         | 4.500.000,00       | LHV Pank AS 0.1% 09-06-2025                       | 4.513.635,00               | 0,06                         |
| 1.007.449.317,30  | Nykredit Realkredit 1% 10-01-2053 SDO E            | 127.653.410,96             | 1,66                         | 3.900.000,00       | Lloyds Bank PLC 0.125% 23-09-2029                 | 3.862.638,00               | 0,05                         |
| 394.463.863,69  | Nykredit Realkredit 1.5% 10-01-2053 SDO E          | 51.971.537,77              | 0,68                         | 10.000.000,00      | Natixis Pfandbriefbank AG 0.175% 14-09-2026       | 10.072.315,40              | 0,13                         |
| 15.972.655,50   | Nykredit Realkredit 2% 10-01-2050 SDO E            | 2.211.831,28               | 0,03                         | 9.400.000,00       | PKO Bank Hipoteczny SA 0.125% 24-06-2022          | 9.409.005,20               | 0,12                         |
| 42.808.450,18   | Nykredit Realkredit 2.5% 07-01-2047 SDO E          | 6.156.776,17               | 0,08                         | 10.300.000,00      | PKO Bank Hipoteczny SA 0.625% 24-01-2023          | 10.394.966,00              | 0,14                         |
| 2.419.562,07  | Nykredit Realkredit 2.5% 10-01-2036 SDO E          | 347.659,71                 | 0,00                         | 2.000.000,00       | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 01-10-2026         | 1.990.184,00               | 0,03                         |
| 58.341.938,25   | Nykredit Realkredit 3% 07-01-2046 SDO E            | 8.559.505,49               | 0,11                         | 1.200.000,00       | Prima Banka Slovensko AS 0.01% 14-09-2027         | 1.190.314,22               | 0,02                         |
| 6.019.505,49  | Nykredit Realkredit 3% 10-01-2044 SDO E            | 882.126,29                 | 0,01                         | 1.300.000,00       | Royal Bank of Canada 0.01% 05-10-2028             | 1.286.485,20               | 0,02                         |
| 11.946.259,71   | Nykredit Realkredit 3.5% 04-01-2044 SDO E          | 1.814.919,53               | 0,02                         | 3.000.000,00       | Santander Consumer Bank AG 0.05% 14-02-2030       | 2.965.608,00               | 0,04                         |
| 764.978,63  | Nykredit Realkredit 3.5% 07-01-2044 IO SDO E       | 116.115,48                 | 0,00                         | 1.700.000,00       | SR-Boligkredit AS 0.01% 10-03-2031                | 1.656.439,20               | 0,02                         |
| 1.208.782,71  | Nykredit Realkredit 4% 01-01-2044 IO SDO E         | 184.699,28                 | 0,00                         | 2.000.000,00       | Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.409% 07-11-2029    | 2.007.836,00               | 0,03                         |
| 12.965,84   | Nykredit Realkredit 5% 07-01-2028 RO D             | 1.918,38                   | 0,00                         | 1.800.000,00       | UniCredit Bank AG 0.01% 10-03-2031                | 1.762.372,80               | 0,02                         |
| 6.396,49  | Nykredit Realkredit 6% 07-01-2038 IO RO D          | 1.042,74                   | 0,00                         | 1.100.000,00       | UniCredit Bank AG 0.01% 21-05-2029                | 1.089.913,00               | 0,01                         |
| 423.586,63  | Nykredit Realkredit CF 5% 07-01-2038 CIBOR 6M RO D | 60.402,52                  | 0,00                         | 3.000.000,00       | Westpac Banking Corp 0.01% 22-09-2028             | 2.961.480,00               | 0,04                         |
| 682.899,74  | Nykredit Realkredit CF 6% 04-01-2038 IO CIBOR 6M R | 97.312,04                  | 0,00                         | 2.000.000,00       | Westpac Securities NZ Ltd/Lo 0.01% 08-06-2028     | 1.973.340,00               | 0,03                         |
| 91.071.831,05   | Nykredit Realkredit FRN 07-01-2022 IO CITA-6M SDO  | 12.271.911,02              | 0,16                         |                    |   | <b>148.797.849,36</b>      | <b>1,94</b>                  |
| 245.000.000,00  | Realkredit Danmark 1% 01-01-2025 SDRO A T          | 34.085.004,22              | 0,44                         | <b>NOK</b>         |   |                            |                              |
| 250.000.000,00  | Realkredit Danmark 1% 04-01-2023 SDRO A T          | 34.254.088,61              | 0,45                         | 50.000.000,00      | Spb 1 Boligkredit AS 18/24 ADJ C COVD             | 5.093.141,50               | 0,07                         |
| 139.942.677,85  | Realkredit Danmark 1.5% 10-01-2053 SDRO S          | 18.433.070,80              | 0,24                         |                    |   | <b>5.093.141,50</b>        | <b>0,07</b>                  |
|   |  |                            |                              | <b>USD</b>         |   |                            |                              |
|   |  |                            |                              | 33.527.000,00      | United States Treasury Note/ 0.625% 15-05-2030    | 27.664.899,76              | 0,36                         |
|   |  |                            |                              | 29.160.000,00      | United States Treasury Note/ 0.625% 15-08-2030    | 23.998.100,51              | 0,31                         |
|   |  |                            |                              | 30.634.000,00      | United States Treasury Note/ 0.875% 15-11-2030    | 25.706.669,95              | 0,33                         |
|   |  |                            |                              | 27.859.000,00      | United States Treasury Note/ 1.25% 15-08-2031     | 24.042.883,97              | 0,31                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Stable Return Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 33.415.700,00      | United States Treasury Note/<br>1.625% 15-05-2031      | 29.861.787,73              | 0,39                         |                    | <b>IDR</b>  |                            |                              |
| 21.671.400,00      | United States Treasury Note/<br>1.75% 15-11-2029       | 19.602.725,07              | 0,26                         | 78.713.240,00      | Telkom Indonesia Persero                              | 19.700.192,28              | 0,26                         |
| 23.800.800,00      | United States Treasury Note/<br>2.25% 15-02-2027       | 22.018.077,76              | 0,29                         |                    | <b>INR</b>  |                            |                              |
| 30.781.900,00      | United States Treasury Note/<br>2.25% 15-08-2027       | 28.511.313,60              | 0,37                         | 346.536,00         | Axis Bank   | 2.792.783,92               | 0,04                         |
| 53.678.400,00      | United States Treasury Note/<br>2.375% 15-05-2029      | 50.513.067,76              | 0,66                         | 1.201.336,00       | HCL Technologies                                      | 18.821.287,73              | 0,24                         |
| 7.987.800,00       | United States Treasury Note/<br>2.625% 15-02-2029      | 7.625.862,23               | 0,10                         | 1.229.106,00       | Infosys   | 27.557.571,30              | 0,36                         |
| 78.733.800,00      | United States Treasury Note/<br>2.75% 15-02-2028       | 75.144.544,65              | 0,98                         | 4.954.630,00       | Power Grid Corp of India                              | 12.028.161,25              | 0,16                         |
| 15.777.400,00      | United States Treasury Note/<br>2.875% 15-05-2028      | 15.179.492,21              | 0,20                         | 1.436.126,00       | UPL   | 12.743.197,19              | 0,17                         |
| 36.405.700,00      | United States Treasury Note/<br>3.125% 15-11-2028      | 35.729.159,89              | 0,46                         |                    | <b>JPY</b>  |                            |                              |
|                    |  | <b>385.598.585,09</b>      | <b>5,02</b>                  | 256.900,00         | Hoya  | 33.706.289,26              | 0,44                         |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>                                  | <b>1.109.771.135,90</b>    | <b>14,44</b>                 | 2.079.700,00       | KDDI  | 53.616.101,24              | 0,70                         |
|                    | <b>Aktien</b>  |                            |                              | 2.491.600,00       | Nippon Telegraph & Telephone                          | 60.184.645,34              | 0,78                         |
|                    | <b>BRL</b>   |                            |                              | 473.100,00         | Seven & i Holdings                                    | 18.342.428,84              | 0,24                         |
| 1.208.691,00       | Banco Bradesco   | 3.680.372,10               | 0,05                         |                    | <b>KRW</b>  |                            |                              |
|                    |  | <b>3.680.372,10</b>        | <b>0,05</b>                  | 130.813,00         | BNK Financial Group                                   | 816.100,45                 | 0,01                         |
|                    | <b>CAD</b>   |                            |                              | 69.395,00          | Hyundai Glovis  | 8.658.663,97               | 0,11                         |
| 917.396,00         | Bank of Nova Scotia/The                                | 57.199.179,32              | 0,74                         | 43.050,00          | Hyundai Mobis   | 8.137.188,31               | 0,11                         |
| 665.500,00         | Royal Bank of Canada                                   | 62.011.637,07              | 0,81                         | 36.927,00          | LG  | 2.218.737,75               | 0,03                         |
|                    |  | <b>119.210.816,39</b>      | <b>1,55</b>                  | 17.907,00          | LX Holdings   | 132.995,29                 | 0,00                         |
|                    | <b>CHF</b>   |                            |                              | 474.065,00         | Samsung Electronics                                   | 27.568.496,31              | 0,36                         |
| 240.343,00         | Nestle   | 29.653.126,04              | 0,39                         | 78.686,00          | Samsung Fire & Marine Insurance                       | 11.804.898,62              | 0,15                         |
| 79.690,00          | Roche Holding  | 29.247.641,73              | 0,38                         | 309.958,00         | SK Square   | 15.285.665,56              | 0,20                         |
| 17.933,00          | Sonova Holding   | 6.211.929,63               | 0,08                         | 306.053,00         | SK Telecom  | 13.160.992,10              | 0,17                         |
|                    |  | <b>65.112.697,40</b>       | <b>0,85</b>                  |                    | <b>MXN</b>  |                            |                              |
| 1.422.626,00       | Novo Nordisk B   | 140.611.600,49             | 1,83                         | 474.200,00         | Grupo Financiero Banorte                              | 2.740.917,22               | 0,04                         |
|                    |  | <b>140.611.600,49</b>      | <b>1,83</b>                  |                    | <b>PHP</b>  |                            |                              |
|                    | <b>EUR</b>   |                            |                              | 37.605,00          | PLDT  | 1.179.781,82               | 0,02                         |
| 175.659,00         | Allianz  | 36.475.591,35              | 0,47                         |                    | <b>THB</b>  |                            |                              |
| 698.747,00         | Deutsche Post  | 39.507.155,38              | 0,51                         | 788.200,00         | Advanced Info Service                                 | 4.791.340,03               | 0,06                         |
| 1.020.556,00       | Iberdrola  | 10.623.987,96              | 0,14                         | 1.295.400,00       | Bangkok Bank  | 4.159.804,28               | 0,05                         |
| 185.223,00         | Muenchener Rueckversicherungs-<br>Gesellschaft AG in M | 48.250.591,50              | 0,63                         | 3.790.700,00       | Thai Union Group                                      | 1.953.649,96               | 0,03                         |
| 182.161,00         | Prosus   | 13.394.298,33              | 0,17                         |                    | <b>TRY</b>  |                            |                              |
| 630.161,00         | Sanofi   | 55.819.661,38              | 0,73                         | 8.669.021,00       | Akbank TAS  | 4.078.663,24               | 0,05                         |
| 341.607,00         | Siemens  | 52.156.556,76              | 0,68                         | 380.738,00         | BIM Birlesik Magazalar                                | 1.536.490,85               | 0,02                         |
| 751.513,00         | Unilever   | 35.362.444,22              | 0,46                         | 4.997.526,00       | Turkcell Iletisim Hizmetleri                          | 5.879.819,44               | 0,08                         |
| 911.327,00         | Vinci  | 84.671.391,57              | 1,10                         |                    | <b>TWD</b>  |                            |                              |
|                    |  | <b>376.261.678,45</b>      | <b>4,90</b>                  | 1.501.000,00       | Taiwan Semiconductor<br>Manufacturing                 | 29.457.642,77              | 0,38                         |
| 2.916.596,00       | National Grid  | 36.795.185,51              | 0,48                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 343.416,00         | Reckitt Benckiser Group                                | 25.926.122,51              | 0,34                         | 284.608,00         | Accenture   | 103.756.973,01             | 1,35                         |
| 1.726.328,00       | Rightmove  | 16.337.336,30              | 0,21                         | 912.448,00         | Akamai Technologies                                   | 94.318.114,12              | 1,23                         |
| 520.260,00         | Unilever   | 24.437.220,87              | 0,32                         | 142.292,00         | Alibaba Group Holding ADR                             | 15.200.928,81              | 0,20                         |
|                    |  | <b>103.495.865,19</b>      | <b>1,35</b>                  | 80.177,00          | Alphabet  | 206.179.440,11             | 2,68                         |
| 4.748.000,00       | China Communications<br>Construction                   | 2.278.928,93               | 0,03                         | 394.514,00         | Amgen   | 78.916.732,51              | 1,03                         |
| 20.795.780,00      | China Construction Bank                                | 12.712.272,36              | 0,17                         | 300.030,00         | Anthem  | 123.699.297,71             | 1,61                         |
| 6.603.367,00       | China Everbright Environment<br>Group                  | 4.679.441,08               | 0,06                         | 363.884,00         | Apple   | 57.147.120,46              | 0,74                         |
| 2.514.000,00       | China Gas Holdings                                     | 4.610.356,44               | 0,06                         | 521.397,00         | Archer-Daniels-Midland                                | 30.888.393,36              | 0,40                         |
| 1.411.000,00       | China Longyuan Power Group                             | 2.907.050,77               | 0,04                         | 409.671,00         | Automatic Data Processing                             | 88.784.655,88              | 1,16                         |
| 2.596.566,00       | China Mobile   | 13.756.230,18              | 0,18                         | 76.533,00          | AutoZone  | 140.794.638,18             | 1,83                         |
| 5.238.000,00       | China Overseas Land &<br>Investment                    | 10.945.898,22              | 0,14                         | 53.993,00          | Baidu ADR   | 7.145.676,70               | 0,09                         |
| 2.467.500,00       | China Railway Construction                             | 1.424.562,65               | 0,02                         | 2.478.947,00       | Bristol-Myers Squibb                                  | 137.204.950,86             | 1,79                         |
| 1.858.000,00       | China Resources Land                                   | 6.898.803,39               | 0,09                         | 365.312,00         | Cadence Design Systems                                | 59.880.656,86              | 0,78                         |
| 18.764.000,00      | China Telecom  | 5.522.719,52               | 0,07                         | 451.936,00         | Cerner  | 37.107.710,28              | 0,48                         |
| 4.872.000,00       | CRRC   | 1.847.592,97               | 0,02                         | 526.176,00         | Check Point Software<br>Technologies                  | 54.231.921,87              | 0,71                         |
| 1.084.000,00       | Hengan International Group                             | 4.926.846,67               | 0,06                         | 191.394,00         | Chubb   | 32.719.392,80              | 0,43                         |
| 24.771.000,00      | Industrial & Commercial Bank<br>of China               | 12.338.160,93              | 0,16                         | 560.443,00         | Cia de Saneamento Basico do<br>Estado de Sao Paulo AD | 3.646.726,63               | 0,05                         |
| 2.878.500,00       | Ping An Insurance Group Co of<br>China                 | 18.296.592,23              | 0,24                         | 728.050,00         | Cigna   | 148.669.654,95             | 1,93                         |
| 5.197.600,00       | Sinopharm Group  | 9.978.905,65               | 0,13                         | 2.726.287,00       | Cisco Systems   | 152.772.203,31             | 1,99                         |
| 1.352.000,00       | Techtronic Industries                                  | 23.753.227,24              | 0,31                         | 122.828,00         | Citrix Systems  | 10.383.420,31              | 0,14                         |
| 184.200,00         | Tencent Holdings                                       | 9.525.108,60               | 0,12                         | 4.306.678,00       | Coca-Cola   | 223.176.149,28             | 2,90                         |
|                    |  | <b>146.402.697,83</b>      | <b>1,90</b>                  | 974.705,00         | Cognizant Technology Solutions                        | 76.434.289,67              | 0,99                         |
|                    |  |                            |                              | 601.248,00         | Colgate-Palmolive                                     | 44.961.555,34              | 0,58                         |
|                    |  |                            |                              | 2.909.711,00       | Comcast   | 130.039.792,50             | 1,69                         |
|                    |  |                            |                              | 1.025.064,00       | CVS Health  | 93.506.036,81              | 1,22                         |
|                    |  |                            |                              | 146.981,00         | Dollar General  | 30.596.548,11              | 0,40                         |
|                    |  |                            |                              | 2.086.699,00       | eBay  | 121.998.152,94             | 1,59                         |
|                    |  |                            |                              | 85.465,00          | Estee Lauder Cos                                      | 27.789.612,75              | 0,36                         |
|                    |  |                            |                              | 443.958,00         | Expeditors International of<br>Washington             | 52.064.575,29              | 0,68                         |
|                    |  |                            |                              | 129.404,00         | F5  | 28.051.528,85              | 0,36                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Stable Return Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in EUR) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 891.456,00         | Fiserv  | 82.081.796,09              | 1,07                         |                    |   |                            |                              |
| 270.497,00         | Global Payments   | 32.732.369,98              | 0,43                         |                    |   |                            |                              |
| 177.147,00         | Hershey   | 29.903.771,19              | 0,39                         |                    |   |                            |                              |
| 886.894,00         | Infosys ADR   | 19.951.493,53              | 0,26                         |                    |   |                            |                              |
| 16.614,00          | Intuit  | 9.398.244,90               | 0,12                         |                    |   |                            |                              |
| 1.438.921,00       | Johnson & Johnson   | 218.610.802,93             | 2,84                         |                    |   |                            |                              |
| 447.868,00         | Kellogg   | 25.282.902,88              | 0,33                         |                    |   |                            |                              |
| 224.477,00         | Kimberly-Clark  | 28.130.724,77              | 0,37                         |                    |   |                            |                              |
| 102.900,00         | Kyndryl Holdings  | 1.688.880,94               | 0,02                         |                    |   |                            |                              |
| 15.302,00          | Lowe's Cos  | 3.466.778,11               | 0,05                         |                    |   |                            |                              |
| 213.150,00         | Marsh & McLennan Cos  | 32.624.097,51              | 0,42                         |                    |   |                            |                              |
| 259.600,00         | Mastercard  | 82.886.808,90              | 1,08                         |                    |   |                            |                              |
| 283.776,00         | McDonald's  | 66.982.310,23              | 0,87                         |                    |   |                            |                              |
| 1.260.756,00       | Medtronic   | 116.230.204,97             | 1,51                         |                    |   |                            |                              |
| 638.509,00         | Merck   | 43.559.431,85              | 0,57                         |                    |   |                            |                              |
| 409.453,00         | Microsoft   | 121.962.877,58             | 1,59                         |                    |   |                            |                              |
| 1.669.698,00       | Mondelez International  | 96.991.815,68              | 1,26                         |                    |   |                            |                              |
| 857.068,00         | Monster Beverage  | 72.241.453,27              | 0,94                         |                    |   |                            |                              |
| 723.114,00         | NIKE  | 106.476.804,88             | 1,39                         |                    |   |                            |                              |
| 470.021,00         | Oracle  | 36.401.573,45              | 0,47                         |                    |   |                            |                              |
| 117.591,00         | Organon   | 3.186.216,21               | 0,04                         |                    |   |                            |                              |
| 168.679,00         | Paychex   | 20.279.008,92              | 0,26                         |                    |   |                            |                              |
| 969.929,00         | PepsiCo   | 147.452.500,50             | 1,92                         |                    |   |                            |                              |
| 1.534.278,00       | Pfizer  | 80.354.364,59              | 1,05                         |                    |   |                            |                              |
| 485.573,00         | Procter & Gamble  | 69.698.899,42              | 0,91                         |                    |   |                            |                              |
| 1.474.608,00       | Public Service Enterprise Group   | 86.264.535,54              | 1,12                         |                    |   |                            |                              |
| 379.227,00         | Ross Stores   | 38.162.092,00              | 0,50                         |                    |   |                            |                              |
| 94.027,00          | SK Telecom ADR  | 2.230.614,56               | 0,03                         |                    |   |                            |                              |
| 716.601,00         | Starbucks   | 73.789.056,39              | 0,96                         |                    |   |                            |                              |
| 155.958,00         | State Street  | 12.808.204,81              | 0,17                         |                    |   |                            |                              |
| 114.025,00         | Stryker   | 27.189.221,77              | 0,35                         |                    |   |                            |                              |
| 63.883,00          | Target  | 12.970.056,68              | 0,17                         |                    |   |                            |                              |
| 660.826,00         | Texas Roadhouse   | 53.086.617,93              | 0,69                         |                    |   |                            |                              |
| 730.329,00         | TJX Cos   | 48.746.631,76              | 0,63                         |                    |   |                            |                              |
| 489.028,00         | Toro  | 42.877.650,41              | 0,56                         |                    |   |                            |                              |
| 77.373,00          | UnitedHealth Group  | 34.450.163,49              | 0,45                         |                    |   |                            |                              |
| 1.511.651,00       | Verizon Communications  | 69.706.910,18              | 0,91                         |                    |   |                            |                              |
| 404.135,00         | Visa  | 77.448.058,26              | 1,01                         |                    |   |                            |                              |
| 554.912,00         | VMware  | 57.394.553,37              | 0,75                         |                    |   |                            |                              |
| 355.300,00         | Walmart   | 44.841.862,05              | 0,58                         |                    |   |                            |                              |
| 216.930,00         | Waste Management  | 31.754.729,21              | 0,41                         |                    |   |                            |                              |
| 67.668,00          | WW Grainger   | 30.828.026,94              | 0,40                         |                    |   |                            |                              |
| 600.079,00         | Xilinx  | 112.391.965,03             | 1,46                         |                    |   |                            |                              |
| 310.742,00         | Zimmer Biomet Holdings  | 35.116.740,43              | 0,46                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>4.852.700.674,35</b>    | <b>63,13</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>ZAR</b>  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 420.887,00         | Absa Group  | 3.554.031,88               | 0,05                         |                    |   |                            |                              |
| 146.328,00         | FirstRand   | 492.464,14                 | 0,01                         |                    |   |                            |                              |
| 45.050,00          | Naspers   | 6.164.343,87               | 0,08                         |                    |   |                            |                              |
| 1.360.033,00       | Netcare   | 1.195.483,37               | 0,02                         |                    |   |                            |                              |
| 983.393,00         | Sanlam  | 3.231.205,66               | 0,04                         |                    |   |                            |                              |
| 496.740,00         | Standard Bank Group   | 3.849.743,41               | 0,05                         |                    |   |                            |                              |
| 35.313,00          | Vodacom Group   | 263.140,56                 | 0,00                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>18.750.412,89</b>       | <b>0,24</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Aktien</b>   | <b>6.229.281.321,41</b>    | <b>81,04</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b>   | <b>7.339.052.457,31</b>    | <b>95,48</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Aktien</b>   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>CNY</b>  |                            |                              |
| 1.155.664,00       | China Resources Double Crane Pharmaceutical   | 2.140.422,43               | 0,03                         |                    |   |                            |                              |
| 2.826.089,00       | China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical   | 13.404.668,93              | 0,17                         |                    |   |                            |                              |
| 815.500,00         | Shenzhen Overseas Chinese Town  | 795.303,93                 | 0,01                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   | <b>16.340.395,29</b>       | <b>0,21</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Aktien</b>   | <b>16.340.395,29</b>       | <b>0,21</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>16.340.395,29</b>       | <b>0,21</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>7.355.392.852,60</b>    | <b>95,69</b>                 |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>353.857.435,52</b>      | <b>4,60</b>                  |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Sonstige Nettverbindlichkeiten</b>   | <b>(22.825.574,10)</b>     | <b>(0,30)</b>                |                    |   |                            |                              |
|                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>7.686.424.714,02</b>    | <b>100,00</b>                |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Stable Return Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land  |              |   |              |
|---|--------------|---|--------------|
| USA   | 63,53        | Landwirtschaftliche Produkte                        | 0,40         |
| Dänemark  | 8,57         | Handelsgesellschaften und Großhändler               | 0,40         |
| Irland  | 2,86         | Industriemaschinen                                  | 0,31         |
| Deutschland   | 2,74         | Stromversorger                                      | 0,29         |
| Frankreich  | 2,61         | Lebens- und Krankenversicherung                     | 0,28         |
| Japan   | 2,18         | Lebensmitteleinzelhandel                            | 0,26         |
| Vereinigtes Königreich                              | 1,86         | Immobilienentwicklung                               | 0,23         |
| Kanada  | 1,59         | Vermögensverwaltung und Depotbanken                 | 0,17         |
| Schweiz   | 1,27         | Dünger und Chemikalien für die Landwirtschaft       | 0,17         |
| Indien  | 1,22         | Gesundheitswesen: Vertrieb                          | 0,13         |
| Republik Korea                                      | 1,21         | Autoteile und -zubehör                              | 0,11         |
| China   | 1,09         | Gasversorger  | 0,06         |
| Israel  | 0,71         | Einzelhandel: Heimwerker und Garten                 | 0,05         |
| Hongkong  | 0,69         | Wasserversorger                                     | 0,05         |
| Kaimaninseln  | 0,57         | Erneuerbare Elektrizität                            | 0,04         |
| Österreich  | 0,38         | Baumaschinen, landwirtschaftliche Maschinen und LKW | 0,02         |
| Taiwan, Provinz Chinas                              | 0,38         | Gesundheitswesen: Einrichtungen                     | 0,02         |
| Luxemburg   | 0,30         | Freizeiteinrichtungen                               | 0,01         |
| Indonesien  | 0,26         | Sonstige verschiedene Finanzdienstleistungen        | 0,01         |
| Polen   | 0,26         | Regionale Banken                                    | 0,01         |
| Südafrika   | 0,24         |   |              |
| Niederlande   | 0,19         |   |              |
| Türkei  | 0,15         |   |              |
| Spanien   | 0,14         |   |              |
| Thailand  | 0,14         |   |              |
| Norwegen  | 0,13         |   |              |
| Brasilien   | 0,10         |   |              |
| Bermuda   | 0,06         |   |              |
| Estland   | 0,06         |   |              |
| Australien  | 0,04         |   |              |
| Mexiko  | 0,04         |   |              |
| Slowakei  | 0,04         |   |              |
| Neuseeland  | 0,03         |   |              |
| Singapur  | 0,03         |   |              |
| Belgien   | 0,02         |   |              |
| Philippinen   | 0,02         |   |              |
| <b>Summe</b>  | <b>95,69</b> | <b>Summe</b>  | <b>95,69</b> |
| <b>Sektor</b>                                       |              |   |              |
| Pharmazeutika                                       | 9,42         |   |              |
| Alkoholfreie Getränke                               | 5,76         |   |              |
| Staatsanleihen                                      | 5,20         |   |              |
| Kündbare Hypothekendarlehen                         | 5,10         |   |              |
| Datenverarbeitung und ausgelagerte Dienstleistungen | 5,00         |   |              |
| Systemsoftware                                      | 3,51         |   |              |
| IT-Beratung und sonstige Dienstleistungen           | 3,23         |   |              |
| Gesundheitswesen: Dienstleistungen                  | 3,15         |   |              |
| Interaktive Medien und Dienstleistungen             | 3,11         |   |              |
| Hypothekendarlehen                                  | 2,86         |   |              |
| Restaurants   | 2,52         |   |              |
| Gesundheitswesen: Ausstattung                       | 2,40         |   |              |
| Abgepackte Lebensmittel und Fleisch                 | 2,39         |   |              |
| Kommunikationsanlagen                               | 2,35         |   |              |
| Verschiedene Banken                                 | 2,20         |   |              |
| Haushaltsprodukte                                   | 2,20         |   |              |
| Gesundheitswesen: Managed Health Care               | 2,06         |   |              |
| Internet und Direktmarketing (Privatkunden)         | 2,04         |   |              |
| Halbleiter  | 2,04         |   |              |
| Integrierte Telekommunikationsdienste               | 2,02         |   |              |
| Kraftfahrzeugeinzelhandel                           | 1,83         |   |              |
| Kabel und Satellitenübertragung                     | 1,69         |   |              |
| Mehrpartei-Versorger                                | 1,60         |   |              |
| Schuhe  | 1,39         |   |              |
| Luftfracht und Logistik                             | 1,30         |   |              |
| Unternehmensanleihen                                | 1,28         |   |              |
| Internet-Dienste und -Infrastruktur                 | 1,23         |   |              |
| Drahtlose Telekommunikationsdienste                 | 1,23         |   |              |
| Produkte für den persönlichen Gebrauch              | 1,20         |   |              |
| Bau- und Ingenieurwesen                             | 1,15         |   |              |
| Bekleidung-Einzelhandel                             | 1,13         |   |              |
| Hardware Technologie, Speicherung und Peripherie    | 1,10         |   |              |
| Anwendungssoftware                                  | 1,04         |   |              |
| Biotechnologie                                      | 1,03         |   |              |
| Industriekonglomerate                               | 0,71         |   |              |
| Rückversicherungen                                  | 0,63         |   |              |
| Großmärkte  | 0,58         |   |              |
| Sach- und Unfallversicherung                        | 0,58         |   |              |
| Warenhäuser   | 0,57         |   |              |
| Landwirtschafts- und Landmaschinen                  | 0,56         |   |              |
| Gesundheitswesen: Technologie                       | 0,48         |   |              |
| Umweltschutz- und Gebäudedienstleistungen           | 0,47         |   |              |
| Mehrparteiversicherungen                            | 0,47         |   |              |
| Gesundheitswesen: Produkte                          | 0,44         |   |              |
| Versicherungsmakler                                 | 0,42         |   |              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Stable Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Wahrung | Veraufter Betrag | Verauftere Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|---|--------------------|-------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Anteilklassenabsicherung:</b>                  |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                    |                   |                      |   |             |
| 8.106.840,75                                      | AUD                | 5.192.150,89      | EUR                  | (7.306,93)  | 28.01.2022  |
| 123.906.250,90                                    | CAD                | 85.881.803,23     | EUR                  | 108.300,88  | 28.01.2022  |
| 69.815.328,97                                     | CHF                | 66.586.011,01     | EUR                  | 1.015.387,51  | 28.01.2022  |
| 675.544,13  | EUR                | 1.056.520,23      | AUD                  | (168,82)  | 28.01.2022  |
| 1.384.265,00                                      | EUR                | 1.993.507,96      | CAD                  | 785,19  | 28.01.2022  |
| 2.252.876,96                                      | EUR                | 2.352.543,42      | CHF                  | (25.059,74)   | 28.01.2022  |
| 621.296,39  | EUR                | 527.718,77        | GBP                  | (6.517,95)  | 28.01.2022  |
| 691.901,51  | EUR                | 7.045.105,90      | NOK                  | (13.002,10)   | 28.01.2022  |
| 36.071,93   | EUR                | 169.223,02        | PLN                  | (657,42)  | 28.01.2022  |
| 5.767.371,98                                      | EUR                | 59.168.585,66     | SEK                  | (2.198,75)  | 28.01.2022  |
| 119.441,02  | EUR                | 184.536,62        | SGD                  | (1.193,86)  | 28.01.2022  |
| 9.883.563,74                                      | EUR                | 11.181.179,49     | USD                  | 17.344,98   | 28.01.2022  |
| 10.708.995,81                                     | GBP                | 12.692.816,54     | EUR                  | 47.374,68   | 28.01.2022  |
| 421.985.412,96                                    | NOK                | 41.819.289,95     | EUR                  | 402.598,08  | 28.01.2022  |
| 12.020.490,35                                     | PLN                | 2.539.342,88      | EUR                  | 69.679,56   | 28.01.2022  |
| 80.822.918,09                                     | SEK                | 7.976.495,45      | EUR                  | (95.446,03)   | 28.01.2022  |
| 12.809.858,58                                     | SGD                | 8.313.500,93      | EUR                  | 60.519,10   | 28.01.2022  |
| 437.089.300,93                                    | USD                | 387.954.573,36    | EUR                  | (2.269.902,53)  | 28.01.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(699.464,15)</b>   |             |
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b>            |                    |                   |                      |   |             |
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b>     |                    |                   |                      |   |             |
| 2.921.114,84                                      | EUR                | 383.940.000,00    | JPY                  | (22.512,09)   | 14.01.2022  |
| 1.967.285,98                                      | EUR                | 2.275.000,00      | USD                  | (40.733,94)   | 14.01.2022  |
| 3.603.000,00                                      | USD                | 3.138.698,87      | EUR                  | 41.469,20   | 14.01.2022  |
| 60.800.954,64                                     | EUR                | 70.212.000,00     | USD                  | (1.150.687,96)  | 31.01.2022  |
| 9.958.960,36                                      | AUD                | 5.343.000,00      | GBP                  | 13.159,49   | 01.02.2022  |
| 146.146.062,69                                    | EUR                | 239.318.898,18    | NZD                  | 2.112.170,01  | 16.02.2022  |
| 897.185,45  | EUR                | 7.911.000,00      | HKD                  | 2.614,00  | 28.02.2022  |
| 1.557.770,87                                      | EUR                | 1.330.000,00      | GBP                  | (23.202,55)   | 01.03.2022  |
| 24.311.767,82                                     | EUR                | 27.505.000,00     | USD                  | 57.308,69   | 01.03.2022  |
| 8.668.000,00                                      | USD                | 7.654.204,45      | EUR                  | (10.580,38)   | 01.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>979.004,47</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>                |                    |                   |                      |   |             |
| 3.398.000,00                                      | AUD                | 2.117.156,59      | EUR                  | 56.612,55   | 14.01.2022  |
| 5.553.000,00                                      | CAD                | 3.747.329,35      | EUR                  | 107.565,88  | 14.01.2022  |
| 3.084.966,66                                      | EUR                | 4.904.000,00      | AUD                  | (52.213,50)   | 14.01.2022  |
| 1.984.015,40                                      | EUR                | 2.960.000,00      | CAD                  | (70.821,45)   | 14.01.2022  |
| 20.474.279,98                                     | EUR                | 2.681.404.000,00  | JPY                  | (83.739,00)   | 14.01.2022  |
| 30.040.782,81                                     | EUR                | 35.067.000,00     | USD                  | (911.041,33)  | 14.01.2022  |
| 8.188.059.527,00                                  | JPY                | 62.932.547,41     | EUR                  | (155.733,31)  | 14.01.2022  |
| 163.131.000,00                                    | USD                | 140.939.932,34    | EUR                  | 3.047.044,48  | 14.01.2022  |
| 53.454.000,00                                     | USD                | 45.938.537,49     | EUR                  | 1.226.863,69  | 31.01.2022  |
| 14.644.662,95                                     | CAD                | 15.897.000,00     | AUD                  | (4.056,89)  | 01.02.2022  |
| 3.767.000,00                                      | CAD                | 25.890.544,67     | SEK                  | 89.604,86   | 01.02.2022  |
| 5.010.881,19                                      | CHF                | 8.052.000,00      | NZD                  | 3.255,00  | 01.02.2022  |
| 129.314.000,00                                    | EUR                | 134.892.024,05    | CHF                  | (1.303.470,14)  | 01.02.2022  |
| 2.038.000,00                                      | EUR                | 20.841.877,24     | NOK                  | (47.055,29)   | 01.02.2022  |
| 7.430.000,00                                      | EUR                | 8.426.992,32      | USD                  | (5.339,21)  | 01.02.2022  |
| 365.049.000,00                                    | JPY                | 29.277.627,41     | SEK                  | (56.634,63)   | 01.02.2022  |
| 19.072.065,32                                     | NOK                | 243.029.000,00    | JPY                  | 45.147,85   | 01.02.2022  |
| 7.265.000,00                                      | NOK                | 7.355.454,34      | SEK                  | 9.594,36  | 01.02.2022  |
| 69.262.530,59                                     | NOK                | 7.653.000,00      | USD                  | 176.723,96  | 01.02.2022  |
| 1.300.748.993,71                                  | SEK                | 143.707.000,00    | USD                  | 35.293,18   | 01.02.2022  |
| 286.132.000,00                                    | USD                | 32.588.111.664,00 | JPY                  | 2.669.878,46  | 01.02.2022  |
| 751.000,00  | USD                | 6.820.401,46      | SEK                  | (2.409,19)  | 01.02.2022  |
| 229.765.532,08                                    | EUR                | 266.545.622,43    | USD                  | (5.403.085,18)  | 04.02.2022  |
| 621.298.262,72                                    | EUR                | 976.095.419,65    | AUD                  | (2.769.196,86)  | 16.02.2022  |
| 85.572.699,53                                     | EUR                | 97.379.759,56     | USD                  | (321.874,95)  | 16.02.2022  |
| 20.966.264,80                                     | USD                | 29.679.000,00     | AUD                  | (482.243,13)  | 16.02.2022  |
| 126.967.000,00                                    | USD                | 111.969.325,78    | EUR                  | 22.559,73   | 16.02.2022  |
| 26.435.992,07                                     | EUR                | 30.000.000,00     | USD                  | (19.234,89)   | 28.02.2022  |
| 27.483.337.144,00                                 | JPY                | 212.106.399,11    | EUR                  | (1.517.055,15)  | 28.02.2022  |
| 60.000.000,00                                     | USD                | 52.916.927,34     | EUR                  | (6.522,46)  | 28.02.2022  |
| 1.404.000,00                                      | AUD                | 899.724,78        | EUR                  | (2.302,91)  | 01.03.2022  |
| 1.405.775,30                                      | EUR                | 2.224.000,00      | AUD                  | (15.803,41)   | 01.03.2022  |
| 1.341.436,08                                      | EUR                | 1.141.000,00      | GBP                  | (14.867,10)   | 01.03.2022  |
| 4.968.265,48                                      | EUR                | 51.062.432,00     | NOK                  | (134.555,89)  | 01.03.2022  |
| 41.928.207,84                                     | EUR                | 47.610.000,00     | USD                  | (55.413,85)   | 01.03.2022  |
| 2.191.000,00                                      | GBP                | 2.575.325,68      | EUR                  | 29.109,91   | 01.03.2022  |
| 48.121.000,00                                     | USD                | 42.411.933,36     | EUR                  | 22.262,77   | 01.03.2022  |
|   |                    |                   |                      | <b>(5.893.153,04)</b>   |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Stable Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                                | Erworbene Wahrung | Verauerter Betrag | Verauerte Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|--|--------------------|---------------------|----------------------|---|-------------|
| <b>Gegenpartei: BofA Securities Europe SA</b>    |                    |                     |                      |   |             |
| 8.112.000,00                                     | AUD                | 5.188.156,20        | EUR                  | 1.219,47  | 14.01.2022  |
| 26.226.000,00                                    | CAD                | 17.818.497,64       | EUR                  | 387.573,05  | 14.01.2022  |
| 1.246.656,28                                     | EUR                | 1.974.000,00        | AUD                  | (16.147,06)   | 14.01.2022  |
| 4.207.013,03                                     | EUR                | 6.066.000,00        | CAD                  | (3.977,92)  | 14.01.2022  |
| 252.152.712,60                                   | EUR                | 32.794.964.500,00   | JPY                  | 717.902,46  | 14.01.2022  |
| 44.703.602,19                                    | EUR                | 52.040.000,00       | USD                  | (1.229.378,25)  | 14.01.2022  |
| 45.612.121.887,00                                | JPY                | 350.823.601,42      | EUR                  | (1.121.311,83)  | 14.01.2022  |
| 10.620.000,00                                    | USD                | 9.229.558,38        | EUR                  | 144.131,63  | 14.01.2022  |
| 604.790.648,09                                   | EUR                | 707.817.500,00      | USD                  | (19.757.624,95)   | 31.01.2022  |
| 289.204.000,00                                   | USD                | 248.535.991,19      | EUR                  | 6.644.591,99  | 31.01.2022  |
| 6.308.625,46                                     | AUD                | 3.992.000,00        | EUR                  | 42.526,48   | 01.02.2022  |
| 5.511.000,00                                     | AUD                | 3.939.747,22        | USD                  | 48.298,45   | 01.02.2022  |
| 3.735.523,02                                     | CAD                | 2.181.000,00        | GBP                  | (2.227,35)  | 01.02.2022  |
| 6.895.000,00                                     | CAD                | 48.643.769,93       | SEK                  | 41.614,15   | 01.02.2022  |
| 4.894.258,34                                     | CHF                | 6.688.000,00        | CAD                  | 98.170,11   | 01.02.2022  |
| 3.305.000,00                                     | EUR                | 5.171.568,16        | AUD                  | (2.330,25)  | 01.02.2022  |
| 563.726.090,48                                   | EUR                | 811.793.709,30      | CAD                  | 395.689,12  | 01.02.2022  |
| 313.294.051,45                                   | EUR                | 265.300.535,71      | GBP                  | (2.298.116,11)  | 01.02.2022  |
| 2.263.000,00                                     | EUR                | 290.143.756,00      | JPY                  | 39.027,49   | 01.02.2022  |
| 448.561.907,02                                   | EUR                | 4.390.187.524,56    | NOK                  | 9.371.764,78  | 01.02.2022  |
| 55.674.572.568,00                                | JPY                | 419.612.247,18      | EUR                  | 7.145.927,52  | 01.02.2022  |
| 173.645.986,43                                   | NOK                | 2.153.474.000,00    | JPY                  | 865.403,76  | 01.02.2022  |
| 54.158.000,00                                    | NZD                | 333.505.993,00      | SEK                  | 94.332,82   | 01.02.2022  |
| 11.321.364,62                                    | USD                | 10.033.000,00       | EUR                  | (43.916,17)   | 01.02.2022  |
| 14.584.000,00                                    | USD                | 123.834.829,51      | NOK                  | 479.620,01  | 01.02.2022  |
| 3.849.000,00                                     | USD                | 34.967.483,73       | SEK                  | (13.497,83)   | 01.02.2022  |
| 11.285.568,58                                    | AUD                | 7.166.000,00        | EUR                  | 49.453,26   | 16.02.2022  |
| 7.715.000,00                                     | AUD                | 623.223.101,00      | JPY                  | 156.523,66  | 16.02.2022  |
| 5.257.000,00                                     | AUD                | 3.742.365,78        | USD                  | 60.134,67   | 16.02.2022  |
| 8.163.000,00                                     | EUR                | 12.988.271,75       | AUD                  | (141.153,40)  | 16.02.2022  |
| 134.393.726,80                                   | EUR                | 152.152.085,19      | USD                  | 187.395,40  | 16.02.2022  |
| 976.115.384,00                                   | JPY                | 12.070.000,00       | AUD                  | (236.500,31)  | 16.02.2022  |
| 4.793.904,27                                     | USD                | 6.700.000,00        | AUD                  | (55.195,45)   | 16.02.2022  |
| 94.457.222,33                                    | USD                | 83.263.947,56       | EUR                  | 52.554,89   | 16.02.2022  |
| 22.568.894,95                                    | EUR                | 167.872.000,00      | DKK                  | (6.667,53)  | 28.02.2022  |
| 1.109.379.427,08                                 | EUR                | 1.254.278.183,00    | USD                  | 3.310.112,10  | 28.02.2022  |
| 990.220.858,00                                   | JPY                | 7.640.000,00        | EUR                  | (52.492,53)   | 28.02.2022  |
| 3.710.000,00                                     | AUD                | 2.350.614,19        | EUR                  | 20.808,18   | 01.03.2022  |
| 7.047.614,56                                     | EUR                | 11.151.000,00       | AUD                  | (80.095,16)   | 01.03.2022  |
| 134.027.263,89                                   | EUR                | 193.159.000,00      | CAD                  | 73.822,47   | 01.03.2022  |
| 1.819.367,21                                     | EUR                | 1.552.000,00        | GBP                  | (25.496,25)   | 01.03.2022  |
| 862.067.783,85                                   | EUR                | 974.368.805,00      | USD                  | 2.850.792,62  | 01.03.2022  |
| 1.613.000,00                                     | GBP                | 1.891.345,13        | EUR                  | 26.028,57   | 01.03.2022  |
| 18.000.000,00                                    | USD                | 15.853.478,63       | EUR                  | 19.344,42   | 01.03.2022  |
|  |                    |                     |                      | <b>8.238.635,18</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Citibank Europe PLC</b>          |                    |                     |                      |   |             |
| 1.388.000,00                                     | AUD                | 875.271,32          | EUR                  | 12.657,59   | 14.01.2022  |
| 2.307.691,53                                     | EUR                | 3.648.000,00        | AUD                  | (25.998,74)   | 14.01.2022  |
| 4.264.015,53                                     | EUR                | 6.153.000,00        | CAD                  | (7.371,30)  | 14.01.2022  |
| 15.296.250,79                                    | EUR                | 1.977.319.000,00    | JPY                  | 136.422,08  | 14.01.2022  |
| 12.053.769,45                                    | EUR                | 14.000.000,00       | USD                  | (303.289,74)  | 14.01.2022  |
| 910.134.000,00                                   | JPY                | 7.017.999,29        | EUR                  | (40.123,16)   | 14.01.2022  |
| 10.825.000,00                                    | USD                | 9.319.362,69        | EUR                  | 235.292,20  | 14.01.2022  |
| 157.924.705,40                                   | EUR                | 183.396.000,00      | USD                  | (3.895.483,03)  | 31.01.2022  |
| 184.446.000,00                                   | USD                | 158.693.669,06      | EUR                  | 4.053.068,15  | 31.01.2022  |
| 14.020.000,00                                    | CAD                | 10.097.007,72       | CHF                  | (48.073,51)   | 01.02.2022  |
| 14.748.000,00                                    | CAD                | 104.413.834,27      | NOK                  | (211.588,20)  | 01.02.2022  |
| 2.467.644,08                                     | CHF                | 2.031.000,00        | GBP                  | (26.577,74)   | 01.02.2022  |
| 8.813.000,00                                     | EUR                | 12.746.136,14       | CAD                  | (31.986,31)   | 01.02.2022  |
| 9.289.000,00                                     | EUR                | 1.191.050.257,00    | JPY                  | 159.514,71  | 01.02.2022  |
| 11.193.000,00                                    | GBP                | 1.716.687.200,00    | JPY                  | 156.167,81  | 01.02.2022  |
| 1.129.911.206,00                                 | JPY                | 14.769.000,00       | NZD                  | (232.900,54)  | 01.02.2022  |
| 163.169.803,96                                   | SEK                | 18.002.000,00       | USD                  | 26.526,14   | 01.02.2022  |
| 5.095.312,61                                     | USD                | 4.508.000,00        | EUR                  | (12.568,09)   | 04.02.2022  |
| 1.440.923.845,36                                 | EUR                | 1.653.317.317,00    | USD                  | (17.407.919,08)   | 16.02.2022  |
| 2.376.513,92                                     | USD                | 3.344.000,00        | AUD                  | (41.801,59)   | 16.02.2022  |
| 1.191.239.294,80                                 | USD                | 1.038.206.693,75    | EUR                  | 12.542.660,17   | 16.02.2022  |
| 70.149.515,06                                    | EUR                | 79.329.000,00       | USD                  | 194.225,58  | 28.02.2022  |
| 4.191.000,00                                     | HKD                | 473.792,36          | EUR                  | 116,47  | 01.03.2022  |
| 26.630.000,00                                    | USD                | 23.573.542,30       | EUR                  | (90.714,72)   | 01.03.2022  |
|  |                    |                     |                      | <b>(4.859.744,85)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: Goldman Sachs Bank Europe SE</b> |                    |                     |                      |   |             |
| 11.403.000,00                                    | AUD                | 7.150.583,71        | EUR                  | 144.133,67  | 14.01.2022  |
| 5.077.000,00                                     | CAD                | 3.495.797,94        | EUR                  | 28.639,98   | 14.01.2022  |
| 8.832.099,46                                     | EUR                | 14.036.000,00       | AUD                  | (146.990,60)  | 14.01.2022  |
| 2.758.562,68                                     | EUR                | 4.059.000,00        | CAD                  | (59.192,04)   | 14.01.2022  |
| 21.068.009,94                                    | EUR                | 2.722.210.000,00    | JPY                  | 197.208,36  | 14.01.2022  |
| 1.252.109.674,82                                 | EUR                | 1.485.536.939,00    | USD                  | (59.102.075,25)   | 14.01.2022  |
| 3.876.152.000,00                                 | JPY                | 30.089.982,80       | EUR                  | (372.093,46)  | 14.01.2022  |
| 10.000.000,00                                    | USD                | 8.601.388,44        | EUR                  | 225.084,58  | 14.01.2022  |
| 3.119.000,00                                     | USD                | 2.668.781,84        | EUR                  | 83.289,90   | 31.01.2022  |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Stable Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                              | Erworbene Wahrung | Verauerter Betrag | Verauerte Wahrung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) in der Basiswahrung des Teilfonds (EUR) | Falligkeit |
|--|--------------------|---------------------|----------------------|---|-------------|
| 1.135.000,00                                   | AUD                | 1.023.681,36        | CAD                  | 15.499,48   | 01.02.2022  |
| 12.281.000,00                                  | AUD                | 977.861.116,00      | JPY                  | 358.722,03  | 01.02.2022  |
| 5.404.000,00                                   | AUD                | 5.676.053,03        | NZD                  | 37.949,97   | 01.02.2022  |
| 12.897.012,13                                  | CHF                | 17.807.000,00       | CAD                  | 131.457,39  | 01.02.2022  |
| 270.613.515,98                                 | CHF                | 254.990.262,59      | EUR                  | 7.050.472,99  | 01.02.2022  |
| 127.804.606,60                                 | CHF                | 140.618.000,00      | USD                  | (316.881,32)  | 01.02.2022  |
| 210.866.330,83                                 | EUR                | 326.712.075,66      | AUD                  | 1.928.078,96  | 01.02.2022  |
| 1.750.000,00                                   | EUR                | 1.495.113,38        | GBP                  | (28.543,37)   | 01.02.2022  |
| 5.351.000,00                                   | EUR                | 694.774.108,00      | JPY                  | 25.467,05   | 01.02.2022  |
| 19.029.000,00                                  | EUR                | 193.837.660,14      | NOK                  | (362.790,65)  | 01.02.2022  |
| 184.656.669,59                                 | EUR                | 301.086.961,81      | NZD                  | 3.347.930,20  | 01.02.2022  |
| 60.275.939,08                                  | EUR                | 70.391.628,01       | USD                  | (1.833.350,88)  | 01.02.2022  |
| 4.452.000,00                                   | GBP                | 7.558.432,86        | CAD                  | 50.901,80   | 01.02.2022  |
| 4.445.000,00                                   | GBP                | 51.631.321,11       | SEK                  | 253.356,43  | 01.02.2022  |
| 55.674.572.570,00                              | JPY                | 419.966.753,69      | EUR                  | 6.791.212,11  | 01.02.2022  |
| 1.062.209.000,00                               | JPY                | 86.112.834,11       | NOK                  | (473.040,41)  | 01.02.2022  |
| 59.910.988,44                                  | NOK                | 751.948.000,00      | JPY                  | 229.853,97  | 01.02.2022  |
| 436.691.270,47                                 | USD                | 373.936.179,09      | EUR                  | 11.373.629,87   | 01.02.2022  |
| 2.836.000,00                                   | USD                | 24.163.931,54       | NOK                  | 84.953,52   | 01.02.2022  |
| 35.065.473,46                                  | EUR                | 39.615.676,53       | USD                  | 122.377,61  | 16.02.2022  |
| 596.730.829,00                                 | JPY                | 7.515.000,00        | AUD                  | (231.747,66)  | 16.02.2022  |
| 2.983.709,04                                   | EUR                | 22.193.000,00       | DKK                  | (823,51)  | 28.02.2022  |
| 66.358.618,01                                  | EUR                | 75.252.000,00       | USD                  | (1.622,47)  | 28.02.2022  |
| 1.022.372.917,00                               | JPY                | 7.922.000,00        | EUR                  | (88.166,35)   | 28.02.2022  |
| 6.207.000,00                                   | AUD                | 3.903.334,68        | EUR                  | 64.196,17   | 01.03.2022  |
| 7.300.000,00                                   | CAD                | 5.067.880,62        | EUR                  | (5.421,41)  | 01.03.2022  |
| 3.412.170,04                                   | EUR                | 5.397.000,00        | AUD                  | (37.586,45)   | 01.03.2022  |
| 3.757.950,54                                   | EUR                | 5.459.000,00        | CAD                  | (27.833,42)   | 01.03.2022  |
| 117.024.903,75                                 | EUR                | 121.692.000,00      | CHF                  | (828.318,75)  | 01.03.2022  |
| 112.404.491,29                                 | EUR                | 95.245.656,00       | GBP                  | (813.252,40)  | 01.03.2022  |
| 1.423.213,62                                   | EUR                | 12.574.000,00       | HKD                  | 1.375,95  | 01.03.2022  |
| 1.525.000,00                                   | GBP                | 1.786.073,90        | EUR                  | 26.696,46   | 01.03.2022  |
| 4.461.000,00                                   | HKD                | 504.622,86          | EUR                  | (183,38)  | 01.03.2022  |
| 47.030.000,00                                  | USD                | 41.605.054,53       | EUR                  | (133.098,79)  | 01.03.2022  |
|  |                    |                     |                      | <b>(32.290.524,12)</b>  |             |
| <b>Gegenpartei: HSBC Continental Europe SA</b> |                    |                     |                      |   |             |
| 25.970.952,18                                  | EUR                | 30.000.000,00       | USD                  | (508.424,10)  | 14.01.2022  |
| 347.175.000,00                                 | JPY                | 2.629.296,76        | EUR                  | 32.459,95   | 14.01.2022  |
| 14.799.000,00                                  | USD                | 12.811.470,71       | EUR                  | 250.805,61  | 14.01.2022  |
| 132.373,25                                     | EUR                | 138.000,00          | CHF                  | (1.273,91)  | 01.03.2022  |
|  |                    |                     |                      | <b>(226.432,45)</b>   |             |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>               |                    |                     |                      |   |             |
| 2.300.000,00                                   | AUD                | 1.443.509,23        | EUR                  | 27.844,49   | 14.01.2022  |
| 3.881.000,00                                   | CAD                | 2.694.752,25        | EUR                  | (579,64)  | 14.01.2022  |
| 2.135.517,12                                   | EUR                | 3.390.000,00        | AUD                  | (33.128,27)   | 14.01.2022  |
| 6.306.727,90                                   | EUR                | 9.196.000,00        | CAD                  | (77.113,73)   | 14.01.2022  |
| 24.555.632,36                                  | EUR                | 3.152.443.000,00    | JPY                  | 386.335,30  | 14.01.2022  |
| 23.245.556,68                                  | EUR                | 26.825.256,00       | USD                  | (431.639,02)  | 14.01.2022  |
| 5.341.760.000,00                               | JPY                | 40.907.228,83       | EUR                  | 47.405,90   | 14.01.2022  |
| 11.935.000,00                                  | AUD                | 12.450.087,15       | NZD                  | 135.485,58  | 01.02.2022  |
| 7.646.014,50                                   | CAD                | 5.906.000,00        | USD                  | 94.874,96   | 01.02.2022  |
| 10.060.000,00                                  | EUR                | 14.733.603,37       | CAD                  | (164.233,76)  | 01.02.2022  |
| 8.622.000,00                                   | EUR                | 86.027.944,95       | NOK                  | 15.748,16   | 01.02.2022  |
| 14.720.000,00                                  | EUR                | 149.393.592,64      | SEK                  | 153.255,38  | 01.02.2022  |
| 16.916.000,00                                  | GBP                | 203.121.223,02      | SEK                  | 317.153,99  | 01.02.2022  |
| 205.206.282,00                                 | JPY                | 2.445.000,00        | AUD                  | 9.312,48  | 01.02.2022  |
| 481.661.000,00                                 | JPY                | 36.368.128,81       | NOK                  | 53.757,23   | 01.02.2022  |
| 8.012.000,00                                   | NZD                | 5.016.007,14        | CHF                  | (32.323,09)   | 01.02.2022  |
| 3.930.387,37                                   | USD                | 5.574.000,00        | AUD                  | (96.875,33)   | 01.02.2022  |
| 5.995.000,00                                   | USD                | 7.698.088,38        | CAD                  | (52.458,96)   | 01.02.2022  |
| 145.818.000,00                                 | USD                | 134.271.882,87      | CHF                  | (1.358.321,21)  | 01.02.2022  |
| 6.850.278,38                                   | USD                | 5.164.000,00        | GBP                  | (98.780,44)   | 01.02.2022  |
| 8.548.592,72                                   | USD                | 7.539.000,00        | EUR                  | 3.166,54  | 04.02.2022  |
| 26.347.827.994,00                              | JPY                | 201.597.487,61      | EUR                  | 324.232,02  | 16.02.2022  |
| 123.199.000,00                                 | DKK                | 16.565.188,82       | EUR                  | 2.710,06  | 28.02.2022  |
| 7.210.670,47                                   | EUR                | 53.633.000,00       | DKK                  | (1.938,58)  | 28.02.2022  |
| 10.663.000,00                                  | EUR                | 1.367.386.439,00    | JPY                  | 185.607,38  | 28.02.2022  |
| 39.764.207,09                                  | EUR                | 45.000.000,00       | USD                  | 81.486,92   | 28.02.2022  |
| 569.711.067,00                                 | JPY                | 4.444.000,00        | EUR                  | (78.676,24)   | 28.02.2022  |
| 100.000.000,00                                 | USD                | 88.283.845,22       | EUR                  | (99.934,21)   | 28.02.2022  |
| 8.394.000,00                                   | CAD                | 5.797.929,93        | EUR                  | 23.237,35   | 01.03.2022  |
| 480.000,00                                     | CHF                | 461.041,20          | EUR                  | 3.817,80  | 01.03.2022  |
| 7.071.834,48                                   | EUR                | 10.254.000,00       | CAD                  | (39.238,93)   | 01.03.2022  |
| 1.324.581,78                                   | EUR                | 1.375.000,00        | CHF                  | (7.041,24)  | 01.03.2022  |
| 24.774.122,45                                  | EUR                | 218.279.000,00      | HKD                  | 91.733,52   | 01.03.2022  |
| 140.761.638,71                                 | EUR                | 159.589.000,00      | USD                  | 32.533,92   | 01.03.2022  |
| 22.850.000,00                                  | HKD                | 2.587.856,63        | EUR                  | (4.035,31)  | 01.03.2022  |
| 19.039.000,00                                  | USD                | 16.810.018,87       | EUR                  | (21.027,19)   | 01.03.2022  |
|  |                    |                     |                      | <b>(607.646,17)</b>   |             |

Differenzen in den Prozentsatzen des Nettovermogens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - Stable Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

| Erworbener Betrag                   | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds (EUR) | Fälligkeit |
|-------------------------------------|-------------------|--------------------|--------------------|---|------------|
| <b>Gegenpartei: Nordea Bank Abp</b> |                   |                    |                    |   |            |
| 382.336.363,95                      | EUR               | 3.807.061.275,74   | SEK                | 11.129.990,71   | 01.02.2022 |
| 58.768.000,00                       | NOK               | 59.922.636,58      | SEK                | 36.347,59   | 01.02.2022 |
| 2.068.595.190,85                    | SEK               | 207.745.320,20     | EUR                | (6.047.563,62)  | 01.02.2022 |
| 25.529.673,10                       | SEK               | 2.814.000,00       | USD                | 6.451,67  | 01.02.2022 |
| 7.451.223,30                        | USD               | 10.990.000,00      | NZD                | (42.055,49)   | 16.02.2022 |
| 650.925.562,00                      | EUR               | 4.841.200.284,08   | DKK                | (122.896,07)  | 28.02.2022 |
|                                     |                   |                    |                    | <b>4.960.274,79</b>   |            |
|                                     |                   |                    |                    | <b>(29.699.586,19)</b>  |            |
|                                     |                   |                    |                    | <b>(30.399.050,34)</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

## Credit Default Swaps

| Basiswert                                     | Kauf/Verkauf | Fester Zinssatz | Nominal          | Währung | Kosten (EUR)         | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) (EUR) | Marktwert (EUR)      | Fälligkeit |
|---|--------------|-----------------|------------------|---------|----------------------|---|----------------------|------------|
| <b>Gegenpartei: Barclays Bank Ireland PLC</b> |              |                 |                  |         |                      |   |                      |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (8.228.000,00)   | USD     | 682.097,62           | (10.795,51)   | 671.302,11           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (10.805.000,00)  | USD     | 896.105,51           | (14.552,36)   | 881.553,15           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (12.695.000,00)  | USD     | 1.051.765,99         | (16.012,43)   | 1.035.753,56         | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (10.354.000,00)  | USD     | 836.499,10           | 8.258,07  | 844.757,17           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (9.806.000,00)   | USD     | 795.772,01           | 4.275,21  | 800.047,22           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.849.000,00)   | USD     | 241.959,05           | (9.516,20)  | 232.442,85           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (3.137.000,00)   | USD     | 250.029,60           | 5.910,45  | 255.940,05           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.273.000,00)   | USD     | 152.016,56           | 33.431,88   | 185.448,44           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.685.000,00)   | USD     | 187.430,41           | 31.632,08   | 219.062,49           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.725.000,00)   | USD     | 208.973,87           | 13.352,12   | 222.325,99           | 20.12.2026 |
|   |              |                 |                  |         | <b>5.302.649,72</b>  | <b>45.983,31</b>                                    | <b>5.348.633,03</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: BNP Paribas SA</b>            |              |                 |                  |         |                      |   |                      |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (11.584.000,00)  | USD     | 927.810,96           | 17.298,86   | 945.109,82           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.413.000,00)   | USD     | 195.052,75           | 1.817,93  | 196.870,68           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.686.000,00)   | USD     | 188.424,78           | 30.719,30   | 219.144,08           | 20.12.2026 |
|   |              |                 |                  |         | <b>1.311.288,49</b>  | <b>49.836,09</b>                                    | <b>1.361.124,58</b>  |            |
| <b>Gegenpartei: ICE Clear Europe Limited</b>  |              |                 |                  |         |                      |   |                      |            |
| ITRAXX-XOVERS36V1-5Y                          | Verkauf      | 5,00%           | (185.699.000,00) | EUR     | 21.764.491,12        | 371.444,58  | 22.135.935,70        | 20.12.2026 |
|   |              |                 |                  |         | <b>21.764.491,12</b> | <b>371.444,58</b>                                   | <b>22.135.935,70</b> |            |
| <b>Gegenpartei: JP Morgan SE</b>              |              |                 |                  |         |                      |   |                      |            |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (4.678.000,00)   | USD     | 361.101,00           | 20.565,41   | 381.666,41           | 20.12.2026 |
| CDX-NAHYS37V1-5Y                              | Verkauf      | 5,00%           | (2.767.000,00)   | USD     | 195.477,29           | 30.275,38   | 225.752,67           | 20.12.2026 |
|   |              |                 |                  |         | <b>556.578,29</b>    | <b>50.840,79</b>                                    | <b>607.419,08</b>    |            |
|   |              |                 |                  |         | <b>28.935.007,62</b> | <b>518.104,77</b>                                   | <b>29.453.112,39</b> |            |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Stable Return Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente (Fortsetzung)

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>vom 30.12.2021 bis 31.12.2021<br>in der Basiswährung des<br>Teilfonds (EUR) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (EUR) |
|--|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                      |                             |   |  |
| CAN 10YR BOND FUT 3/2022               | 31.03.2022 | CAD     | (2.664,00)                           | (378.954.000,00)            | 221.983,38  | (7.393.704,34)   |
| EURO STOXX 50 3/2022                   | 18.03.2022 | EUR     | (4.395,00)                           | (188.106.000,00)            | 329.625,00  | (4.074.528,87)   |
| EURO-BOBL FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (6.207,00)                           | (827.206.890,00)            | (186.210,00)  | 6.124.233,42   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | (2.529,00)                           | (433.394.730,00)            | 0,00  | 7.751.549,39   |
| EURO-BUND FUTURE 3/2022                | 10.03.2022 | EUR     | 984,00                               | 168.628.080,00              | 0,00  | (3.015.194,45)   |
| FTSE 100 IDX FUT 3/2022                | 18.03.2022 | GBP     | (1.193,00)                           | (87.524.445,00)             | 170.416,84  | (1.959.884,65)   |
| MSCI EmgMkt 3/2022                     | 18.03.2022 | USD     | (4.226,00)                           | (260.828.720,00)            | (205.209,02)  | 6.716,32   |
| NIKKEI 225 MINI 3/2022                 | 11.03.2022 | JPY     | (5.330,00)                           | (15.371.720.000,00)         | (245.230,95)  | (1.321.003,56)   |
| S&P500 EMINI FUT 3/2022                | 18.03.2022 | USD     | (5.744,00)                           | (1.369.082.400,00)          | 1.331.214,41  | (18.687.440,12)  |
| SPI 200 FUTURES 3/2022                 | 17.03.2022 | AUD     | (666,00)                             | (122.360.850,00)            | 916.231,43  | (1.700.498,48)   |
| US 10YR NOTE (CBT)3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 11.467,00                            | 1.495.368.468,75            | 0,00  | 11.287.329,77  |
|  |            |         |                                      |                             | <b>2.332.821,09</b>   | <b>(12.982.425,57)</b>   |

Barclays Bank Ireland PLC hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 6.720.000,00 EUR gezahlt.  
 BNP Paribas S.A. hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 4.230.000,00 EUR erhalten.  
 BofA Securities Europe SA hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte 19.380.000,00 EUR gezahlt.  
 Citibank Europe PLC hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte 5.980.000,00 EUR erhalten.  
 Deutsche Bank AG hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte 260.000,00 EUR gezahlt.  
 Goldman Sachs Bank Europe SE hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte 30.200.000,00 EUR erhalten.  
 J.P. Morgan SE hat als Sicherheit für Credit Default Swaps und Devisenterminkontrakte 550.000,00 EUR gezahlt.  
 Nordea Bank Abp hat als Sicherheit für Devisenterminkontrakte 5.140.000,00 EUR gezahlt.

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
 Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Swedish Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in SEK)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |
| <b>SEK</b>  |   |                            |                              |
| 20.000.000,00   | Hexagon AB FRN 31-05-2024   | 19.996.400,00              | 2,83                         |
| 14.000.000,00   | ICA Gruppen AB 0.375% 25-03-2024  | 13.853.980,00              | 1,96                         |
| 4.000.000,00  | Kommuninvest I Sverige AB 1% 12-11-2026   | 4.070.560,00               | 0,58                         |
| 20.000.000,00   | Landshypotek Bank AB 0.615% 18-11-2025  | 19.958.400,00              | 2,82                         |
| 16.000.000,00   | Lansforsakringar Bank AB 0.565% 25-09-2025  | 15.752.480,00              | 2,23                         |
| 12.000.000,00   | Lansforsakringar Hypotek AB 0.5% 20-09-2028   | 11.619.960,00              | 1,64                         |
| 30.000.000,00   | Lansforsakringar Hypotek AB 1% 15-09-2027   | 30.242.400,00              | 4,27                         |
| 43.000.000,00   | Lansforsakringar Hypotek AB 1.5% 16-09-2026   | 44.608.630,00              | 6,30                         |
| 19.000.000,00   | Lansforsakringar Hypotek AB 1.5% 18-09-2024   | 19.623.770,00              | 2,77                         |
| 17.000.000,00   | Nordea Bank Abp 0.175% 05-09-2022   | 16.999.490,00              | 2,40                         |
| 20.000.000,00   | Nordea Bank Abp FRN 18-08-2031  | 19.962.600,00              | 2,82                         |
| 34.000.000,00   | Samhallsbyggnadsbolaget i No 1.072% 11-05-2023  | 34.072.760,00              | 4,82                         |
| 46.000.000,00   | SBAB Bank AB 0.89% 05-06-2023   | 46.336.720,00              | 6,55                         |
| 18.000.000,00   | SBAB Bank AB FRN 03-06-2030   | 18.717.660,00              | 2,65                         |
| 12.000.000,00   | Scania CV AB 0.75% 20-01-2025   | 11.919.720,00              | 1,68                         |
| 18.000.000,00   | Skandiabanken AB FRN 23-08-2024   | 18.171.540,00              | 2,57                         |
| 20.000.000,00   | Sparbanken Skane AB 0.58% 21-01-2026  | 19.576.800,00              | 2,77                         |
| 26.000.000,00   | Stadshypotek AB 1.5% 03-12-2024   | 26.876.720,00              | 3,80                         |
| 34.000.000,00   | Stadshypotek AB 2% 01-09-2028   | 36.280.720,00              | 5,13                         |
| 18.000.000,00   | Sveriges Sakerstallda Obliga 0.75% 28-03-2024   | 18.212.220,00              | 2,57                         |
| 36.000.000,00   | Swedbank AB 1% 29-03-2023   | 36.284.400,00              | 5,13                         |
| 10.000.000,00   | Swedbank AB 1.588% MULTI 08-05-2028   | 10.066.600,00              | 1,42                         |
| 28.000.000,00   | Sweden Government Bond 0.125% 12-05-2031  | 27.728.120,00              | 3,92                         |
| 19.500.000,00   | Sweden Government Bond 0.5% 24-11-2045  | 18.603.000,00              | 2,63                         |
| 11.000.000,00   | Sweden Government Bond 0.75% 12-11-2029   | 11.507.870,00              | 1,63                         |
| 12.000.000,00   | Sweden Government Bond 1.375% 23-06-2071  | 11.745.960,00              | 1,66                         |
| 31.000.000,00   | Sweden Government Bond 2.25% 01-06-2032   | 37.332.990,00              | 5,28                         |
| 52.000.000,00   | Sweden Government Bond 3.5% 30-03-2039  | 77.937.600,00              | 11,01                        |
| 20.000.000,00   | Volvo Treasury AB FRN 17-02-2025  | 20.063.400,00              | 2,84                         |
|   |   | <b>698.123.470,00</b>      | <b>98,66</b>                 |
|   | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>698.123.470,00</b>      | <b>98,66</b>                 |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>698.123.470,00</b>      | <b>98,66</b>                 |
|   | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>698.123.470,00</b>      | <b>98,66</b>                 |
|   | <b>Bankguthaben</b>   | <b>7.462.185,81</b>        | <b>1,05</b>                  |
|   | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>2.051.351,03</b>        | <b>0,29</b>                  |
|   | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>707.637.006,84</b>      | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Swedish Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land         |              | Sektor               |              |
|--------------|--------------|----------------------|--------------|
| Schweden     | 93,43        | Unternehmensanleihen | 42,65        |
| Finnland     | 5,22         | Hypothekenanleihen   | 29,31        |
|              |              | Staatsanleihen       | 26,70        |
| <b>Summe</b> | <b>98,66</b> | <b>Summe</b>         | <b>98,66</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - Swedish Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/<br>Verkaufte<br>Kontrakte | Verpflichtung in<br>Währung | Nicht realisierte(r)<br>Wertzuwachs/(-minderung)<br>im Zeitraum 30.12.2021 bis<br>31.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (SEK) | Bereits verbuchter, nicht<br>realisierte(r) Wertzuwachs/<br>(-minderung) vom<br>Kontraktabschluss bis zum<br>30.12.2021 in der Basiswährung<br>des Teilfonds (SEK) |
|--|------------|---------|--------------------------------------|-----------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                      |                             |   |  |
| SW 5YR STDS FUT 3/2022                 | 16.03.2022 | SEK     | 20,00                                | 20.173.693,35               | (21.594,00)   | (38.352,00)  |
| SWEDISH 10YR FUT 3/2022                | 16.03.2022 | SEK     | 95,00                                | 101.444.609,27              | (145.492,50)  | (86.483,50)  |
|  |            |         |                                      |                             | <b>(167.086,50)</b>   | <b>(124.835,50)</b>  |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Swedish Short-Term Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in SEK)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                         | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|---|--------------------------------------|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |                                      |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              | <b>Anleihen</b>   |                                      |                            |                              |
| <b>SEK</b>  |   |                            |                              | <b>SEK</b>  |                                      |                            |                              |
| 24.000.000,00   | BillerudKorsnas AB FRN 20-03-2023   | 24.196.080,00              | 2,03                         | 80.000.000,00   | Kraftringen Energi AB FRN 30-05-2023 | 80.180.000,00              | 6,74                         |
| 30.000.000,00   | Essity AB FRN 17-01-2025  | 30.071.400,00              | 2,53                         |   |                                      | <b>80.180.000,00</b>       | <b>6,74</b>                  |
| 10.000.000,00   | Fabege AB FRN 17-06-2024  | 9.957.300,00               | 0,84                         |   |                                      |                            |                              |
| 40.000.000,00   | Getinge AB FRN 10-06-2024   | 40.024.400,00              | 3,37                         |   |                                      | <b>80.180.000,00</b>       | <b>6,74</b>                  |
| 15.000.000,00   | Hexagon AB FRN 10-03-2022   | 15.020.850,00              | 1,26                         |   |                                      |                            |                              |
| 30.000.000,00   | Hexagon AB FRN 15-09-2023   | 30.140.700,00              | 2,53                         |   |                                      |                            |                              |
| 12.000.000,00   | Hexagon AB FRN 26-11-2024   | 12.095.400,00              | 1,02                         |   |                                      |                            |                              |
| 16.000.000,00   | Hexagon AB FRN 31-05-2024   | 15.997.120,00              | 1,35                         |   |                                      |                            |                              |
| 16.000.000,00   | Husqvarna AB FRN 14-02-2023   | 16.071.680,00              | 1,35                         |   |                                      |                            |                              |
| 16.000.000,00   | ICA Gruppen AB FRN 28-02-2023   | 16.008.160,00              | 1,35                         |   |                                      |                            |                              |
| 26.000.000,00   | Ikano Bank AB FRN 19-01-2024  | 26.126.620,00              | 2,20                         |   |                                      |                            |                              |
| 10.000.000,00   | Ikano Bank AB FRN 26-11-2024  | 9.956.700,00               | 0,84                         |   |                                      |                            |                              |
| 10.000.000,00   | Industrivarden AB FRN 01-03-2024  | 9.970.300,00               | 0,84                         |   |                                      |                            |                              |
| 10.000.000,00   | Industrivarden AB FRN 20-02-2023  | 9.998.400,00               | 0,84                         |   |                                      |                            |                              |
| 10.000.000,00   | Indutrade AB 1.75% 23-02-2023   | 10.126.300,00              | 0,85                         |   |                                      |                            |                              |
| 20.000.000,00   | Indutrade AB FRN 25-02-2022   | 20.010.400,00              | 1,68                         |   |                                      |                            |                              |
| 20.000.000,00   | Investment AB Latour FRN 16-03-2022   | 20.022.600,00              | 1,68                         |   |                                      |                            |                              |
| 40.000.000,00   | Investment AB Latour FRN 17-06-2024   | 40.142.000,00              | 3,38                         |   |                                      |                            |                              |
| 12.000.000,00   | Kinnevik AB FRN 15-03-2022  | 12.019.680,00              | 1,01                         |   |                                      |                            |                              |
| 18.000.000,00   | Kinnevik AB FRN 19-02-2025  | 18.131.580,00              | 1,52                         |   |                                      |                            |                              |
| 10.000.000,00   | Lansforsakringar Bank AB 0.382% 09-09-2024  | 9.914.500,00               | 0,83                         |   |                                      |                            |                              |
| 104.000.000,00  | Lansforsakringar Hypotek AB 1.25% 17-09-2025  | 106.815.280,00             | 8,98                         |   |                                      |                            |                              |
| 26.000.000,00   | Lifco AB FRN 02-09-2022   | 26.109.200,00              | 2,20                         |   |                                      |                            |                              |
| 40.000.000,00   | Lifco AB FRN 06-03-2024   | 39.997.200,00              | 3,36                         |   |                                      |                            |                              |
| 14.000.000,00   | Nibe Industrier AB FRN 04-09-2023   | 14.147.140,00              | 1,19                         |   |                                      |                            |                              |
| 10.000.000,00   | Nordea Bank Abp FRN 18-08-2031  | 9.981.300,00               | 0,84                         |   |                                      |                            |                              |
| 74.000.000,00   | Nordea Hypotek AB 1% 18-09-2024   | 75.434.120,00              | 6,34                         |   |                                      |                            |                              |
| 42.000.000,00   | Nordea Hypotek AB 1.25% 20-09-2023  | 42.873.600,00              | 3,60                         |   |                                      |                            |                              |
| 40.000.000,00   | OP Corporate Bank plc FRN 03-06-2030  | 41.561.200,00              | 3,49                         |   |                                      |                            |                              |
| 20.000.000,00   | Scania CV AB FRN 22-11-2024   | 19.948.200,00              | 1,68                         |   |                                      |                            |                              |
| 16.000.000,00   | Skanska Financial Services A FRN 24-05-2023   | 16.028.160,00              | 1,35                         |   |                                      |                            |                              |
| 14.000.000,00   | Sparbanken Skane AB FRN 09-03-2022  | 14.012.180,00              | 1,18                         |   |                                      |                            |                              |
| 30.000.000,00   | Sparbanken Skane AB FRN 11-12-2024  | 30.207.600,00              | 2,54                         |   |                                      |                            |                              |
| 50.000.000,00   | Stadshypotek AB 1.5% 01-03-2024   | 51.459.000,00              | 4,33                         |   |                                      |                            |                              |
| 40.000.000,00   | Stockholm Exergi Holding AB 1.75% 18-05-2022  | 40.228.800,00              | 3,38                         |   |                                      |                            |                              |
| 26.000.000,00   | Swedbank Hypotek AB 1% 18-06-2025   | 26.462.020,00              | 2,22                         |   |                                      |                            |                              |
| 60.000.000,00   | Swedbank Hypotek AB 1% 20-12-2023   | 61.050.600,00              | 5,13                         |   |                                      |                            |                              |
| 6.000.000,00  | Telenor ASA FRN 19-03-2024  | 6.055.380,00               | 0,51                         |   |                                      |                            |                              |
| 12.000.000,00   | Trelleborg Treasury AB FRN 17-10-2024   | 12.109.560,00              | 1,02                         |   |                                      |                            |                              |
| 20.000.000,00   | Volvo Treasury AB FRN 08-12-2022  | 20.327.200,00              | 1,71                         |   |                                      |                            |                              |
| 15.000.000,00   | Volvofinans Bank AB FRN 16-05-2022  | 15.040.500,00              | 1,26                         |   |                                      |                            |                              |
| 30.000.000,00   | Volvofinans Bank AB FRN 20-10-2022  | 30.374.100,00              | 2,55                         |   |                                      |                            |                              |
| 10.000.000,00   | AAK AB FRN 20-11-2024   | 9.977.600,00               | 0,84                         |   |                                      |                            |                              |
|   |   | <b>1.106.202.110,00</b>    | <b>93,01</b>                 |   |                                      |                            |                              |
|   | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>1.106.202.110,00</b>    | <b>93,01</b>                 |   |                                      |                            |                              |
|   | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>1.106.202.110,00</b>    | <b>93,01</b>                 |   |                                      |                            |                              |
|   |   |                            |                              |   | <b>Bankguthaben</b>                  | <b>2.344.380,00</b>        | <b>0,20</b>                  |
|   |   |                            |                              |   | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>  | <b>624.378,01</b>          | <b>0,05</b>                  |
|   |   |                            |                              |   | <b>Summe Nettovermögen</b>           | <b>1.189.350.868,01</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - Swedish Short-Term Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land         |              | Sektor               |              |
|--------------|--------------|----------------------|--------------|
| Schweden     | 94,91        | Unternehmensanleihen | 69,14        |
| Finnland     | 4,33         | Hypothekenanleihen   | 30,61        |
| Norwegen     | 0,51         |                      |              |
| <b>Summe</b> | <b>99,75</b> | <b>Summe</b>         | <b>99,75</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - US Corporate Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              | 9.865.000,00       | Brown & Brown Inc 2.375% 15-03-2031             | 9.615.415,11               | 0,43                         |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              | 9.325.000,00       | Camden Property Trust 3.15% 01-07-2029          | 9.922.557,38               | 0,44                         |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              | 7.360.000,00       | Charles Schwab Corp/Th 5.375% MULTI Perp FC2025 | 8.022.400,00               | 0,36                         |
| 12.000.000,00   | AbbVie Inc 2.95% 21-11-2026                     | 12.638.280,00              | 0,56                         | 6.385.000,00       | Charter Communications Opera 2.25% 15-01-2029   | 6.233.289,02               | 0,28                         |
| 18.640.000,00   | AbbVie Inc 4.05% 21-11-2039                     | 21.363.457,22              | 0,95                         | 10.000.000,00      | Charter Communications Opera 2.8% 01-04-2031    | 9.890.419,10               | 0,44                         |
| 12.910.000,00   | Alexandria Real Estate Equit 1.875% 01-02-2033  | 12.122.430,74              | 0,54                         | 7.970.000,00       | Charter Communications Opera 3.7% 01-04-2051    | 7.704.362,77               | 0,34                         |
| 5.545.000,00  | Ally Financial Inc 3.875% 21-05-2024            | 5.841.214,12               | 0,26                         | 5.920.000,00       | Charter Communications Opera 3.75% 15-02-2028   | 6.344.885,74               | 0,28                         |
| 5.670.000,00  | Ally Financial Inc 8% 01-11-2031                | 8.031.378,72               | 0,36                         | 2.700.000,00       | Citigroup Inc 1.281% MULTI 03-11-2025           | 2.691.387,97               | 0,12                         |
| 8.310.000,00  | Altria Group Inc 2.45% 04-02-2032               | 7.895.647,11               | 0,35                         | 6.125.000,00       | Citigroup Inc 2.572% MULTI 03-06-2031           | 6.182.782,45               | 0,28                         |
| 7.000.000,00  | Amcor Flexibles North Americ 2.63% 19-06-2030   | 7.030.277,87               | 0,31                         | 5.310.000,00       | Citigroup Inc 2.976% MULTI 05-11-2030           | 5.518.174,73               | 0,25                         |
| 13.430.000,00   | American Airlines 2015-2 Cla 3.6% 22-09-2027    | 10.237.703,83              | 0,46                         | 8.305.000,00       | Citigroup Inc 3.106% MULTI 08-04-2026           | 8.709.917,09               | 0,39                         |
| 3.000.000,00  | American International Group 4.375% 30-06-2050  | 3.721.910,82               | 0,17                         | 10.000.000,00      | Citigroup Inc 3.7% 12-01-2026                   | 10.812.183,00              | 0,48                         |
| 5.250.000,00  | American International Group 4.5% 16-07-2044    | 6.430.550,60               | 0,29                         | 4.335.000,00       | Citigroup Inc 3.875% MULTI Perp FC2026          | 4.335.000,00               | 0,19                         |
| 8.830.000,00  | American Tower Corp 1.5% 31-01-2028             | 8.453.521,29               | 0,38                         | 5.400.000,00       | Citigroup Inc 4.000% MULTI Perp FC2025          | 5.440.500,00               | 0,24                         |
| 7.185.000,00  | American Tower Corp 2.4% 15-03-2025             | 7.381.129,45               | 0,33                         | 6.490.000,00       | Citigroup Inc 4.412% MULTI 31-03-2031           | 7.416.440,69               | 0,33                         |
| 9.985.000,00  | American Tower Corp 2.75% 15-01-2027            | 10.296.722,31              | 0,46                         | 6.245.000,00       | Citigroup Inc 4.700% MULTI Perp FC2025          | 6.308.699,00               | 0,28                         |
| 5.000.000,00  | American Tower Corp 2.95% 15-01-2051            | 4.721.441,50               | 0,21                         | 6.520.000,00       | Citigroup Inc 5.950% MULTI Perp FC2023          | 6.715.600,00               | 0,30                         |
| 4.265.000,00  | American Water Capital Corp 3.45% 01-05-2050    | 4.570.022,18               | 0,20                         | 6.840.000,00       | CNA Financial Corp 4.5% 01-03-2026              | 7.550.411,16               | 0,34                         |
| 21.000.000,00   | Anheuser-Busch Cos LLC / Anh 4.7% 01-02-2036    | 25.370.233,98              | 1,13                         | 4.325.000,00       | CNH Industrial Capital LLC 4.2% 15-01-2024      | 4.565.562,47               | 0,20                         |
| 18.085.000,00   | Anheuser-Busch InBev Worldwi 4.5% 01-06-2050    | 22.289.814,22              | 0,99                         | 11.695.000,00      | Comcast Corp 3.25% 01-11-2039                   | 12.312.322,56              | 0,55                         |
| 4.980.000,00  | Apple Inc 3.85% 04-05-2043                      | 5.850.101,12               | 0,26                         | 8.140.000,00       | Comcast Corp 3.75% 01-04-2040                   | 9.093.599,70               | 0,41                         |
| 8.555.000,00  | Arizona Public Service Co 3.35% 15-05-2050      | 8.708.403,73               | 0,39                         | 7.000.000,00       | Conagra Brands Inc 1.375% 01-11-2027            | 6.689.430,16               | 0,30                         |
| 8.665.000,00  | Ashtead Capital Inc 4% 01-05-2028               | 9.058.610,48               | 0,40                         | 3.915.000,00       | Crown Castle International C 4.15% 01-07-2050   | 4.401.972,99               | 0,20                         |
| 6.355.000,00  | AT&T Inc 2.3% 01-06-2027                        | 6.468.953,79               | 0,29                         | 7.105.000,00       | Crown Castle International C 4.45% 15-02-2026   | 7.776.103,06               | 0,35                         |
| 12.124.000,00   | AT&T Inc 2.55% 01-12-2033                       | 11.836.601,06              | 0,53                         | 13.535.000,00      | CVS Health Corp 1.3% 21-08-2027                 | 13.129.289,46              | 0,58                         |
| 14.200.000,00   | AT&T Inc 3.5% 01-06-2041                        | 14.591.843,75              | 0,65                         | 9.370.000,00       | CVS Health Corp 2.7% 21-08-2040                 | 9.003.864,53               | 0,40                         |
| 6.630.000,00  | AT&T Inc 3.5% 15-09-2053                        | 6.683.132,62               | 0,30                         | 5.000.000,00       | CVS Health Corp 2.875% 01-06-2026               | 5.224.257,05               | 0,23                         |
| 6.110.000,00  | AT&T Inc 4.3% 15-02-2030                        | 6.881.539,15               | 0,31                         | 15.680.000,00      | CVS Health Corp 4.78% 25-03-2038                | 19.098.650,66              | 0,85                         |
| 4.000.000,00  | AT&T Inc 4.35% 01-03-2029                       | 4.495.903,72               | 0,20                         | 11.580.000,00      | CVS Health Corp 5.05% 25-03-2048                | 15.193.045,11              | 0,68                         |
| 10.000.000,00   | AT&T Inc 4.5% 15-05-2035                        | 11.556.918,60              | 0,51                         | 5.709.000,00       | Darden Restaurants Inc 4.55% 15-02-2048         | 6.599.936,32               | 0,29                         |
| 4.000.000,00  | AutoNation Inc 3.5% 15-11-2024                  | 4.195.574,36               | 0,19                         | 4.515.000,00       | Dell International LLC / EMC 6.02% 15-06-2026   | 5.217.024,03               | 0,23                         |
| 16.000.000,00   | Bank of America Corp 2.482% MULTI 21-09-2036    | 15.512.411,52              | 0,69                         | 5.640.000,00       | Dell International LLC / EMC 8.1% 15-07-2036    | 8.590.296,86               | 0,38                         |
| 5.855.000,00  | Bank of America Corp 2.496% MULTI 13-02-2031    | 5.879.109,84               | 0,26                         | 10.435.000,00      | Deutsche Bank AG/New Yo 3.729% MULTI 14-01-2032 | 10.676.325,76              | 0,48                         |
| 16.000.000,00   | Bank of America Corp 2.592% MULTI 29-04-2031    | 16.175.247,04              | 0,72                         | 7.000.000,00       | Diamondback Energy Inc 3.125% 24-03-2031        | 7.219.105,95               | 0,32                         |
| 14.455.000,00   | Bank of America Corp 2.676% MULTI 19-06-2041    | 13.882.705,01              | 0,62                         | 5.760.000,00       | Digital Realty Trust LP 3.7% 15-08-2027         | 6.245.430,85               | 0,28                         |
| 10.710.000,00   | Bank of America Corp 3.824% MULTI 20-01-2028    | 11.603.762,14              | 0,52                         | 3.355.000,00       | Duke Realty LP 3.05% 01-03-2050                 | 3.290.600,94               | 0,15                         |
| 8.643.000,00  | Bank of America Corp 3.970% MULTI 05-03-2029    | 9.461.310,86               | 0,42                         | 6.000.000,00       | Ecolab Inc 2.7% 15-12-2051                      | 5.861.079,06               | 0,26                         |
| 5.680.000,00  | Bank of America Corp 4.083% MULTI 20-03-2051    | 6.822.359,44               | 0,30                         | 6.000.000,00       | Equinix Inc 1.8% 15-07-2027                     | 5.905.461,24               | 0,26                         |
| 11.000.000,00   | Bank of America Corp 4.271% MULTI 23-07-2029    | 12.275.855,46              | 0,55                         | 4.390.000,00       | Equinix Inc 2.625% 18-11-2024                   | 4.525.368,15               | 0,20                         |
| 13.120.000,00   | Bank of America Corp 4.300% MULTI Perp FC2025   | 13.267.600,00              | 0,59                         | 5.575.000,00       | Equinix Inc 2.9% 18-11-2026                     | 5.778.402,09               | 0,26                         |
| 4.825.000,00  | Bank of New York Mello 3.750% MULTI Perp FC2026 | 4.843.624,50               | 0,22                         | 3.450.000,00       | Essential Properties LP 2.95% 15-07-2031        | 3.400.867,76               | 0,15                         |
| 11.510.000,00   | Bank of New York Mello 4.700% MULTI Perp FC2025 | 12.278.292,50              | 0,55                         | 5.995.000,00       | Essex Portfolio LP 3.375% 15-04-2026            | 6.360.122,60               | 0,28                         |
| 5.000.000,00  | BAT Capital Corp 2.259% 25-03-2028              | 4.874.847,10               | 0,22                         | 8.520.000,00       | Exelon Corp 4.05% 15-04-2030                    | 9.489.110,13               | 0,42                         |
| 9.680.000,00  | BAT Capital Corp 2.726% 25-03-2031              | 9.401.522,18               | 0,42                         | 14.000.000,00      | Exelon Generation Co LLC 3.25% 01-06-2025       | 14.695.911,16              | 0,65                         |
| 5.860.000,00  | BAT Capital Corp 3.557% 15-08-2027              | 6.149.925,32               | 0,27                         | 8.080.000,00       | Expedia Group Inc 2.95% 15-03-2031              | 8.074.088,03               | 0,36                         |
| 5.675.000,00  | BAT Capital Corp 4.7% 02-04-2027                | 6.246.046,48               | 0,28                         | 2.750.000,00       | Extra Space Storage LP 2.55% 01-06-2031         | 2.708.415,16               | 0,12                         |
| 5.315.000,00  | Becton Dickinson and Co 3.794% 20-05-2050       | 5.980.829,82               | 0,27                         | 10.950.000,00      | FedEx Corp 5.25% 15-05-2050                     | 14.647.232,02              | 0,65                         |
| 7.945.000,00  | Berkshire Hathaway Energy Co 2.85% 15-05-2051   | 7.632.812,19               | 0,34                         | 6.445.000,00       | Flowers Foods Inc 2.4% 15-03-2031               | 6.352.865,37               | 0,28                         |
| 7.995.000,00  | Berry Global Inc 1.57% 15-01-2026               | 7.815.112,50               | 0,35                         |                    |   |                            |                              |
| 4.000.000,00  | BlackRock Inc 2.1% 25-02-2032                   | 3.967.907,16               | 0,18                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - US Corporate Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 6.070.000,00       | General Motors Co 4.2% 01-10-2027               | 6.646.356,27               | 0,30                         | 10.000.000,00      | Morgan Stanley 2.699% MULTI 22-01-2031         | 10.254.123,40              | 0,46                         |
| 4.025.000,00       | General Motors Co 5.2% 01-04-2045               | 4.979.448,53               | 0,22                         | 7.000.000,00       | Morgan Stanley 2.720% MULTI 22-07-2025         | 7.214.904,62               | 0,32                         |
| 6.010.000,00       | General Motors Co 6.125% 01-10-2025             | 6.900.717,52               | 0,31                         | 7.500.000,00       | Morgan Stanley 3.622% MULTI 01-04-2031         | 8.177.743,50               | 0,36                         |
| 14.250.000,00      | General Motors Financial Co 2.4% 10-04-2028     | 14.314.306,12              | 0,64                         | 8.215.000,00       | Morgan Stanley 3.772% MULTI 24-01-2029         | 8.950.588,27               | 0,40                         |
| 11.000.000,00      | Genuine Parts Co 1.875% 01-11-2030              | 10.285.945,89              | 0,46                         | 9.070.000,00       | Morgan Stanley 4.431% MULTI 23-01-2030         | 10.342.340,23              | 0,46                         |
| 4.000.000,00       | Georgia Power Co 2.65% 15-09-2029               | 4.082.061,72               | 0,18                         | 7.630.000,00       | Morgan Stanley 5% 24-11-2025                   | 8.537.729,12               | 0,38                         |
| 9.865.000,00       | Glencore Funding LLC 1.625% 01-09-2025          | 9.767.620,12               | 0,44                         | 7.425.000,00       | National Fuel Gas Co 2.95% 01-03-2031          | 7.440.181,90               | 0,33                         |
| 9.976.000,00       | Global Payments Inc 2.65% 15-02-2025            | 10.256.040,39              | 0,46                         | 8.815.000,00       | National Fuel Gas Co 5.5% 15-01-2026           | 9.869.863,19               | 0,44                         |
| 5.665.000,00       | Global Payments Inc 4.15% 15-08-2049            | 6.461.134,80               | 0,29                         | 6.000.000,00       | NiSource Inc 3.6% 01-05-2030                   | 6.483.109,80               | 0,29                         |
| 20.210.000,00      | Goldman Sachs Group Inc 1.948% MULTI 21-10-2027 | 20.156.555,06              | 0,90                         | 3.400.000,00       | NVIDIA Corp 2% 15-06-2031                      | 3.384.667,77               | 0,15                         |
| 6.420.000,00       | Goldman Sachs Group Inc 2.908% MULTI 21-07-2042 | 6.367.604,58               | 0,28                         | 13.032.000,00      | NVIDIA Corp 3.5% 01-04-2050                    | 14.854.244,10              | 0,66                         |
| 8.830.000,00       | Goldman Sachs Group Inc 3.272% MULTI 29-09-2025 | 9.262.571,37               | 0,41                         | 3.530.000,00       | Office Properties Income Tru 4.5% 01-02-2025   | 3.721.567,17               | 0,17                         |
| 8.000.000,00       | Goldman Sachs Group Inc/The 3.5% 01-04-2025     | 8.466.174,96               | 0,38                         | 7.725.000,00       | Oracle Corp 3.6% 01-04-2050                    | 7.562.940,16               | 0,34                         |
| 5.497.000,00       | Goldman Sachs Group Inc/The 6.75% 01-10-2037    | 7.768.295,92               | 0,35                         | 5.345.000,00       | Oracle Corp 3.85% 01-04-2060                   | 5.277.208,88               | 0,24                         |
| 6.790.000,00       | Hasbro Inc 3% 19-11-2024                        | 7.067.644,19               | 0,31                         | 5.490.000,00       | Oracle Corp 3.9% 15-05-2035                    | 5.878.811,85               | 0,26                         |
| 4.000.000,00       | Hasbro Inc 3.9% 19-11-2029                      | 4.408.236,48               | 0,20                         | 10.000.000,00      | Pacific Gas and Electric Co 2.5% 01-02-2031    | 9.544.918,90               | 0,43                         |
| 3.390.000,00       | Healthcare Trust of America 2% 15-03-2031       | 3.209.820,82               | 0,14                         | 11.070.000,00      | Pacific Gas and Electric Co 3.3% 01-08-2040    | 10.308.704,92              | 0,46                         |
| 9.000.000,00       | Host Hotels & Resorts LP 4.5% 01-02-2026        | 9.700.572,24               | 0,43                         | 9.635.000,00       | Public Storage 1.85% 01-05-2028                | 9.618.346,48               | 0,43                         |
| 13.565.000,00      | Howmet Aerospace Inc 3% 15-01-2029              | 13.548.043,75              | 0,60                         | 5.775.000,00       | PulteGroup Inc 5% 15-01-2027                   | 6.559.245,00               | 0,29                         |
| 214.000,00         | Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-05-2025          | 246.042,40                 | 0,01                         | 9.115.000,00       | QVC Inc 4.375% 01-09-2028                      | 9.046.637,50               | 0,40                         |
| 6.250.000,00       | HP Inc 2.65% 17-06-2031                         | 6.170.859,94               | 0,27                         | 6.000.000,00       | Ralph Lauren Corp 2.95% 15-06-2030             | 6.257.811,60               | 0,28                         |
| 10.000.000,00      | HP Inc 3% 17-06-2027                            | 10.522.311,40              | 0,47                         | 2.300.000,00       | Reliance Steel & Aluminum Co 2.15% 15-08-2030  | 2.236.628,79               | 0,10                         |
| 3.580.000,00       | IDEX Corp 2.625% 15-06-2031                     | 3.602.194,17               | 0,16                         | 5.205.000,00       | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 01-03-2025 | 5.776.046,28               | 0,26                         |
| 8.340.000,00       | Invitation Homes Operating P 2% 15-08-2031      | 7.850.976,01               | 0,35                         | 6.560.000,00       | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15-05-2024  | 7.135.465,18               | 0,32                         |
| 7.775.000,00       | JetBlue 2019-1 Class AA Pass 2.75% 15-05-2032   | 7.161.244,73               | 0,32                         | 7.000.000,00       | Service Corp International/U 3.375% 15-08-2030 | 6.878.550,00               | 0,31                         |
| 9.000.000,00       | JPMorgan Chase & Co 2.083% MULTI 22-04-2026     | 9.138.070,17               | 0,41                         | 3.790.000,00       | Sherwin-Williams Co/The 2.9% 15-03-2052        | 3.705.086,83               | 0,17                         |
| 6.405.000,00       | JPMorgan Chase & Co 2.956% MULTI 13-05-2031     | 6.636.637,21               | 0,30                         | 6.770.000,00       | Southern California Edison C 4% 01-04-2047     | 7.464.972,18               | 0,33                         |
| 13.080.000,00      | JPMorgan Chase & Co 3.109% MULTI 22-04-2051     | 13.512.111,27              | 0,60                         | 2.995.000,00       | Starbucks Corp 3.5% 15-11-2050                 | 3.224.616,41               | 0,14                         |
| 8.255.000,00       | JPMorgan Chase & Co 3.2% 15-06-2026             | 8.757.743,78               | 0,39                         | 7.885.000,00       | Sysco Corp 3.3% 15-02-2050                     | 7.983.637,96               | 0,36                         |
| 7.504.000,00       | JPMorgan Chase & Co 3.509% MULTI 23-01-2029     | 8.042.374,86               | 0,36                         | 8.520.000,00       | T-Mobile USA Inc 3.5% 15-04-2025               | 9.034.745,77               | 0,40                         |
| 4.800.000,00       | JPMorgan Chase & Co 3.702% MULTI 06-05-2030     | 5.249.227,25               | 0,23                         | 10.930.000,00      | T-Mobile USA Inc 3.75% 15-04-2027              | 11.838.349,45              | 0,53                         |
| 3.780.000,00       | JPMorgan Chase & Co 3.782% MULTI 01-02-2028     | 4.094.162,76               | 0,18                         | 8.490.000,00       | T-Mobile USA Inc 4.375% 15-04-2040             | 9.685.820,32               | 0,43                         |
| 10.664.000,00      | JPMorgan Chase & Co 3.960% MULTI 29-01-2027     | 11.527.321,82              | 0,51                         | 5.060.000,00       | T-Mobile USA Inc 4.5% 15-04-2050               | 5.921.560,38               | 0,26                         |
| 6.500.000,00       | JPMorgan Chase & Co 4.600% MULTI Perp FC2025    | 6.670.625,00               | 0,30                         | 10.000.000,00      | Truist Financial Corp 4.950% MULTI Perp FC2025 | 10.728.918,00              | 0,48                         |
| 5.650.000,00       | Kilroy Realty LP 3.45% 15-12-2024               | 5.915.555,99               | 0,26                         | 6.000.000,00       | United Rentals North America 3.875% 15-02-2031 | 6.082.500,00               | 0,27                         |
| 10.230.000,00      | Kinder Morgan Inc 5.2% 01-03-2048               | 12.696.297,30              | 0,57                         | 8.980.000,00       | United Rentals North America 3.875% 15-11-2027 | 9.304.963,75               | 0,41                         |
| 5.545.000,00       | Kohl's Corp 5.55% 17-07-2045                    | 6.464.737,95               | 0,29                         | 20.785.000,00      | United States Treasury Note/ 2% 15-11-2041     | 20.966.868,75              | 0,93                         |
| 11.215.000,00      | Kraft Heinz Foods Co 5% 15-07-2035              | 13.722.140,95              | 0,61                         | 33.890.000,00      | United States Treasury Note/ 2.375% 15-05-2051 | 37.432.564,06              | 1,67                         |
| 4.915.000,00       | Las Vegas Sands Corp 3.2% 08-08-2024            | 5.004.895,50               | 0,22                         | 16.430.000,00      | Verizon Communications Inc 2.65% 20-11-2040    | 15.558.887,97              | 0,69                         |
| 8.605.000,00       | Lennar Corp 4.75% 29-11-2027                    | 9.747.141,65               | 0,43                         | 11.000.000,00      | Verizon Communications Inc 4.329% 21-09-2028   | 12.500.496,69              | 0,56                         |
| 1.541.000,00       | Marriott International Inc/M 5.75% 01-05-2025   | 1.735.212,80               | 0,08                         | 7.541.000,00       | Verizon Communications Inc 4.4% 01-11-2034     | 8.792.525,10               | 0,39                         |
| 7.960.000,00       | McDonald's Corp 2.625% 01-09-2029               | 8.216.622,84               | 0,37                         | 8.000.000,00       | Virginia Electric and Power 2.45% 15-12-2050   | 7.364.656,64               | 0,33                         |
| 3.580.000,00       | McDonald's Corp 3.625% 01-09-2049               | 3.950.775,16               | 0,18                         | 9.090.000,00       | Walt Disney Co/The 3.8% 13-05-2060             | 10.528.886,82              | 0,47                         |
| 6.720.000,00       | Microsoft Corp 2.675% 01-06-2060                | 6.709.718,94               | 0,30                         | 10.000.000,00      | Waste Connections Inc 3.5% 01-05-2029          | 10.820.378,50              | 0,48                         |
| 8.050.000,00       | Mid-America Apartments LP 3.95% 15-03-2029      | 8.992.457,29               | 0,40                         | 10.000.000,00      | Wells Fargo & Co 2.879% MULTI 30-10-2030       | 10.417.402,90              | 0,46                         |
| 10.000.000,00      | Morgan Stanley 2.484% MULTI 16-09-2036          | 9.606.061,50               | 0,43                         | 7.130.000,00       | Wells Fargo & Co 3% 22-04-2026                 | 7.491.812,14               | 0,33                         |
|                    |   |                            |                              | 8.870.000,00       | Wells Fargo & Co 3.068% MULTI 30-04-2041       | 9.075.939,14               | 0,40                         |
|                    |   |                            |                              | 12.000.000,00      | Wells Fargo & Co 3.196% MULTI 17-06-2027       | 12.656.520,00              | 0,56                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US Corporate Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 20.000.000,00      | Wells Fargo & Co 3.584% MULTI<br>22-05-2028   | 21.514.391,60              | 0,96                         | 7.765.000,00       | International Flavors & Frag<br>3.268% 15-11-2040   | 7.868.349,35               | 0,35                         |
| 9.420.000,00       | Wells Fargo & Co 4.1% 03-06-2026  | 10.225.450,69              | 0,46                         | 6.316.000,00       | International Game Technolog<br>5.25% 15-01-2029  | 6.702.223,40               | 0,30                         |
|                    |   | <b>1.651.561.767,87</b>    | <b>73,58</b>                 | 7.070.000,00       | Iron Mountain Inc 4.5% 15-02-2031   | 7.145.578,30               | 0,32                         |
|                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>1.651.561.767,87</b>    | <b>73,58</b>                 | 4.000.000,00       | Jackson Financial Inc 1.125%<br>22-11-2023  | 3.993.062,60               | 0,18                         |
|                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>1.651.561.767,87</b>    | <b>73,58</b>                 | 8.790.000,00       | Level 3 Financing Inc 3.4% 01-03-2027   | 9.075.235,68               | 0,40                         |
|                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              | 6.000.000,00       | Level 3 Financing Inc 3.75%<br>15-07-2029   | 5.700.000,00               | 0,25                         |
|                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              | 7.135.000,00       | Lumen Technologies Inc 4%<br>15-02-2027   | 7.238.814,25               | 0,32                         |
|                    | <b>USD</b>  |                            |                              | 7.000.000,00       | Match Group Holdings II LLC<br>4.125% 01-08-2030  | 7.069.999,93               | 0,31                         |
| 6.380.000,00       | AbbVie Inc 3.85% 15-06-2024   | 6.753.853,33               | 0,30                         | 12.640.000,00      | Mattel Inc 3.75% 01-04-2029   | 13.098.200,00              | 0,58                         |
| 12.050.000,00      | Alaska Airlines 2020-1 Class 4.8%<br>15-08-2027   | 12.131.995,29              | 0,54                         | 12.935.000,00      | Mileage Plus Holdings LLC / 6.5%<br>20-06-2027  | 13.808.112,50              | 0,62                         |
| 8.000.000,00       | Alcon Finance Corp 2.6% 27-05-2030  | 8.079.340,16               | 0,36                         | 12.460.000,00      | Monongahela Power Co 4.1%<br>15-04-2024   | 13.128.141,08              | 0,58                         |
| 6.000.000,00       | American Airlines 2017-2 Cla<br>3.35% 15-10-2029  | 4.944.724,22               | 0,22                         | 7.000.000,00       | Murphy Oil USA Inc 3.75% 15-02-2031   | 6.930.000,00               | 0,31                         |
| 11.850.000,00      | American Airlines Inc/AAadvan<br>5.75% 20-04-2029   | 12.620.250,00              | 0,56                         | 8.860.000,00       | NGPL PipeCo LLC 7.768% 15-12-2037   | 12.383.938,04              | 0,55                         |
| 6.525.000,00       | Aviation Capital Group LLC 1.95%<br>30-01-2026  | 6.344.092,87               | 0,28                         | 8.393.000,00       | Nordstrom Inc 4.25% 01-08-2031  | 8.246.122,50               | 0,37                         |
| 2.015.000,00       | Aviation Capital Group LLC 3.5%<br>01-11-2027   | 2.066.924,39               | 0,09                         | 11.680.000,00      | NYU Langone Hospitals 3.38%<br>01-07-2055   | 11.983.357,75              | 0,53                         |
| 4.000.000,00       | Aviation Capital Group LLC 5.5%<br>15-12-2024   | 4.376.889,84               | 0,19                         | 4.700.000,00       | Oncor Electric Delivery Co L 2.7%<br>15-11-2051   | 4.519.823,71               | 0,20                         |
| 6.935.000,00       | Berkshire Hathaway Energy Co<br>4.25% 15-10-2050  | 8.493.531,47               | 0,38                         | 7.490.000,00       | Peachtree Corners Funding Tr<br>3.976% 15-02-2025   | 7.981.259,14               | 0,36                         |
| 5.470.000,00       | Broadcom Inc 3.5% 15-02-2041  | 5.600.894,80               | 0,25                         | 11.500.000,00      | Phillips Edison Grocery Cent<br>2.625% 15-11-2031   | 11.192.014,13              | 0,50                         |
| 3.000.000,00       | CDW LLC / CDW Finance Corp<br>3.25% 15-02-2029  | 3.027.870,00               | 0,13                         | 14.195.000,00      | Plains All American Pipeline 3.8%<br>15-09-2030   | 14.834.086,86              | 0,66                         |
| 6.115.000,00       | Cheniere Energy Partners LP 4.5%<br>01-10-2029  | 6.481.900,00               | 0,29                         | 1.000,00           | Protective Life Corp 8.45% 15-10-2039   | 1.589,36                   | 0,00                         |
| 9.890.000,00       | CIT Bank NA 2.969% MULTI<br>27-09-2025  | 10.186.700,00              | 0,45                         | 6.000.000,00       | Reliance Standard Life Globa 2.5%<br>30-10-2024   | 6.171.992,10               | 0,27                         |
| 5.000.000,00       | Clearway Energy Operating LL<br>3.75% 15-01-2032  | 4.962.500,00               | 0,22                         | 8.595.000,00       | Rocket Mortgage LLC / Rocket<br>3.625% 01-03-2029   | 8.627.231,25               | 0,38                         |
| 1.385.000,00       | Clearway Energy Operating LL<br>3.75% 15-02-2031  | 1.386.329,60               | 0,06                         | 7.455.000,00       | Service Properties Trust 7.5%<br>15-09-2025   | 8.080.246,08               | 0,36                         |
| 3.500.000,00       | Clearway Energy Operating LL<br>4.75% 15-03-2028  | 3.679.375,00               | 0,16                         | 11.535.000,00      | Silgan Holdings Inc 1.4% 01-04-2026   | 11.253.084,60              | 0,50                         |
| 7.925.000,00       | CyrusOne LP / CyrusOne Finan<br>2.9% 15-11-2024   | 8.180.264,25               | 0,36                         | 9.795.000,00       | Smithfield Foods Inc 3% 15-10-2030  | 9.762.588,54               | 0,43                         |
| 4.500.000,00       | Dell International LLC / EMC 4%<br>15-07-2024   | 4.775.847,03               | 0,21                         | 3.170.000,00       | Sunoco LP / Sunoco Finance C<br>4.5% 15-05-2029   | 3.219.214,25               | 0,14                         |
| 8.965.000,00       | Dell International LLC / EMC 4.9%<br>01-10-2026   | 10.103.001,77              | 0,45                         | 10.830.000,00      | Targa Resources Partners LP<br>5.5% 01-03-2030  | 11.831.775,00              | 0,53                         |
| 5.540.000,00       | Delta Air Lines Inc / SkyMil 4.75%<br>20-10-2028  | 6.052.928,88               | 0,27                         | 9.000.000,00       | Trans-Allegheny Interstate L<br>3.85% 01-06-2025  | 9.534.258,09               | 0,42                         |
| 7.495.000,00       | Delta Air Lines Inc 7% 01-05-2025   | 8.573.256,33               | 0,38                         | 5.720.000,00       | United Airlines 2020-1 Class<br>4.875% 15-01-2026   | 5.347.752,95               | 0,24                         |
| 7.510.000,00       | Dominion Energy Inc 4.650%<br>MULTI Perp FC2024   | 7.829.175,00               | 0,35                         | 5.340.000,00       | Venture Global Calcasieu Pas<br>3.875% 15-08-2029   | 5.553.600,00               | 0,25                         |
| 7.250.000,00       | East Ohio Gas Co/The 3% 15-06-2050  | 7.155.143,97               | 0,32                         | 9.975.000,00       | Venture Global Calcasieu Pas<br>4.125% 15-08-2031   | 10.648.312,50              | 0,47                         |
| 7.505.000,00       | Edgewell Personal Care Co 5.5%<br>01-06-2028  | 7.936.537,50               | 0,35                         | 7.274.000,00       | Verizon Communications Inc<br>2.355% 15-03-2032   | 7.183.628,77               | 0,32                         |
| 10.000.000,00      | EQM Midstream Partners LP 4.5%<br>15-01-2029  | 10.300.000,00              | 0,46                         | 6.000.000,00       | Viatis Inc 3.85% 22-06-2040   | 6.341.037,66               | 0,28                         |
| 6.250.000,00       | Equitable Financial Life Glo 1.8%<br>08-03-2028   | 6.150.209,06               | 0,27                         | 8.000.000,00       | Vontier Corp 1.8% 01-04-2026  | 7.872.800,00               | 0,35                         |
| 3.975.000,00       | Fair Isaac Corp 4% 15-06-2028   | 4.078.588,50               | 0,18                         | 6.000.000,00       | Vontier Corp 2.95% 01-04-2031   | 5.943.300,00               | 0,26                         |
| 9.570.000,00       | GA Global Funding Trust 1.625%<br>15-01-2026  | 9.495.214,66               | 0,42                         | 11.233.000,00      | Willis North America Inc 3.875%<br>15-09-2049   | 12.187.452,62              | 0,54                         |
| 6.000.000,00       | GLP Capital LP / GLP Financi 4%<br>15-01-2030   | 6.348.275,10               | 0,28                         | 2.500.000,00       | WGM Acquisition Corp 3.75%<br>01-12-2029  | 2.493.750,00               | 0,11                         |
| 4.325.000,00       | Group 1 Automotive Inc 4% 15-08-2028  | 4.308.781,25               | 0,19                         |                    |   | <b>543.999.644,55</b>      | <b>24,24</b>                 |
| 6.710.000,00       | GXO Logistics Inc 2.65% 15-07-2031  | 6.627.198,60               | 0,30                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>543.999.644,55</b>      | <b>24,24</b>                 |
| 8.435.000,00       | Health Care Service Corp A M<br>3.2% 01-06-2050   | 8.593.787,44               | 0,38                         |                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>543.999.644,55</b>      | <b>24,24</b>                 |
| 6.070.000,00       | Hess Midstream Operations LP<br>4.25% 15-02-2030  | 6.024.475,00               | 0,27                         |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>2.195.561.412,42</b>    | <b>97,81</b>                 |
| 6.585.000,00       | Hilcorp Energy I LP / Hilcor 5.75%<br>01-02-2029  | 6.757.856,25               | 0,30                         |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>33.935.963,97</b>       | <b>1,51</b>                  |
| 8.620.000,00       | Hologic Inc 3.25% 15-02-2029  | 8.620.000,00               | 0,38                         |                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>15.115.305,66</b>       | <b>0,67</b>                  |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>2.244.612.682,05</b>    | <b>100,00</b>                |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US Corporate Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| USA                    | 95,73        | Unternehmensanleihen | 95,21        |
| Länderübergreifend     | 0,83         | Staatsanleihen       | 2,60         |
| Kanada                 | 0,48         |                      |              |
| Deutschland            | 0,48         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich | 0,30         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>97,81</b> | <b>Summe</b>         | <b>97,81</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - US Corporate Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 9.484.424,00                                      | CHF               | 10.188.725,22      | USD                | 218.847,63   | 28.01.2022 |
| 496.480.839,99                                    | EUR               | 559.298.911,05     | USD                | 3.351.418,31   | 28.01.2022 |
| 3.785.793,18                                      | GBP               | 5.057.366,55       | USD                | 46.738,29  | 28.01.2022 |
| 1.810.836.046,59                                  | NOK               | 202.216.137,83     | USD                | 3.114.581,36   | 28.01.2022 |
| 1.994.391,22                                      | PLN               | 474.602,17         | USD                | 15.962,40  | 28.01.2022 |
| 5.830.065.564,79                                  | SEK               | 648.387.645,66     | USD                | (4.126.937,73)   | 28.01.2022 |
| 1.219.551,68                                      | USD               | 1.135.013,28       | CHF                | (25.936,03)  | 28.01.2022 |
| 14.236.580,75                                     | USD               | 12.603.628,45      | EUR                | (46.823,38)  | 28.01.2022 |
| 170.096,05  | USD               | 128.221,00         | GBP                | (2.774,80)   | 28.01.2022 |
| 4.353.956,59                                      | USD               | 39.078.791,20      | NOK                | (77.187,57)  | 28.01.2022 |
| 10.767,43   | USD               | 44.621,84          | PLN                | (208,30)   | 28.01.2022 |
| 14.422.731,76                                     | USD               | 130.621.165,91     | SEK                | (11.764,62)  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>2.455.915,56</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/ Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (USD) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/ (-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (USD) |
|--|------------|---------|--------------------------------|--------------------------|--|---|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                |                          |  |   |
| US 10yr Ultra Fut 3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (948,00)                       | (138.985.687,50)         | (162.937,50)   | (1.407.187,50)  |
| US 2YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | 1.290,00                       | 281.502.195,24           | 60.475,20  | (312.422,52)  |
| US 5YR NOTE (CBT) 3/2022               | 05.04.2022 | USD     | (1.268,00)                     | (153.457.713,04)         | (59.431,16)  | (287.280,62)  |
| US LONG BOND (CBT) 3/2022              | 31.03.2022 | USD     | 328,00                         | 52.541.500,00            | 102.500,00   | 194.750,00  |
| US ULTRA BOND CBT 3/2022               | 31.03.2022 | USD     | 228,00                         | 45.072.750,00            | 128.250,00   | 99.750,00   |
|  |            |         |                                |                          | <b>68.856,54</b>   | <b>(1.712.390,64)</b>   |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 3.795.000,00  | Abbott Laboratories 4.75% 30-11-2036           | 4.847.455,78               | 0,32                         | 1.000.000,00       | Bank of America Corp 3.864% MULTI 23-07-2024    | 1.041.956,18               | 0,07                         |
| 915.000,00  | AbbVie Inc 2.6% 21-11-2024                     | 948.657,55                 | 0,06                         | 1.000.000,00       | Bank of America Corp 3.970% MULTI 05-03-2029    | 1.094.679,03               | 0,07                         |
| 400.000,00  | AbbVie Inc 2.85% 14-05-2023                    | 408.868,47                 | 0,03                         | 810.000,00         | Bank of America Corp 4.083% MULTI 20-03-2051    | 972.906,89                 | 0,07                         |
| 2.415.000,00  | AbbVie Inc 2.95% 21-11-2026                    | 2.543.453,85               | 0,17                         | 1.100.000,00       | Bank of America Corp 4.271% MULTI 23-07-2029    | 1.227.585,55               | 0,08                         |
| 7.500.000,00  | AbbVie Inc 3.2% 21-11-2029                     | 8.027.301,15               | 0,54                         | 4.210.000,00       | Bank of America Corp 4.300% MULTI Perp FC2025   | 4.257.362,50               | 0,29                         |
| 1.500.000,00  | AbbVie Inc 3.8% 15-03-2025                     | 1.597.229,97               | 0,11                         | 5.000.000,00       | Bank of New York Mello 4.700% MULTI Perp FC2025 | 5.333.750,00               | 0,36                         |
| 10.405.000,00   | AbbVie Inc 4.05% 21-11-2039                    | 11.925.256,03              | 0,80                         | 3.040.000,00       | Becton Dickinson and Co 2.823% 20-05-2030       | 3.148.967,58               | 0,21                         |
| 3.500.000,00  | Advance Auto Parts Inc 1.75% 01-10-2027        | 3.398.820,92               | 0,23                         | 3.185.000,00       | Becton Dickinson and Co 3.794% 20-05-2050       | 3.583.996,80               | 0,24                         |
| 7.385.000,00  | Alexandria Real Estate Equit 1.875% 01-02-2033 | 6.934.481,10               | 0,46                         | 7.623.000,00       | Berry Global Inc 1.57% 15-01-2026               | 7.451.482,50               | 0,50                         |
| 3.000.000,00  | Amazon.com Inc 4.95% 05-12-2044                | 4.084.857,81               | 0,27                         | 3.075.000,00       | BlackRock Inc 2.1% 25-02-2032                   | 3.050.328,63               | 0,20                         |
| 5.110.000,00  | American Assets Trust LP 3.375% 01-02-2031     | 5.220.382,44               | 0,35                         | 3.015.000,00       | Boston Properties LP 2.55% 01-04-2032           | 2.995.225,61               | 0,20                         |
| 2.000.000,00  | American International Group 4.375% 30-06-2050 | 2.481.273,88               | 0,17                         | 775.000,00         | Boston Properties LP 3.2% 15-01-2025            | 811.680,71                 | 0,05                         |
| 3.055.000,00  | American International Group 4.5% 16-07-2044   | 3.741.968,01               | 0,25                         | 3.500.000,00       | Bristol-Myers Squibb Co 3.2% 15-06-2026         | 3.765.444,94               | 0,25                         |
| 5.340.000,00  | American Tower Corp 1.5% 31-01-2028            | 5.112.322,05               | 0,34                         | 3.050.000,00       | Broadcom Inc 5% 15-04-2030                      | 3.551.783,32               | 0,24                         |
| 5.180.000,00  | American Tower Corp 2.75% 15-01-2027           | 5.341.714,73               | 0,36                         | 5.000.000,00       | Broadstone Net Lease LLC 2.6% 15-09-2031        | 4.856.571,20               | 0,33                         |
| 7.500.000,00  | American Tower Corp 2.95% 15-01-2051           | 7.082.162,25               | 0,47                         | 2.000.000,00       | Brown & Brown Inc 2.375% 15-03-2031             | 1.949.399,92               | 0,13                         |
| 390.000,00  | American Tower Corp 3.375% 15-05-2024          | 407.411,05                 | 0,03                         | 1.185.000,00       | Camden Property Trust 3.15% 01-07-2029          | 1.260.936,25               | 0,08                         |
| 630.000,00  | American Tower Corp 4.4% 15-02-2026            | 687.821,68                 | 0,05                         | 6.935.000,00       | Caterpillar Inc 3.25% 09-04-2050                | 7.660.911,90               | 0,51                         |
| 4.000.000,00  | American Water Capital Corp 2.8% 01-05-2030    | 4.161.176,12               | 0,28                         | 2.000.000,00       | Charles Schwab Corp/Th 4.000% MULTI Perp FC2026 | 2.040.000,00               | 0,14                         |
| 5.520.000,00  | American Water Capital Corp 3.45% 01-05-2050   | 5.914.776,66               | 0,40                         | 4.840.000,00       | Charles Schwab Corp/Th 5.375% MULTI Perp FC2025 | 5.275.600,00               | 0,35                         |
| 2.310.000,00  | Anthem Inc 2.375% 15-01-2025                   | 2.381.670,61               | 0,16                         | 3.480.000,00       | Charter Communications Opera 2.25% 15-01-2029   | 3.397.313,36               | 0,23                         |
| 2.250.000,00  | Anthem Inc 4.375% 01-12-2047                   | 2.740.768,31               | 0,18                         | 6.215.000,00       | Charter Communications Opera 2.8% 01-04-2031    | 6.146.895,47               | 0,41                         |
| 2.000.000,00  | Apple Inc 3% 20-06-2027                        | 2.143.929,34               | 0,14                         | 3.765.000,00       | Charter Communications Opera 3.7% 01-04-2051    | 3.639.513,91               | 0,24                         |
| 3.000.000,00  | Apple Inc 3.2% 13-05-2025                      | 3.193.260,66               | 0,21                         | 2.795.000,00       | Charter Communications Opera 3.75% 15-02-2028   | 2.995.600,62               | 0,20                         |
| 3.850.000,00  | Apple Inc 3.85% 04-05-2043                     | 4.522.668,54               | 0,30                         | 5.110.000,00       | Choice Hotels International 3.7% 15-01-2031     | 5.429.763,36               | 0,36                         |
| 4.250.000,00  | Ashtead Capital Inc 4% 01-05-2028              | 4.443.057,65               | 0,30                         | 5.000.000,00       | Cigna Corp 4.125% 15-11-2025                    | 5.469.096,00               | 0,37                         |
| 2.151.000,00  | Assurant Inc 3.7% 22-02-2030                   | 2.282.537,18               | 0,15                         | 1.450.000,00       | CIT Group Inc 5.25% 07-03-2025                  | 1.593.187,50               | 0,11                         |
| 1.825.000,00  | AT&T Inc 1.65% 01-02-2028                      | 1.783.593,94               | 0,12                         | 4.000.000,00       | Citigroup Inc 1.281% MULTI 03-11-2025           | 3.987.241,44               | 0,27                         |
| 5.365.000,00  | AT&T Inc 1.7% 25-03-2026                       | 5.339.787,29               | 0,36                         | 5.000.000,00       | Citigroup Inc 2.561% MULTI 01-05-2032           | 5.027.944,25               | 0,34                         |
| 3.005.000,00  | AT&T Inc 2.3% 01-06-2027                       | 3.058.883,74               | 0,20                         | 2.235.000,00       | Citigroup Inc 3.106% MULTI 08-04-2026           | 2.343.969,26               | 0,16                         |
| 1.900.000,00  | AT&T Inc 3.5% 01-06-2041                       | 1.952.429,80               | 0,13                         | 6.225.000,00       | Citigroup Inc 3.4% 01-05-2026                   | 6.685.068,71               | 0,45                         |
| 2.147.000,00  | AT&T Inc 3.5% 15-09-2023                       | 2.164.205,99               | 0,14                         | 7.000.000,00       | Citigroup Inc 3.520% MULTI 27-10-2028           | 7.509.198,90               | 0,50                         |
| 6.555.000,00  | AT&T Inc 4.3% 15-02-2030                       | 7.382.731,45               | 0,49                         | 1.715.000,00       | Citigroup Inc 3.875% MULTI Perp FC2026          | 1.715.000,00               | 0,11                         |
| 6.150.000,00  | AT&T Inc 4.35% 01-03-2029                      | 6.912.451,97               | 0,46                         | 3.600.000,00       | Citigroup Inc 4.000% MULTI Perp FC2025          | 3.627.000,00               | 0,24                         |
| 7.848.000,00  | AT&T Inc 4.5% 15-05-2035                       | 9.069.869,72               | 0,61                         | 5.000.000,00       | Citigroup Inc 4.150% MULTI Perp FC2026          | 5.081.250,00               | 0,34                         |
| 11.000.000,00   | AvalonBay Communities Inc 2.05% 15-01-2032     | 10.884.974,87              | 0,73                         | 1.610.000,00       | Citigroup Inc 4.700% MULTI Perp FC2025          | 1.626.422,00               | 0,11                         |
| 3.045.000,00  | Bank of America Corp 0.981% MULTI 25-09-2025   | 3.008.675,59               | 0,20                         | 3.887.000,00       | Citigroup Inc 5.950% MULTI Perp FC2023          | 4.003.610,00               | 0,27                         |
| 1.715.000,00  | Bank of America Corp 1.319% MULTI 19-06-2026   | 1.697.443,00               | 0,11                         | 905.000,00         | CNA Financial Corp 4.5% 01-03-2026              | 998.994,46                 | 0,07                         |
| 2.750.000,00  | Bank of America Corp 1.734% MULTI 22-07-2027   | 2.731.113,72               | 0,18                         | 1.475.000,00       | CNH Industrial Capital LLC 1.95% 02-07-2023     | 1.494.327,46               | 0,10                         |
| 8.500.000,00  | Bank of America Corp 2.482% MULTI 21-09-2036   | 8.240.968,62               | 0,55                         | 790.000,00         | CNH Industrial Capital LLC 4.375% 05-04-2022    | 797.049,17                 | 0,05                         |
| 9.250.000,00  | Bank of America Corp 2.496% MULTI 13-02-2031   | 9.288.089,84               | 0,62                         | 10.800.000,00      | Comcast Corp 3.25% 01-11-2039                   | 11.370.079,84              | 0,76                         |
| 7.000.000,00  | Bank of America Corp 2.572% MULTI 20-10-2032   | 7.036.270,22               | 0,47                         | 4.800.000,00       | Comcast Corp 3.75% 01-04-2040                   | 5.362.319,23               | 0,36                         |
| 7.415.000,00  | Bank of America Corp 2.592% MULTI 29-04-2031   | 7.496.216,05               | 0,50                         | 3.620.000,00       | Comcast Corp 3.95% 15-10-2025                   | 3.953.608,96               | 0,26                         |
| 8.910.000,00  | Bank of America Corp 2.676% MULTI 19-06-2041   | 8.557.239,82               | 0,57                         | 5.295.000,00       | Conagra Brands Inc 1.375% 01-11-2027            | 5.060.076,10               | 0,34                         |
| 1.000.000,00  | Bank of America Corp 3.194% MULTI 23-07-2030   | 1.055.320,60               | 0,07                         | 4.455.000,00       | Connecticut Light and Power 4% 01-04-2048       | 5.348.667,83               | 0,36                         |
| 750.000,00  | Bank of America Corp 3.419% MULTI 20-12-2028   | 802.159,23                 | 0,05                         | 7.550.000,00       | Crown Castle International C 1.05% 15-07-2026   | 7.294.831,29               | 0,49                         |
| 375.000,00  | Bank of America Corp 3.705% MULTI 24-04-2028   | 406.031,58                 | 0,03                         |                    |   |                            |                              |
| 1.035.000,00  | Bank of America Corp 3.824% MULTI 20-01-2028   | 1.121.371,97               | 0,08                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                       | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 2.200.000,00       | Crown Castle International C<br>4.15% 01-07-2050   | 2.473.650,21               | 0,17                         | 3.135.000,00       | Goldman Sachs Group Inc 2.908%<br>MULTI 21-07-2042 | 3.109.414,39               | 0,21                         |
| 2.900.000,00       | CVS Health Corp 1.3% 21-08-2027                    | 2.813.072,73               | 0,19                         | 3.300.000,00       | Goldman Sachs Group Inc 3.272%<br>MULTI 29-09-2025 | 3.461.663,14               | 0,23                         |
| 3.540.000,00       | CVS Health Corp 2.7% 21-08-2040                    | 3.401.673,47               | 0,23                         | 4.450.000,00       | Goldman Sachs Group Inc/The<br>1.217% 06-12-2023   | 4.459.171,72               | 0,30                         |
| 800.000,00         | CVS Health Corp 3.375% 12-08-<br>2024              | 840.908,76                 | 0,06                         | 1.350.000,00       | Goldman Sachs Group Inc/The<br>3.5% 01-04-2025     | 1.428.667,02               | 0,10                         |
| 1.057.000,00       | CVS Health Corp 4.3% 25-03-2028                    | 1.186.427,80               | 0,08                         | 265.000,00         | Goldman Sachs Group Inc/The<br>3.625% 20-02-2024   | 278.044,63                 | 0,02                         |
| 5.000.000,00       | CVS Health Corp 4.78% 25-03-<br>2038               | 6.090.130,95               | 0,41                         | 1.997.000,00       | Goldman Sachs Group Inc/The<br>6.75% 01-10-2037    | 2.822.136,98               | 0,19                         |
| 5.475.000,00       | CVS Health Corp 5.05% 25-03-<br>2048               | 7.183.240,24               | 0,48                         | 2.055.000,00       | Hasbro Inc 3% 19-11-2024                           | 2.139.029,28               | 0,14                         |
| 515.000,00         | CVS Health Corp 5.125% 20-07-<br>2045              | 669.362,33                 | 0,04                         | 3.910.000,00       | Hasbro Inc 3.9% 19-11-2029                         | 4.309.051,16               | 0,29                         |
| 3.500.000,00       | Deere & Co 3.9% 09-06-2042                         | 4.146.486,72               | 0,28                         | 4.545.000,00       | Healthcare Trust of America 2%<br>15-03-2031       | 4.303.432,34               | 0,29                         |
| 2.417.000,00       | Dell International LLC / EMC<br>6.02% 15-06-2026   | 2.792.812,20               | 0,19                         | 3.875.000,00       | Healthpeak Properties Inc 2.125%<br>01-12-2028     | 3.883.237,05               | 0,26                         |
| 2.302.000,00       | Dell International LLC / EMC 8.1%<br>15-07-2036    | 3.506.181,45               | 0,23                         | 4.300.000,00       | Home Depot Inc/The 3.3% 15-<br>04-2040             | 4.651.773,37               | 0,31                         |
| 436.000,00         | Dell International LLC / EMC<br>8.35% 15-07-2046   | 724.455,02                 | 0,05                         | 500.000,00         | Home Depot Inc/The 3.9% 06-<br>12-2028             | 563.321,05                 | 0,04                         |
| 4.910.000,00       | Deutsche Bank AG/New Yo<br>3.729% MULTI 14-01-2032 | 5.023.551,46               | 0,34                         | 2.475.000,00       | Home Depot Inc/The 4.4% 15-<br>03-2045             | 3.088.318,56               | 0,21                         |
| 3.295.000,00       | Deutsche Bank AG/New York NY<br>1.686% 19-03-2026  | 3.283.040,63               | 0,22                         | 4.250.000,00       | HP Inc 2.65% 17-06-2031                            | 4.196.184,76               | 0,28                         |
| 3.640.000,00       | Digital Realty Trust LP 3.6%<br>01-07-2029         | 3.942.405,92               | 0,26                         | 5.565.000,00       | HP Inc 3% 17-06-2027                               | 5.855.666,29               | 0,39                         |
| 1.000.000,00       | Digital Realty Trust LP 3.7%<br>15-08-2027         | 1.084.276,19               | 0,07                         | 2.635.000,00       | Hyatt Hotels Corp 5.375% 23-<br>04-2025            | 2.921.774,59               | 0,20                         |
| 3.750.000,00       | Dow Chemical Co/The 4.375%<br>15-11-2042           | 4.418.782,39               | 0,30                         | 1.425.000,00       | IDEX Corp 2.625% 15-06-2031                        | 1.433.834,27               | 0,10                         |
| 1.020.000,00       | Duke Realty LP 2.875% 15-11-2029                   | 1.060.518,45               | 0,07                         | 5.045.000,00       | Invitation Homes Operating P 2%<br>15-08-2031      | 4.749.181,53               | 0,32                         |
| 1.760.000,00       | Duke Realty LP 3.05% 01-03-2050                    | 1.726.216,89               | 0,12                         | 5.055.000,00       | Johnson Controls Internation<br>1.75% 15-09-2030   | 4.841.842,18               | 0,32                         |
| 1.845.000,00       | Duke Realty LP 3.75% 01-12-2024                    | 1.956.370,79               | 0,13                         | 3.145.000,00       | JPMorgan Chase & Co 1.514%<br>MULTI 01-06-2024     | 3.169.149,67               | 0,21                         |
| 4.000.000,00       | Ecolab Inc 2.7% 15-12-2051                         | 3.907.386,04               | 0,26                         | 6.425.000,00       | JPMorgan Chase & Co 2.083%<br>MULTI 22-04-2026     | 6.523.566,76               | 0,44                         |
| 3.745.000,00       | Electronic Arts Inc 1.85% 15-02-<br>2031           | 3.592.470,34               | 0,24                         | 2.600.000,00       | JPMorgan Chase & Co 2.95%<br>01-10-2026            | 2.746.006,20               | 0,18                         |
| 2.415.000,00       | Entergy Corp 1.9% 15-06-2028                       | 2.374.821,91               | 0,16                         | 5.470.000,00       | JPMorgan Chase & Co 3.109%<br>MULTI 22-04-2051     | 5.650.707,08               | 0,38                         |
| 3.015.000,00       | Entergy Louisiana LLC 2.9%<br>15-03-2051           | 2.965.020,65               | 0,20                         | 13.045.000,00      | JPMorgan Chase & Co 3.782%<br>MULTI 01-02-2028     | 14.129.193,95              | 0,95                         |
| 4.000.000,00       | Entergy Louisiana LLC 4% 15-<br>03-2033            | 4.554.745,52               | 0,31                         | 2.000.000,00       | JPMorgan Chase & Co 3.797%<br>MULTI 23-07-2024     | 2.084.547,10               | 0,14                         |
| 1.435.000,00       | Equinix Inc 1.25% 15-07-2025                       | 1.408.180,68               | 0,09                         | 5.240.000,00       | JPMorgan Chase & Co 3.882%<br>MULTI 24-07-2038     | 5.941.842,19               | 0,40                         |
| 585.000,00         | Equinix Inc 2.625% 18-11-2024                      | 603.038,81                 | 0,04                         | 7.115.000,00       | JPMorgan Chase & Co 4.600%<br>MULTI Perp FC2025    | 7.301.768,75               | 0,49                         |
| 2.400.000,00       | Equinix Inc 2.9% 18-11-2026                        | 2.487.563,23               | 0,17                         | 540.000,00         | Kilroy Realty LP 3.45% 15-12-2024                  | 565.380,57                 | 0,04                         |
| 3.465.000,00       | Essential Properties LP 2.95%<br>15-07-2031        | 3.415.654,14               | 0,23                         | 1.390.000,00       | Kilroy Realty LP 4.375% 01-10-<br>2025             | 1.512.320,24               | 0,10                         |
| 4.250.000,00       | Exelon Corp 3.95% 15-06-2025                       | 4.547.262,51               | 0,30                         | 3.195.000,00       | Kimco Realty Corp 3.7% 01-10-<br>2049              | 3.396.819,75               | 0,23                         |
| 4.750.000,00       | Extra Space Storage LP 2.55%<br>01-06-2031         | 4.678.171,64               | 0,31                         | 5.035.000,00       | Kohl's Corp 3.375% 01-05-2031                      | 5.186.480,74               | 0,35                         |
| 8.000.000,00       | FedEx Corp 5.25% 15-05-2050                        | 10.701.174,08              | 0,72                         | 2.570.000,00       | Kohl's Corp 5.55% 17-07-2045                       | 2.996.280,71               | 0,20                         |
| 5.000.000,00       | Fidelity National Informatio 1.15%<br>01-03-2026   | 4.872.634,10               | 0,33                         | 3.978.000,00       | Kraft Heinz Foods Co 5% 15-<br>07-2035             | 4.867.291,73               | 0,33                         |
| 2.000.000,00       | First Horizon Bank 5.75% 01-<br>05-2030            | 2.393.826,90               | 0,16                         | 1.685.000,00       | Lam Research Corp 3.125% 15-<br>06-2060            | 1.718.430,47               | 0,12                         |
| 2.175.000,00       | First Horizon Corp 3.55% 26-<br>05-2023            | 2.241.384,81               | 0,15                         | 7.485.000,00       | Lennar Corp 4.75% 29-11-2027                       | 8.478.484,05               | 0,57                         |
| 1.000.000,00       | First Horizon Corp 4% 26-05-2025                   | 1.070.332,17               | 0,07                         | 1.540.000,00       | Life Storage LP 2.2% 15-10-2030                    | 1.513.592,96               | 0,10                         |
| 8.930.000,00       | Ford Motor Co 9% 22-04-2025                        | 10.917.818,00              | 0,73                         | 5.000.000,00       | Life Storage LP 2.4% 15-10-2031                    | 4.918.973,40               | 0,33                         |
| 5.000.000,00       | Fortinet Inc 2.2% 15-03-2031                       | 4.878.254,75               | 0,33                         | 910.000,00         | Lowe's Cos Inc 1.3% 15-04-2028                     | 872.581,99                 | 0,06                         |
| 10.000.000,00      | General Mills Inc 2.25% 14-10-2031                 | 9.889.666,80               | 0,66                         | 2.700.000,00       | Lowe's Cos Inc 1.7% 15-09-2028                     | 2.647.211,11               | 0,18                         |
| 1.825.000,00       | General Motors Co 4.2% 01-10-<br>2027              | 1.998.286,69               | 0,13                         | 5.700.000,00       | Lowe's Cos Inc 2.625% 01-04-2031                   | 5.828.574,90               | 0,39                         |
| 5.000.000,00       | General Motors Co 5.15% 01-<br>04-2038             | 6.015.955,15               | 0,40                         | 792.000,00         | Marriott International Inc/M 5.75%<br>01-05-2025   | 891.816,05                 | 0,06                         |
| 5.590.000,00       | General Motors Co 5.2% 01-04-<br>2045              | 6.915.557,09               | 0,46                         | 1.390.000,00       | Marsh & McLennan Cos Inc<br>4.375% 15-03-2029      | 1.585.449,33               | 0,11                         |
| 4.910.000,00       | General Motors Co 6.125% 01-<br>10-2025            | 5.637.691,02               | 0,38                         | 2.000.000,00       | Marsh & McLennan Cos Inc 4.75%<br>15-03-2039       | 2.481.786,98               | 0,17                         |
| 5.750.000,00       | General Motors Financial Co 2.4%<br>10-04-2028     | 5.775.948,08               | 0,39                         | 3.010.000,00       | Masco Corp 2% 15-02-2031                           | 2.887.027,20               | 0,19                         |
| 5.000.000,00       | General Motors Financial Co 2.4%<br>15-10-2028     | 4.989.757,45               | 0,33                         | 2.000.000,00       | Masco Corp 3.125% 15-02-2051                       | 1.986.720,04               | 0,13                         |
| 6.519.000,00       | Genuine Parts Co 1.875% 01-11-<br>2030             | 6.095.825,57               | 0,41                         | 1.000.000,00       | Mastercard Inc 2.95% 01-06-2029                    | 1.071.982,80               | 0,07                         |
| 1.905.000,00       | Goldman Sachs Group Inc 0.855%<br>MULTI 12-02-2026 | 1.868.329,23               | 0,13                         | 3.000.000,00       | Mastercard Inc 3.35% 26-03-2030                    | 3.302.553,21               | 0,22                         |
| 11.940.000,00      | Goldman Sachs Group Inc 1.948%<br>MULTI 21-10-2027 | 11.908.424,91              | 0,80                         | 950.000,00         | MetLife Inc 3% 01-03-2025                          | 999.095,24                 | 0,07                         |
| 9.960.000,00       | Goldman Sachs Group Inc 1.992%<br>MULTI 27-01-2032 | 9.557.528,95               | 0,64                         | 500.000,00         | MetLife Inc 6.5% 15-12-2032                        | 694.604,07                 | 0,05                         |
| 1.400.000,00       | Goldman Sachs Group Inc 2.905%<br>MULTI 24-07-2023 | 1.415.803,66               | 0,09                         | 3.150.000,00       | Microsoft Corp 2.675% 01-06-<br>2060               | 3.145.180,75               | 0,21                         |
|                    |  |                            |                              | 3.605.000,00       | Mondelez International Inc 2.75%<br>13-04-2030     | 3.717.720,06               | 0,25                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.



# Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 4.045.000,00       | Morgan Stanley 0.864% MULTI 21-10-2025          | 3.988.351,51               | 0,27                         | 1.700.000,00       | STORE Capital Corp 4.5% 15-03-2028  | 1.879.409,25               | 0,13                         |
| 5.000.000,00       | Morgan Stanley 1.164% MULTI 21-10-2025          | 4.958.363,00               | 0,33                         | 2.985.000,00       | Sysco Corp 3.3% 15-02-2050  | 3.022.341,07               | 0,20                         |
| 4.245.000,00       | Morgan Stanley 2.188% MULTI 28-04-2026          | 4.329.868,29               | 0,29                         | 2.726.000,00       | Sysco Corp 6.6% 01-04-2050  | 4.241.621,43               | 0,28                         |
| 8.155.000,00       | Morgan Stanley 2.484% MULTI 16-09-2036          | 7.833.743,15               | 0,52                         | 8.000.000,00       | T-Mobile USA Inc 3.4% 15-10-2052  | 7.945.786,48               | 0,53                         |
| 2.190.000,00       | Morgan Stanley 2.699% MULTI 22-01-2031          | 2.245.653,02               | 0,15                         | 750.000,00         | TWDC Enterprises 18 Corp 4.125% 01-06-2044  | 893.534,40                 | 0,06                         |
| 702.000,00         | Morgan Stanley 2.720% MULTI 22-07-2025          | 723.551,86                 | 0,05                         | 6.000.000,00       | Union Pacific Corp 2.375% 20-05-2031  | 6.120.996,30               | 0,41                         |
| 1.360.000,00       | Morgan Stanley 3.125% 27-07-2026                | 1.441.487,69               | 0,10                         | 4.000.000,00       | United Parcel Service Inc 5.3% 01-04-2050   | 5.885.319,12               | 0,39                         |
| 5.960.000,00       | Morgan Stanley 3.591% MULTI 22-07-2028          | 6.427.663,62               | 0,43                         | 1.715.000,00       | United Rentals North America 3.75% 15-01-2032   | 1.727.009,29               | 0,12                         |
| 8.485.000,00       | Morgan Stanley 3.622% MULTI 01-04-2031          | 9.251.753,81               | 0,62                         | 5.100.000,00       | United Rentals North America 3.875% 15-02-2031  | 5.170.125,00               | 0,35                         |
| 590.000,00         | Morgan Stanley 3.75% 25-02-2023                 | 610.271,90                 | 0,04                         | 7.285.000,00       | United Rentals North America 3.875% 15-11-2027  | 7.548.625,94               | 0,51                         |
| 420.000,00         | Morgan Stanley 3.772% MULTI 24-01-2029          | 457.607,68                 | 0,03                         | 40.000.000,00      | United States Treasury Note/ 2% 15-08-2051  | 40.768.750,00              | 2,73                         |
| 2.000.000,00       | Morgan Stanley 4% 23-07-2025                    | 2.168.312,16               | 0,15                         | 26.425.000,00      | United States Treasury Note/ 2% 15-11-2041  | 26.656.218,75              | 1,79                         |
| 2.700.000,00       | Morgan Stanley 4.431% MULTI 23-01-2030          | 3.078.756,19               | 0,21                         | 6.955.000,00       | United States Treasury Note/ 2.375% 15-05-2051  | 7.682.014,84               | 0,51                         |
| 1.900.000,00       | NVIDIA Corp 2% 15-06-2031                       | 1.891.431,99               | 0,13                         | 7.000.000,00       | US Bancorp 3.700% MULTI Perp FC2027   | 6.998.600,00               | 0,47                         |
| 4.550.000,00       | NVIDIA Corp 2.85% 01-04-2030                    | 4.836.324,54               | 0,32                         | 1.850.000,00       | Ventas Realty LP 3.5% 01-02-2025  | 1.949.635,43               | 0,13                         |
| 4.690.000,00       | NVIDIA Corp 3.5% 01-04-2050                     | 5.345.795,34               | 0,36                         | 2.845.000,00       | VeriSign Inc 2.7% 15-06-2031  | 2.859.225,00               | 0,19                         |
| 4.165.000,00       | Office Properties Income Tru 3.45% 15-10-2031   | 4.038.474,76               | 0,27                         | 2.970.000,00       | VeriSign Inc 4.75% 15-07-2027   | 3.085.087,50               | 0,21                         |
| 1.930.000,00       | Office Properties Income Tru 4.5% 01-02-2025    | 2.034.737,86               | 0,14                         | 5.000.000,00       | Verizon Communications Inc 1.5% 18-09-2030  | 4.698.603,35               | 0,31                         |
| 3.165.000,00       | OneMain Finance Corp 4% 15-09-2030              | 3.101.700,00               | 0,21                         | 4.955.000,00       | Verizon Communications Inc 2.65% 20-11-2040   | 4.692.287,88               | 0,31                         |
| 1.030.000,00       | OneMain Finance Corp 6.625% 15-01-2028          | 1.153.600,00               | 0,08                         | 3.500.000,00       | Verizon Communications Inc 4.272% 15-01-2036  | 4.106.719,93               | 0,28                         |
| 2.850.000,00       | Oracle Corp 2.8% 01-04-2027                     | 2.940.135,04               | 0,20                         | 12.245.000,00      | Verizon Communications Inc 4.329% 21-09-2028  | 13.915.325,63              | 0,93                         |
| 8.305.000,00       | Oracle Corp 3.6% 01-04-2050                     | 8.130.772,56               | 0,54                         | 4.690.000,00       | Verizon Communications Inc 4.4% 01-11-2034  | 5.468.365,30               | 0,37                         |
| 2.555.000,00       | Oracle Corp 3.85% 01-04-2060                    | 2.522.594,71               | 0,17                         | 935.000,00         | VF Corp 2.4% 23-04-2025   | 962.173,28                 | 0,06                         |
| 2.895.000,00       | Oracle Corp 3.9% 15-05-2035                     | 3.100.029,20               | 0,21                         | 1.595.000,00       | Virginia Electric and Power 2.45% 15-12-2050  | 1.468.328,42               | 0,10                         |
| 4.130.000,00       | O'Reilly Automotive Inc 1.75% 15-03-2031        | 3.910.854,97               | 0,26                         | 2.400.000,00       | Voya Financial Inc 3.65% 15-06-2026   | 2.584.702,54               | 0,17                         |
| 975.000,00         | Owens Corning 3.95% 15-08-2029                  | 1.068.562,73               | 0,07                         | 1.310.000,00       | Walt Disney Co/The 1.75% 13-01-2026   | 1.324.230,10               | 0,09                         |
| 2.261.000,00       | Owens Corning 4.4% 30-01-2048                   | 2.644.401,73               | 0,18                         | 8.000.000,00       | Walt Disney Co/The 2% 01-09-2029  | 7.962.552,64               | 0,53                         |
| 830.000,00         | PayPal Holdings Inc 2.65% 01-10-2026            | 871.722,27                 | 0,06                         | 5.235.000,00       | Walt Disney Co/The 3.8% 13-05-2060  | 6.063.665,84               | 0,41                         |
| 1.850.000,00       | PayPal Holdings Inc 2.85% 01-10-2029            | 1.948.358,03               | 0,13                         | 3.595.000,00       | Walt Disney Co/The 4.7% 23-03-2050  | 4.742.270,44               | 0,32                         |
| 3.950.000,00       | PECO Energy Co 3.9% 01-03-2048                  | 4.641.731,78               | 0,31                         | 6.000.000,00       | Waste Connections Inc 2.2% 15-01-2032   | 5.880.634,68               | 0,39                         |
| 10.000.000,00      | PepsiCo Inc 1.95% 21-10-2031                    | 9.996.002,40               | 0,67                         | 1.485.000,00       | Waste Connections Inc 4.25% 01-12-2028  | 1.669.922,22               | 0,11                         |
| 5.000.000,00       | PNC Financial Services 3.400% MULTI Perp FC2026 | 4.921.200,00               | 0,33                         | 1.000.000,00       | Wells Fargo & Co 2.406% MULTI 30-10-2025  | 1.024.621,57               | 0,07                         |
| 4.000.000,00       | PNC Financial Services Group 2.2% 01-11-2024    | 4.107.139,72               | 0,28                         | 4.885.000,00       | Wells Fargo & Co 2.879% MULTI 30-10-2030  | 5.088.901,32               | 0,34                         |
| 5.000.000,00       | PNC Financial Services Group 3.45% 23-04-2029   | 5.447.759,65               | 0,36                         | 720.000,00         | Wells Fargo & Co 3% 22-04-2026  | 756.536,43                 | 0,05                         |
| 3.500.000,00       | Prologis LP 3.875% 15-09-2028                   | 3.923.458,11               | 0,26                         | 1.150.000,00       | Wells Fargo & Co 3.068% MULTI 30-04-2041  | 1.176.700,11               | 0,08                         |
| 1.035.000,00       | Prudential Financial Inc 1.5% 10-03-2026        | 1.036.029,44               | 0,07                         | 1.845.000,00       | Wells Fargo & Co 3.196% MULTI 17-06-2027  | 1.945.939,95               | 0,13                         |
| 857.000,00         | Prudential Financial Inc 3.878% 27-03-2028      | 950.704,24                 | 0,06                         | 1.000.000,00       | Wells Fargo & Co 3.55% 29-09-2025   | 1.066.006,98               | 0,07                         |
| 6.000.000,00       | Public Service Co of Colorad 4.05% 15-09-2049   | 7.147.188,30               | 0,48                         | 860.000,00         | Wells Fargo & Co 3.584% MULTI 22-05-2028  | 925.118,84                 | 0,06                         |
| 6.590.000,00       | Public Storage 1.85% 01-05-2028                 | 6.578.609,58               | 0,44                         | 400.000,00         | Wells Fargo Bank NA 5.85% 01-02-2037  | 533.898,32                 | 0,04                         |
| 6.485.000,00       | PulteGroup Inc 5% 15-01-2027                    | 7.365.663,00               | 0,49                         | 1.250.000,00       | Zoetis Inc 2% 15-05-2030  | 1.230.976,71               | 0,08                         |
| 5.575.000,00       | QVC Inc 4.375% 01-09-2028                       | 5.533.187,50               | 0,37                         | 1.000.000,00       | Zoetis Inc 4.5% 13-11-2025  | 1.101.269,27               | 0,07                         |
| 3.680.000,00       | Rexford Industrial Realty LP 2.125% 01-12-2030  | 3.498.427,29               | 0,23                         |                    |   | <b>1.180.995.438,85</b>    | <b>79,08</b>                 |
| 925.000,00         | Santander Holdings USA Inc 3.4% 18-01-2023      | 945.433,56                 | 0,06                         |                    |   |                            |                              |
| 5.000.000,00       | Santander Holdings USA Inc 4.5% 17-07-2025      | 5.411.425,00               | 0,36                         |                    |   |                            |                              |
| 1.670.000,00       | Sealed Air Corp 5.125% 01-12-2024               | 1.786.900,00               | 0,12                         |                    |   |                            |                              |
| 6.515.000,00       | Service Corp International/U 3.375% 15-08-2030  | 6.401.964,75               | 0,43                         |                    |   |                            |                              |
| 4.550.000,00       | Service Corp International/U 4% 15-05-2031      | 4.606.875,00               | 0,31                         |                    |   |                            |                              |
| 5.000.000,00       | Simon Property Group LP 3.25% 13-09-2049        | 5.118.494,25               | 0,34                         |                    |   |                            |                              |
| 300.000,00         | Starbucks Corp 2.45% 15-06-2026                 | 310.478,90                 | 0,02                         |                    |   |                            |                              |
| 2.260.000,00       | Starbucks Corp 2.55% 15-11-2030                 | 2.309.082,18               | 0,15                         |                    |   |                            |                              |
| 7.600.000,00       | Starbucks Corp 3.5% 15-11-2050                  | 8.182.666,01               | 0,55                         |                    |   |                            |                              |
| 2.400.000,00       | Starbucks Corp 3.8% 15-08-2025                  | 2.590.202,02               | 0,17                         |                    |   |                            |                              |
| 3.165.000,00       | STORE Capital Corp 2.75% 18-11-2030             | 3.141.209,74               | 0,21                         |                    |   |                            |                              |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>1.180.995.438,85</b>    | <b>79,08</b>                 |
|                    |   |                            |                              |                    | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> | <b>1.180.995.438,85</b>    | <b>79,08</b>                 |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.





# Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land         |              | Sektor               |              |
|--------------|--------------|----------------------|--------------|
| USA          | 93,55        | Unternehmensanleihen | 90,27        |
| Deutschland  | 0,56         | Staatsanleihen       | 5,03         |
| Kanada       | 0,51         |                      |              |
| Niederlande  | 0,36         |                      |              |
| Irland       | 0,32         |                      |              |
| <b>Summe</b> | <b>95,30</b> | <b>Summe</b>         | <b>95,30</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 765.906.797,40                                    | EUR               | 862.896.427,12     | USD                | 5.088.153,06   | 28.01.2022 |
| 3.131.601.707,18                                  | NOK               | 349.631.134,38     | USD                | 5.461.214,09   | 28.01.2022 |
| 410.516.940,07                                    | SEK               | 45.562.322,71      | USD                | (197.496,28)   | 28.01.2022 |
| 21.634.317,92                                     | USD               | 19.128.136,67      | EUR                | (43.163,40)  | 28.01.2022 |
| 7.251.807,78                                      | USD               | 65.148.161,13      | NOK                | (135.341,96)   | 28.01.2022 |
| 741.668,15  | USD               | 6.732.955,14       | SEK                | (2.367,53)   | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>10.170.997,98</b>   |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

### Finanzterminkontrakte

| Beschreibung                           | Fälligkeit | Währung | Erworbene/ Verkaufte Kontrakte | Verpflichtung in Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom 30.12.2021 bis 31.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (USD) | Bereits verbuchter, nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) vom Kontraktabschluss bis zum 30.12.2021 in der Basiswährung des Teilfonds (USD) |
|--|------------|---------|--------------------------------|--------------------------|---|--|
| <b>Effiziente Portfolioverwaltung:</b> |            |         |                                |                          |   |  |
| US 10yr Ultra Fut 3/2022               | 31.03.2022 | USD     | (455,00)                       | (66.707.265,63)          | (78.203,13)   | (675.390,63)   |
|  |            |         |                                |                          | <b>(78.203,13)</b>  | <b>(675.390,63)</b>  |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                    | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|----------------------------|------------------------------|---|--|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |   |                            |                              |   |  |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |   |                            |                              |   |  |                            |                              |
| <b>USD</b>  |   |                            |                              |   |  |                            |                              |
| 1.365.000,00  | Ahlstrom-Munksjo Holding 3 O 4.875% 04-02-2028  | 1.341.112,50               | 0,20                         | 585.000,00  | Service Corp International/U 7.5% 01-04-2027   | 702.000,00                 | 0,11                         |
| 4.235.000,00  | Altice France Holding SA 6% 15-02-2028          | 4.054.631,35               | 0,61                         | 295.000,00  | Service Properties Trust 4.75% 01-10-2026      | 285.412,50                 | 0,04                         |
| 2.500.000,00  | Altice France SA/France 5.125% 15-07-2029       | 2.435.500,00               | 0,36                         | 600.000,00  | Service Properties Trust 4.95% 01-10-2029      | 570.000,00                 | 0,09                         |
| 2.885.000,00  | Altice France SA/France 5.5% 15-01-2028         | 2.867.805,40               | 0,43                         | 1.225.000,00  | SM Energy Co 6.5% 15-07-2028                   | 1.267.875,00               | 0,19                         |
| 760.000,00  | Apache Corp 5.1% 01-09-2040                     | 860.700,00                 | 0,13                         | 1.570.000,00  | Southwestern Energy Co 4.75% 01-02-2032        | 1.658.712,85               | 0,25                         |
| 3.670.000,00  | Bath & Body Works Inc 7.5% 15-06-2029           | 4.156.275,00               | 0,62                         | 3.195.000,00  | Southwestern Energy Co 5.375% 15-03-2030       | 3.418.650,06               | 0,51                         |
| 310.000,00  | Bausch Health Cos Inc 7% 15-01-2028             | 308.450,00                 | 0,05                         | 725.000,00  | Southwestern Energy Co 8.375% 15-09-2028       | 809.281,25                 | 0,12                         |
| 4.335.000,00  | Bausch Health Cos Inc 7.25% 30-05-2029          | 4.259.137,50               | 0,64                         | 3.695.000,00  | SPCM SA 3.375% 15-03-2030                      | 3.556.437,50               | 0,53                         |
| 1.390.000,00  | Bombardier Inc 7.125% 15-06-2026                | 1.444.779,90               | 0,22                         | 3.215.000,00  | Sprint Corp 7.625% 01-03-2026                  | 3.859.929,00               | 0,58                         |
| 2.539.000,00  | Bombardier Inc 7.875% 15-04-2027                | 2.621.517,50               | 0,39                         | 1.410.000,00  | Sprint Corp 7.875% 15-09-2023                  | 1.553.982,15               | 0,23                         |
| 1.615.000,00  | Calpine Corp 3.75% 01-03-2031                   | 1.566.550,00               | 0,23                         | 3.695.000,00  | Targa Resources Partners LP 6.875% 15-01-2029  | 4.133.892,10               | 0,62                         |
| 1.350.000,00  | Catalent Pharma Solutions In 3.5% 01-04-2030    | 1.337.688,00               | 0,20                         | 2.735.000,00  | Telecom Italia SpA/Milano 5.303% 30-05-2024    | 2.878.478,10               | 0,43                         |
| 4.380.000,00  | Centene Corp 3% 15-10-2030                      | 4.445.700,00               | 0,67                         | 1.400.000,00  | Teleflex Inc 4.625% 15-11-2027                 | 1.456.000,00               | 0,22                         |
| 2.135.000,00  | Dana Inc 4.5% 15-02-2032                        | 2.129.662,50               | 0,32                         | 2.760.000,00  | Teva Pharmaceutical Finance 5.125% 09-05-2029  | 2.763.450,00               | 0,41                         |
| 1.210.000,00  | DCP Midstream Operating LP 3.25% 15-02-2032     | 1.222.100,00               | 0,18                         | 2.641.000,00  | TK Elevator US Newco Inc 5.25% 15-07-2027      | 2.776.351,25               | 0,42                         |
| 2.255.000,00  | Deutsche Bank AG/New Yo 3.729% MULTI 14-01-2032 | 2.307.150,42               | 0,35                         | 1.910.000,00  | T-Mobile USA Inc 3.375% 15-04-2029             | 1.946.729,24               | 0,29                         |
| 4.845.000,00  | EnLink Midstream LLC 5.375% 01-06-2029          | 4.954.012,50               | 0,74                         | 1.655.000,00  | TRI Pointe Group Inc / TRI P 5.875% 15-06-2024 | 1.801.881,25               | 0,27                         |
| 1.020.000,00  | EQM Midstream Partners LP 5.5% 15-07-2028       | 1.114.350,00               | 0,17                         | 900.000,00  | United Airlines Inc 4.625% 15-04-2029          | 928.125,00                 | 0,14                         |
| 1.270.000,00  | FirstEnergy Corp 4.4% 15-07-2027                | 1.373.550,97               | 0,21                         | 2.115.000,00  | United Rentals North America 3.75% 15-01-2032  | 2.129.810,29               | 0,32                         |
| 1.605.000,00  | Ford Motor Co 7.4% 01-11-2046                   | 2.211.025,53               | 0,33                         | 1.370.000,00  | Vistra Operations Co LLC 4.375% 01-05-2029     | 1.372.233,10               | 0,21                         |
| 925.000,00  | Graphic Packaging Internatio 3.75% 01-02-2030   | 934.897,50                 | 0,14                         | 2.809.000,00  | Western Midstream Operating 5.3% 01-02-2030    | 3.092.765,18               | 0,46                         |
| 1.655.000,00  | HCA Inc 3.5% 01-09-2030                         | 1.741.473,75               | 0,26                         | 1.290.000,00  | Western Midstream Operating 6.5% 01-02-2050    | 1.525.425,00               | 0,23                         |
| 4.812.000,00  | Howmet Aerospace Inc 3% 15-01-2029              | 4.805.985,00               | 0,72                         | 1.250.000,00  | Yum! Brands Inc 3.625% 15-03-2031              | 1.245.312,50               | 0,19                         |
| 1.995.000,00  | Icahn Enterprises LP / Icahn 5.25% 15-05-2027   | 2.039.887,50               | 0,31                         | 3.805.000,00  | Ziggo Bond Co BV 5.125% 28-02-2030             | 3.824.025,00               | 0,57                         |
| 1.470.000,00  | Kraft Heinz Foods Co 4.375% 01-06-2046          | 1.718.127,53               | 0,26                         |   |  | <b>140.652.884,68</b>      | <b>21,04</b>                 |
| 1.645.000,00  | Kraft Heinz Foods Co 5% 04-06-2042              | 2.025.711,96               | 0,30                         | <b>Summe Anleihen</b>   |  | <b>140.652.884,68</b>      | <b>21,04</b>                 |
| 703.000,00  | Kraft Heinz Foods Co 5% 15-07-2035              | 860.157,39                 | 0,13                         | <b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  | <b>140.652.884,68</b>      | <b>21,04</b>                 |
| 1.270.000,00  | Laredo Petroleum Inc 10.125% 15-01-2028         | 1.331.677,55               | 0,20                         | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |  |                            |                              |
| 1.230.000,00  | Lumen Technologies Inc 4.5% 15-01-2029          | 1.190.025,00               | 0,18                         | <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |
| 410.000,00  | Macy's Retail Holdings LLC 2.875% 15-02-2023    | 414.202,50                 | 0,06                         | <b>USD</b>  |  |                            |                              |
| 820.000,00  | Nordstrom Inc 4.375% 01-04-2030                 | 822.050,00                 | 0,12                         | 2.545.000,00  | 1011778 BC ULC / New Red Fin 3.5% 15-02-2029   | 2.518.786,50               | 0,38                         |
| 3.050.000,00  | Occidental Petroleum Corp 6.125% 01-01-2031     | 3.705.750,00               | 0,55                         | 1.070.000,00  | 1011778 BC ULC / New Red Fin 3.875% 15-01-2028 | 1.083.375,00               | 0,16                         |
| 1.020.000,00  | Occidental Petroleum Corp 6.375% 01-09-2028     | 1.202.325,00               | 0,18                         | 1.280.000,00  | Aethon United BR LP / Aethon 8.25% 15-02-2026  | 1.374.976,00               | 0,21                         |
| 1.970.000,00  | Occidental Petroleum Corp 6.625% 01-09-2030     | 2.437.875,00               | 0,36                         | 2.635.000,00  | Affinity Gaming 6.875% 15-12-2027              | 2.760.663,15               | 0,41                         |
| 2.330.000,00  | Occidental Petroleum Corp 8.5% 15-07-2027       | 2.889.200,00               | 0,43                         | 3.010.000,00  | Air Canada 2020-1 Class C Pa 10.5% 15-07-2026  | 3.695.183,73               | 0,55                         |
| 615.000,00  | OneMain Finance Corp 3.5% 15-01-2027            | 609.426,56                 | 0,09                         | 835.000,00  | Air Canada 3.875% 15-08-2026                   | 851.700,00                 | 0,13                         |
| 1.560.000,00  | OneMain Finance Corp 6.125% 15-03-2024          | 1.653.958,80               | 0,25                         | 2.281.000,00  | Albertsons Cos Inc / Safeway 3.5% 15-03-2029   | 2.283.166,95               | 0,34                         |
| 1.550.000,00  | OneMain Finance Corp 6.625% 15-01-2028          | 1.736.000,00               | 0,26                         | 765.000,00  | Allied Universal Holdco LLC 6% 01-06-2029      | 743.962,50                 | 0,11                         |
| 1.705.000,00  | PBF Logistics LP / PBF Logis 6.875% 15-05-2023  | 1.658.112,50               | 0,25                         | 1.960.000,00  | Allied Universal Holdco LLC 6.625% 15-07-2026  | 2.058.000,00               | 0,31                         |
| 3.805.000,00  | Primo Water Holdings Inc 4.375% 30-04-2029      | 3.766.950,00               | 0,56                         | 3.040.000,00  | Allied Universal Holdco LLC 9.75% 15-07-2027   | 3.252.678,40               | 0,49                         |
| 1.100.000,00  | QVC Inc 4.375% 01-09-2028                       | 1.091.750,00               | 0,16                         | 3.103.000,00  | Altice Financing SA 5% 15-01-2028              | 3.028.186,67               | 0,45                         |
| 1.391.000,00  | Sealed Air Corp 5.125% 01-12-2024               | 1.488.370,00               | 0,22                         | 3.155.000,00  | American Airlines 2013-2 Cla 4.95% 15-01-2023  | 587.679,92                 | 0,09                         |
| 2.175.000,00  | Service Corp International/U 3.375% 15-08-2030  | 2.137.263,75               | 0,32                         | 1.935.000,00  | American Airlines Group Inc 3.75% 01-03-2025   | 1.785.037,50               | 0,27                         |
| 1.700.000,00  | Service Corp International/U 5.125% 01-06-2029  | 1.823.250,00               | 0,27                         |   |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 2.135.000,00       | American Airlines Inc 11.75%<br>15-07-2025            | 2.631.387,50               | 0,39                         | 1.965.000,00       | Cheniere Energy Partners LP 4.5%<br>01-10-2029    | 2.082.900,00               | 0,31                         |
| 1.710.000,00       | American Airlines Inc/AAdvan<br>5.5% 20-04-2026       | 1.769.850,00               | 0,26                         | 705.000,00         | Chobani LLC / Chobani Financ<br>4.625% 15-11-2028 | 724.355,78                 | 0,11                         |
| 1.385.000,00       | APX Group Inc 6.75% 15-02-2027                        | 1.461.175,00               | 0,22                         | 830.000,00         | Chobani LLC / Chobani Financ<br>7.5% 15-04-2025   | 854.900,00                 | 0,13                         |
| 670.000,00         | Aramark Services Inc 5% 01-02-<br>2028                | 692.612,50                 | 0,10                         | 1.545.000,00       | CHS/Community Health Systems<br>6% 15-01-2029     | 1.647.356,25               | 0,25                         |
| 1.300.000,00       | Arches Buyer Inc 4.25% 01-06-<br>2028                 | 1.298.830,00               | 0,19                         | 3.805.000,00       | CHS/Community Health Systems<br>6.875% 15-04-2029 | 3.876.343,75               | 0,58                         |
| 2.095.000,00       | Arches Buyer Inc 6.125% 01-12-<br>2028                | 2.108.083,28               | 0,32                         | 3.010.000,00       | CHS/Community Health Systems<br>8% 15-03-2026     | 3.164.262,50               | 0,47                         |
| 2.648.000,00       | Archrock Partners LP / Archr<br>6.25% 01-04-2028      | 2.761.122,56               | 0,41                         | 536.000,00         | Clarios Global LP / Clarios 6.25%<br>15-05-2026   | 560.790,00                 | 0,08                         |
| 1.770.000,00       | Ardagh Metal Packaging Finan<br>3.25% 01-09-2028      | 1.750.131,75               | 0,26                         | 2.265.000,00       | Clarios Global LP / Clarios 8.5%<br>15-05-2027    | 2.400.900,00               | 0,36                         |
| 605.000,00         | Ardagh Packaging Finance PLC<br>5.25% 30-04-2025      | 624.662,50                 | 0,09                         | 887.000,00         | Clarios Global LP 6.75% 15-05-<br>2025            | 931.350,00                 | 0,14                         |
| 2.000.000,00       | Arko Corp 5.125% 15-11-2029                           | 1.932.500,00               | 0,29                         | 630.000,00         | Clarivate Science Holdings C<br>3.875% 01-07-2028 | 633.150,00                 | 0,09                         |
| 1.335.000,00       | Asbury Automotive Group Inc 5%<br>15-02-2032          | 1.385.329,50               | 0,21                         | 565.000,00         | Clean Harbors Inc 4.875% 15-<br>07-2027           | 581.950,00                 | 0,09                         |
| 2.571.000,00       | Ascent Resources Utica Holdi<br>5.875% 30-06-2029     | 2.473.790,49               | 0,37                         | 2.866.000,00       | Clean Harbors Inc 5.125% 15-<br>07-2029           | 3.023.630,00               | 0,45                         |
| 1.695.000,00       | Ascent Resources Utica Holdi 7%<br>01-11-2026         | 1.718.306,25               | 0,26                         | 1.635.000,00       | Clear Channel Worldwide Hold<br>5.125% 15-08-2027 | 1.684.050,00               | 0,25                         |
| 1.050.000,00       | Ascent Resources Utica Holdi<br>8.25% 31-12-2028      | 1.094.625,00               | 0,16                         | 1.665.000,00       | Clearway Energy Operating LL<br>3.75% 15-01-2032  | 1.652.512,50               | 0,25                         |
| 390.000,00         | At Home Group Inc 4.875% 15-<br>07-2028               | 384.150,00                 | 0,06                         | 460.000,00         | Clearway Energy Operating LL<br>3.75% 15-02-2031  | 460.441,60                 | 0,07                         |
| 2.915.000,00       | Avantor Funding Inc 3.875%<br>01-11-2029              | 2.946.802,65               | 0,44                         | 3.880.000,00       | Clearway Energy Operating LL<br>4.75% 15-03-2028  | 4.078.850,00               | 0,61                         |
| 700.000,00         | Avis Budget Car Rental LLC /<br>4.75% 01-04-2028      | 715.750,00                 | 0,11                         | 2.420.000,00       | CNX Midstream Partners LP<br>4.75% 15-04-2030     | 2.410.925,00               | 0,36                         |
| 1.215.000,00       | Bath & Body Works Inc 6.625%<br>01-10-2030            | 1.375.987,50               | 0,21                         | 592.000,00         | CNX Resources Corp 6% 15-01-<br>2029              | 615.680,00                 | 0,09                         |
| 961.000,00         | Bath & Body Works Inc 9.375%<br>01-07-2025            | 1.172.420,00               | 0,18                         | 1.655.000,00       | CNX Resources Corp 7.25% 14-<br>03-2027           | 1.755.508,15               | 0,26                         |
| 4.920.000,00       | Bausch Health Americas Inc 8.5%<br>31-01-2027         | 5.166.000,00               | 0,77                         | 2.080.000,00       | Coer Mining Inc 5.125% 15-02-<br>2029             | 1.911.000,00               | 0,29                         |
| 1.960.000,00       | Bausch Health Americas Inc<br>9.25% 01-04-2026        | 2.070.250,00               | 0,31                         | 1.890.000,00       | CommScope Inc 6% 01-03-2026                       | 1.946.700,00               | 0,29                         |
| 1.850.000,00       | Bausch Health Cos Inc 9% 15-<br>12-2025               | 1.933.250,00               | 0,29                         | 2.420.000,00       | CommScope Inc 8.25% 01-03-<br>2027                | 2.474.450,00               | 0,37                         |
| 1.500.000,00       | BCPE Ulysses Intermediate In<br>7.75% P-I-K 01-04-202 | 1.481.250,00               | 0,22                         | 1.930.000,00       | CoreLogic Inc 4.5% 01-05-2028                     | 1.910.700,00               | 0,29                         |
| 3.170.000,00       | Boxer Parent Co Inc 7.125% 02-<br>10-2025             | 3.324.537,50               | 0,50                         | 2.955.000,00       | Cornerstone Building Brands<br>6.125% 15-01-2029  | 3.169.237,50               | 0,47                         |
| 1.055.000,00       | Brink's Co/The 5.5% 15-07-2025                        | 1.097.200,00               | 0,16                         | 635.000,00         | Covert Mergeco Inc 4.875%<br>01-12-2029           | 644.525,00                 | 0,10                         |
| 1.425.000,00       | Brundage-Bone Concrete Pumpi<br>6% 01-02-2026         | 1.482.000,01               | 0,22                         | 680.000,00         | CP Atlas Buyer Inc 7% 01-12-2028                  | 674.050,00                 | 0,10                         |
| 625.000,00         | Builders FirstSource Inc 4.25%<br>01-02-2032          | 650.000,00                 | 0,10                         | 1.035.000,00       | CrownRock LP / CrownRock Fin<br>5% 01-05-2029     | 1.073.812,50               | 0,16                         |
| 1.763.000,00       | Builders FirstSource Inc 6.75%<br>01-06-2027          | 1.859.965,00               | 0,28                         | 2.575.000,00       | CSC Holdings LLC 4.625% 01-<br>12-2030            | 2.436.593,75               | 0,36                         |
| 2.250.000,00       | Cable One Inc 4% 15-11-2030                           | 2.205.000,00               | 0,33                         | 5.985.000,00       | CSC Holdings LLC 5.5% 15-04-<br>2027              | 6.186.993,75               | 0,93                         |
| 735.000,00         | Cablevision Lightpath LLC 3.875%<br>15-09-2027        | 712.950,00                 | 0,11                         | 200.000,00         | CSC Holdings LLC 5.75% 15-01-<br>2030             | 199.250,00                 | 0,03                         |
| 1.015.000,00       | Caesars Entertainment Inc 6.25%<br>01-07-2025         | 1.064.481,25               | 0,16                         | 3.415.000,00       | Darling Ingredients Inc 5.25%<br>15-04-2027       | 3.521.718,89               | 0,53                         |
| 815.000,00         | Caesars Resort Collection LL<br>5.75% 01-07-2025      | 853.830,68                 | 0,13                         | 2.690.000,00       | Delek Logistics Partners LP<br>7.125% 01-06-2028  | 2.797.600,00               | 0,42                         |
| 1.190.000,00       | Calpine Corp 4.5% 15-02-2028                          | 1.231.650,00               | 0,18                         | 590.000,00         | Diamond Sports Group LLC / D<br>5.375% 15-08-2026 | 299.543,00                 | 0,04                         |
| 1.135.000,00       | Calpine Corp 5.125% 15-03-2028                        | 1.152.206,60               | 0,17                         | 285.000,00         | Diamond Sports Group LLC / D<br>6.625% 15-08-2027 | 79.800,00                  | 0,01                         |
| 741.000,00         | Calpine Corp 5.25% 01-06-2026                         | 760.451,26                 | 0,11                         | 2.530.000,00       | Directv Financing LLC / Dire<br>5.875% 15-08-2027 | 2.595.982,40               | 0,39                         |
| 2.715.000,00       | Carnival Corp 6% 01-05-2029                           | 2.701.425,00               | 0,40                         | 3.750.000,00       | DISH DBS Corp 5.25% 01-12-2026                    | 3.815.625,00               | 0,57                         |
| 2.870.000,00       | Carriage Services Inc 4.25%<br>15-05-2029             | 2.855.650,00               | 0,43                         | 4.910.000,00       | DISH DBS Corp 7.375% 01-07-<br>2028               | 4.971.375,00               | 0,74                         |
| 1.400.000,00       | Cascades Inc/Cascades USA In<br>5.375% 15-01-2028     | 1.435.000,00               | 0,21                         | 3.243.000,00       | DISH DBS Corp 7.75% 01-07-2026                    | 3.421.365,00               | 0,51                         |
| 750.000,00         | Catalent Pharma Solutions In<br>3.125% 15-02-2029     | 737.812,50                 | 0,11                         | 2.170.000,00       | Dornoch Debt Merger Sub Inc<br>6.625% 15-10-2029  | 2.142.875,00               | 0,32                         |
| 8.784.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi<br>4.25% 01-02-2031      | 8.871.840,00               | 1,33                         | 2.615.000,00       | Dycom Industries Inc 4.5% 15-<br>04-2029          | 2.664.031,25               | 0,40                         |
| 8.009.000,00       | CCO Holdings LLC / CCO Holdi<br>4.75% 01-03-2030      | 8.329.360,00               | 1,25                         | 1.684.000,00       | Edgewell Personal Care Co 5.5%<br>01-06-2028      | 1.780.830,00               | 0,27                         |
| 1.950.000,00       | CD&R Smokey Buyer Inc 6.75%<br>15-07-2025             | 2.047.500,00               | 0,31                         | 585.000,00         | Endeavor Energy Resources LP<br>5.75% 30-01-2028  | 619.672,95                 | 0,09                         |
| 520.000,00         | CDW LLC / CDW Finance Corp<br>5.5% 01-12-2024         | 569.088,00                 | 0,09                         | 1.693.000,00       | Endeavor Energy Resources LP<br>6.625% 15-07-2025 | 1.786.115,00               | 0,27                         |
| 3.855.000,00       | Centene Corp 4.625% 15-12-2029                        | 4.139.306,25               | 0,62                         | 1.310.000,00       | Endo Luxembourg Finance Co I<br>6.125% 01-04-2029 | 1.277.250,00               | 0,19                         |
| 2.814.000,00       | Centennial Resource Producti<br>6.875% 01-04-2027     | 2.870.280,00               | 0,43                         | 760.000,00         | Endure Digital Inc 6% 15-02-2029                  | 706.800,00                 | 0,11                         |
| 670.000,00         | Cheniere Energy Inc 4.625%<br>15-10-2028              | 706.850,00                 | 0,11                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                      | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 1.215.000,00       | Energizer Holdings Inc 4.375%<br>31-03-2029       | 1.187.662,50               | 0,18                         | 670.000,00         | LBM Acquisition LLC 6.25%<br>15-01-2029           | 662.462,50                 | 0,10                         |
| 1.080.000,00       | EnerSys 4.375% 15-12-2027                         | 1.120.500,00               | 0,17                         | 840.000,00         | LCM Investments Holdings II<br>4.875% 01-05-2029  | 863.251,20                 | 0,13                         |
| 2.615.000,00       | Entegris Inc 4.375% 15-04-2028                    | 2.686.912,50               | 0,40                         | 520.000,00         | LD Holdings Group LLC 6.125%<br>01-04-2028        | 486.200,00                 | 0,07                         |
| 3.565.000,00       | EQM Midstream Partners LP<br>4.75% 15-01-2031     | 3.743.250,00               | 0,56                         | 1.100.000,00       | Level 3 Financing Inc 3.625%<br>15-01-2029        | 1.045.000,00               | 0,16                         |
| 1.145.000,00       | EQM Midstream Partners LP 6%<br>01-07-2025        | 1.236.600,00               | 0,18                         | 1.625.000,00       | Level 3 Financing Inc 3.75%<br>15-07-2029         | 1.543.750,00               | 0,23                         |
| 1.225.000,00       | EQM Midstream Partners LP 6.5%<br>01-07-2027      | 1.372.000,00               | 0,21                         | 1.835.000,00       | LGI Homes Inc 4% 15-07-2029                       | 1.830.412,50               | 0,27                         |
| 1.180.000,00       | Everi Holdings Inc 5% 15-07-2029                  | 1.194.750,00               | 0,18                         | 1.365.000,00       | Lumen Technologies Inc 5.125%<br>15-12-2026       | 1.422.302,70               | 0,21                         |
| 2.570.000,00       | Fair Isaac Corp 4% 15-06-2028                     | 2.636.974,20               | 0,39                         | 2.625.000,00       | Macy's Retail Holdings LLC<br>5.875% 01-04-2029   | 2.798.906,25               | 0,42                         |
| 2.000.000,00       | Foot Locker Inc 4% 01-10-2029                     | 2.003.350,00               | 0,30                         | 725.000,00         | Match Group Holdings II LLC<br>3.625% 01-10-2031  | 703.250,00                 | 0,11                         |
| 2.750.000,00       | Fortress Transportation and 5.5%<br>01-05-2028    | 2.802.167,50               | 0,42                         | 5.215.000,00       | Match Group Holdings II LLC<br>4.625% 01-06-2028  | 5.397.525,00               | 0,81                         |
| 1.095.000,00       | Foundation Building Material 6%<br>01-03-2029     | 1.075.837,50               | 0,16                         | 3.675.000,00       | Match Group Holdings II LLC<br>5.625% 15-02-2029  | 3.932.250,00               | 0,59                         |
| 1.030.000,00       | Garda World Security Corp<br>4.625% 15-02-2027    | 1.030.000,00               | 0,15                         | 1.325.000,00       | Mattel Inc 3.375% 01-04-2026                      | 1.361.437,50               | 0,20                         |
| 3.050.000,00       | Garda World Security Corp 9.5%<br>01-11-2027      | 3.263.500,00               | 0,49                         | 2.180.000,00       | Mattel Inc 5.875% 15-12-2027                      | 2.343.412,80               | 0,35                         |
| 640.000,00         | GFL Environmental Inc 3.75%<br>01-08-2025         | 649.600,00                 | 0,10                         | 1.510.000,00       | Mauser Packaging Solutions H<br>5.5% 15-04-2024   | 1.523.846,70               | 0,23                         |
| 2.755.000,00       | GFL Environmental Inc 4% 01-<br>08-2028           | 2.699.900,00               | 0,40                         | 1.822.000,00       | Mauser Packaging Solutions H<br>7.25% 15-04-2025  | 1.826.618,77               | 0,27                         |
| 540.000,00         | GFL Environmental Inc 4.25%<br>01-06-2025         | 552.150,00                 | 0,08                         | 1.925.000,00       | Michaels Cos Inc/The 5.25%<br>01-05-2028          | 1.920.187,50               | 0,29                         |
| 660.000,00         | GFL Environmental Inc 4.75%<br>15-06-2029         | 662.475,00                 | 0,10                         | 1.610.000,00       | Michaels Cos Inc/The 7.875%<br>01-05-2029         | 1.577.800,00               | 0,24                         |
| 450.000,00         | GFL Environmental Inc 5.125%<br>15-12-2026        | 468.562,50                 | 0,07                         | 1.740.000,00       | Midcap Financial Issuer Trus 6.5%<br>01-05-2028   | 1.814.837,40               | 0,27                         |
| 3.240.000,00       | Go Daddy Operating Co LLC /<br>5.25% 01-12-2027   | 3.349.350,00               | 0,50                         | 1.055.000,00       | Mileage Plus Holdings LLC / 6.5%<br>20-06-2027    | 1.126.212,50               | 0,17                         |
| 940.000,00         | Great Lakes Dredge & Dock Co<br>5.25% 01-06-2029  | 968.200,00                 | 0,14                         | 3.240.000,00       | Mohegan Gaming & Entertainme<br>8% 01-02-2026     | 3.402.000,00               | 0,51                         |
| 530.000,00         | Group 1 Automotive Inc 4% 15-<br>08-2028          | 528.012,50                 | 0,08                         | 2.652.000,00       | Mozart Debt Merger Sub Inc<br>3.875% 01-04-2029   | 2.638.740,00               | 0,39                         |
| 3.170.000,00       | H&E Equipment Services Inc<br>3.875% 15-12-2028   | 3.146.225,00               | 0,47                         | 705.000,00         | Mozart Debt Merger Sub Inc<br>5.25% 01-10-2029    | 712.050,00                 | 0,11                         |
| 1.595.000,00       | HealthEquity Inc 4.5% 01-10-2029                  | 1.579.050,00               | 0,24                         | 2.500.000,00       | MSCI Inc 4% 15-11-2029                            | 2.609.375,00               | 0,39                         |
| 3.815.000,00       | Herc Holdings Inc 5.5% 15-07-<br>2027             | 3.967.600,00               | 0,59                         | 1.065.000,00       | Nabors Industries Inc 7.375%<br>15-05-2027        | 1.096.950,00               | 0,16                         |
| 705.000,00         | Hertz Corp/The 4.625% 01-12-<br>2026              | 709.406,25                 | 0,11                         | 2.320.000,00       | NCR Corp 5.125% 15-04-2029                        | 2.395.400,00               | 0,36                         |
| 1.015.000,00       | Hess Midstream Operations LP<br>4.25% 15-02-2030  | 1.007.387,50               | 0,15                         | 665.000,00         | NCR Corp 5.25% 01-10-2030                         | 683.287,50                 | 0,10                         |
| 716.000,00         | Hess Midstream Operations LP<br>5.625% 15-02-2026 | 737.480,00                 | 0,11                         | 2.170.000,00       | NESCO Holdings II Inc 5.5%<br>15-04-2029          | 2.240.525,00               | 0,34                         |
| 2.010.000,00       | Hilcorp Energy I LP / Hilcor 5.75%<br>01-02-2029  | 2.062.762,50               | 0,31                         | 895.000,00         | News Corp 3.875% 15-05-2029                       | 903.950,00                 | 0,14                         |
| 2.240.000,00       | Hilcorp Energy I LP / Hilcor 6%<br>01-02-2031     | 2.307.200,00               | 0,35                         | 3.130.000,00       | Nexstar Media Inc 5.625% 15-<br>07-2027           | 3.286.500,00               | 0,49                         |
| 1.625.000,00       | Hilton Domestic Operating Co<br>4.875% 15-01-2030 | 1.736.718,75               | 0,26                         | 705.000,00         | Nielsen Finance LLC / Nielse 4.5%<br>15-07-2029   | 693.536,70                 | 0,10                         |
| 3.155.000,00       | Hologic Inc 3.25% 15-02-2029                      | 3.155.000,00               | 0,47                         | 485.000,00         | NMI Holdings Inc 7.375% 01-<br>06-2025            | 550.717,50                 | 0,08                         |
| 850.000,00         | iHeartCommunications Inc 4.75%<br>15-01-2028      | 860.625,00                 | 0,13                         | 880.000,00         | Novelis Corp 3.875% 15-08-2031                    | 874.500,00                 | 0,13                         |
| 1.015.000,00       | iHeartCommunications Inc 5.25%<br>15-08-2027      | 1.056.805,32               | 0,16                         | 1.580.000,00       | OI European Group BV 4.75%<br>15-02-2030          | 1.601.298,40               | 0,24                         |
| 1.300.000,00       | Iliad Holding SASU 6.5% 15-10-<br>2026            | 1.365.949,00               | 0,20                         | 290.000,00         | Olympus Water US Holding Cor<br>4.25% 01-10-2028  | 288.370,20                 | 0,04                         |
| 585.000,00         | International Game Technolog<br>5.25% 15-01-2029  | 620.772,75                 | 0,09                         | 1.359.000,00       | Ortho-Clinical Diagnostics I<br>7.375% 01-06-2025 | 1.433.745,04               | 0,21                         |
| 1.980.000,00       | Intertape Polymer Group Inc<br>4.375% 15-06-2029  | 1.980.000,00               | 0,30                         | 4.360.000,00       | Owens-Brockway Glass Contain<br>6.625% 13-05-2027 | 4.599.800,00               | 0,69                         |
| 3.405.000,00       | IRB Holding Corp 7% 15-06-2025                    | 3.592.275,00               | 0,54                         | 1.595.000,00       | Par Pharmaceutical Inc 7.5%<br>01-04-2027         | 1.628.893,75               | 0,24                         |
| 2.180.000,00       | Iron Mountain Inc 5.25% 15-03-<br>2028            | 2.267.200,00               | 0,34                         | 3.420.000,00       | Park Intermediate Holdings L<br>4.875% 15-05-2029 | 3.514.050,00               | 0,53                         |
| 1.310.000,00       | Iron Mountain Inc 5.25% 15-07-<br>2030            | 1.371.294,90               | 0,21                         | 760.000,00         | Park River Holdings Inc 5.625%<br>01-02-2029      | 725.800,00                 | 0,11                         |
| 1.930.000,00       | Iron Mountain Inc 5.625% 15-<br>07-2032           | 2.068.272,92               | 0,31                         | 1.720.000,00       | Pattern Energy Operations LP<br>4.5% 15-08-2028   | 1.786.426,40               | 0,27                         |
| 765.000,00         | JetBlue 2020-1 Class B Pass<br>7.75% 15-11-2028   | 794.605,16                 | 0,12                         | 2.330.000,00       | PBF Holding Co LLC / PBF Fin<br>9.25% 15-05-2025  | 2.216.412,50               | 0,33                         |
| 2.285.000,00       | Kronos Acquisition Holdings 5%<br>31-12-2026      | 2.257.191,55               | 0,34                         | 2.020.000,00       | Penn National Gaming Inc 4.125%<br>01-07-2029     | 1.959.400,00               | 0,29                         |
| 3.211.000,00       | Kronos Acquisition Holdings 7%<br>31-12-2027      | 3.026.367,50               | 0,45                         | 1.590.000,00       | PennyMac Financial Services<br>5.375% 15-10-2025  | 1.633.725,00               | 0,24                         |
| 865.000,00         | Ladder Capital Finance Holdi<br>4.75% 15-06-2029  | 880.137,50                 | 0,13                         | 1.625.000,00       | Performance Food Group Inc<br>4.25% 01-08-2029    | 1.610.212,50               | 0,24                         |
| 2.035.000,00       | Lamar Media Corp 4% 15-02-2030                    | 2.064.507,50               | 0,31                         | 721.000,00         | Picasso Finance Sub Inc 6.125%<br>15-06-2025      | 752.543,76                 | 0,11                         |
| 1.340.000,00       | Laredo Petroleum Inc 7.75%<br>31-07-2029          | 1.306.500,00               | 0,20                         | 2.060.000,00       | Post Holdings Inc 4.625% 15-<br>04-2030           | 2.098.110,00               | 0,31                         |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US High Yield Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 4.920.000,00       | Post Holdings Inc 5.75% 01-03-2027             | 5.079.900,00               | 0,76                         | 4.115.000,00       | UPC Holding BV 5.5% 15-01-2028   | 4.269.312,50               | 0,64                         |
| 895.000,00         | PRA Health Sciences Inc 2.875% 15-07-2026      | 896.118,75                 | 0,13                         | 1.330.000,00       | Urban One Inc 7.375% 01-02-2028  | 1.369.900,00               | 0,20                         |
| 375.000,00         | Presidio Holdings Inc 4.875% 01-02-2027        | 386.250,00                 | 0,06                         | 630.000,00         | US Foods Inc 4.625% 01-06-2030   | 636.300,00                 | 0,10                         |
| 590.000,00         | Presidio Holdings Inc 8.25% 01-02-2028         | 628.350,00                 | 0,09                         | 2.705.000,00       | USA Compression Partners LP 6.875% 01-09-2027  | 2.857.156,25               | 0,43                         |
| 1.065.000,00       | Prestige Brands Inc 3.75% 01-04-2031           | 1.033.050,00               | 0,15                         | 850.000,00         | Venture Global Calcasieu Pas 3.875% 01-11-2033   | 897.812,50                 | 0,13                         |
| 2.290.000,00       | Prestige Brands Inc 5.125% 15-01-2028          | 2.384.462,50               | 0,36                         | 1.640.000,00       | Venture Global Calcasieu Pas 3.875% 15-08-2029   | 1.705.600,00               | 0,26                         |
| 2.425.000,00       | Prime Security Services Borr 3.375% 31-08-2027 | 2.338.864,00               | 0,35                         | 2.624.000,00       | Venture Global Calcasieu Pas 4.125% 15-08-2031   | 2.801.120,00               | 0,42                         |
| 995.000,00         | Realogy Group LLC / Realogy 5.75% 15-01-2029   | 1.022.362,50               | 0,15                         | 2.340.000,00       | Viavi Solutions Inc 3.75% 01-10-2029   | 2.339.883,00               | 0,35                         |
| 2.700.000,00       | Realogy Group LLC / Realogy 7.625% 15-06-2025  | 2.868.750,00               | 0,43                         | 965.000,00         | VICI Properties LP / VICI No 4.625% 01-12-2029   | 1.032.607,90               | 0,15                         |
| 790.000,00         | Ritchie Bros Holdings Inc 4.75% 15-12-2031     | 823.575,00                 | 0,12                         | 2.570.000,00       | Victoria's Secret & Co 4.625% 15-07-2029   | 2.627.825,00               | 0,39                         |
| 670.000,00         | Rockcliff Energy II LLC 5.5% 15-10-2029        | 686.750,00                 | 0,10                         | 6.445.000,00       | Virgin Media Finance PLC 5% 15-07-2030   | 6.412.775,00               | 0,96                         |
| 1.895.000,00       | Rocket Mortgage LLC / Rocket 3.625% 01-03-2029 | 1.902.106,25               | 0,28                         | 3.045.000,00       | WASH Multifamily Acquisition 5.75% 15-04-2026  | 3.200.142,75               | 0,48                         |
| 1.825.000,00       | Royal Caribbean Cruises Ltd 4.25% 01-07-2026   | 1.756.562,50               | 0,26                         | 3.033.000,00       | Waste Pro USA Inc 5.5% 15-02-2026  | 3.033.000,00               | 0,45                         |
| 2.655.000,00       | SBA Communications Corp 3.875% 15-02-2027      | 2.734.650,00               | 0,41                         | 1.480.000,00       | Weekley Homes LLC / Weekley 4.875% 15-09-2028  | 1.524.400,00               | 0,23                         |
| 1.810.000,00       | Scientific Games Internation 7% 15-05-2028     | 1.931.432,90               | 0,29                         | 1.530.000,00       | WESCO Distribution Inc 7.125% 15-06-2025   | 1.626.696,00               | 0,24                         |
| 520.000,00         | Seagate HDD Cayman 4.125% 15-01-2031           | 541.008,00                 | 0,08                         | 835.000,00         | WESCO Distribution Inc 7.25% 15-06-2028  | 911.193,75                 | 0,14                         |
| 550.000,00         | Service Properties Trust 4.95% 15-02-2027      | 529.375,00                 | 0,08                         | 710.000,00         | White Cap Buyer LLC 6.875% 15-10-2028  | 740.175,00                 | 0,11                         |
| 2.090.000,00       | Service Properties Trust 7.5% 15-09-2025       | 2.265.286,96               | 0,34                         | 1.145.000,00       | White Cap Parent LLC 8.25% P-I-K 15-03-2026  | 1.170.762,50               | 0,18                         |
| 1.065.000,00       | Simmons Foods Inc/Simmons Pr 4.625% 01-03-2029 | 1.046.362,50               | 0,16                         | 680.000,00         | Williams Scotsman Internatio 4.625% 15-08-2028   | 698.700,00                 | 0,10                         |
| 2.070.000,00       | Sirius XM Radio Inc 4.125% 01-07-2030          | 2.070.000,02               | 0,31                         | 1.405.000,00       | WMG Acquisition Corp 3.75% 01-12-2029  | 1.401.487,50               | 0,21                         |
| 2.635.000,00       | Sonic Automotive Inc 4.875% 15-11-2031         | 2.660.559,50               | 0,40                         | 1.390.000,00       | Wynn Resorts Finance LLC / W 5.125% 01-10-2029   | 1.407.375,00               | 0,21                         |
| 1.790.000,00       | Sotheby's 7.375% 15-10-2027                    | 1.906.350,00               | 0,29                         | 925.000,00         | XHR LP 4.875% 01-06-2029   | 941.187,50                 | 0,14                         |
| 2.150.000,00       | Sotheby's/Bidfair Holdings I 5.875% 01-06-2029 | 2.193.000,00               | 0,33                         | 2.165.000,00       | XPO Logistics Inc 6.25% 01-05-2025   | 2.265.131,25               | 0,34                         |
| 1.595.000,00       | Standard Industries Inc/NJ 4.375% 15-07-2030   | 1.624.906,25               | 0,24                         | 1.760.000,00       | Yum! Brands Inc 4.75% 15-01-2030   | 1.905.200,00               | 0,29                         |
| 435.000,00         | Staples Inc 10.75% 15-04-2027                  | 409.443,75                 | 0,06                         | 705.000,00         | ZoomInfo Technologies LLC/Zo 3.875% 01-02-2029   | 698.937,00                 | 0,10                         |
| 1.630.000,00       | Staples Inc 7.5% 15-04-2026                    | 1.666.675,00               | 0,25                         |                    |  | <b>497.335.433,41</b>      | <b>74,40</b>                 |
| 705.000,00         | Station Casinos LLC 4.625% 01-12-2031          | 710.781,00                 | 0,11                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>  | <b>497.335.433,41</b>      | <b>74,40</b>                 |
| 1.610.000,00       | Stericycle Inc 3.875% 15-01-2029               | 1.577.800,00               | 0,24                         |                    | <b>Summe an einem anderen<br/>geregeltten Markt gehandelte<br/>übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente</b> | <b>497.335.433,41</b>      | <b>74,40</b>                 |
| 920.000,00         | Tap Rock Resources LLC 7% 01-10-2026           | 956.800,00                 | 0,14                         |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>   | <b>637.988.318,09</b>      | <b>95,44</b>                 |
| 1.055.000,00       | TEGNA Inc 4.625% 15-03-2028                    | 1.066.383,45               | 0,16                         |                    | <b>Bankguthaben</b>  | <b>20.643.384,50</b>       | <b>3,09</b>                  |
| 1.825.000,00       | Teleflex Inc 4.25% 01-06-2028                  | 1.880.096,75               | 0,28                         |                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>  | <b>9.823.555,61</b>        | <b>1,47</b>                  |
| 510.000,00         | Tempo Acquisition LLC / Temp 5.75% 01-06-2025  | 527.850,00                 | 0,08                         |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>   | <b>668.455.258,20</b>      | <b>100,00</b>                |
| 2.140.000,00       | Tenet Healthcare Corp 4.375% 15-01-2030        | 2.173.169,79               | 0,33                         |                    |  |                            |                              |
| 3.660.000,00       | Tenet Healthcare Corp 6.125% 01-10-2028        | 3.865.728,60               | 0,58                         |                    |  |                            |                              |
| 2.670.000,00       | Thor Industries Inc 4% 15-10-2029              | 2.643.300,00               | 0,40                         |                    |  |                            |                              |
| 3.575.000,00       | Titan Acquisition Ltd / Tita 7.75% 15-04-2026  | 3.628.625,00               | 0,54                         |                    |  |                            |                              |
| 1.335.000,00       | TopBuild Corp 4.125% 15-02-2032                | 1.366.706,25               | 0,20                         |                    |  |                            |                              |
| 1.835.000,00       | TriMas Corp 4.125% 15-04-2029                  | 1.839.587,50               | 0,28                         |                    |  |                            |                              |
| 2.525.000,00       | TripAdvisor Inc 7% 15-07-2025                  | 2.663.875,00               | 0,40                         |                    |  |                            |                              |
| 710.000,00         | Triton Water Holdings Inc 6.25% 01-04-2029     | 685.150,00                 | 0,10                         |                    |  |                            |                              |
| 1.657.000,00       | Triumph Group Inc 6.25% 15-09-2024             | 1.667.356,25               | 0,25                         |                    |  |                            |                              |
| 1.336.000,00       | Triumph Group Inc 8.875% 01-06-2024            | 1.461.744,32               | 0,22                         |                    |  |                            |                              |
| 2.620.000,00       | Uber Technologies Inc 6.25% 15-01-2028         | 2.803.400,00               | 0,42                         |                    |  |                            |                              |
| 745.000,00         | Uber Technologies Inc 7.5% 15-05-2025          | 784.563,23                 | 0,12                         |                    |  |                            |                              |
| 1.350.000,00       | Uber Technologies Inc 7.5% 15-09-2027          | 1.464.871,50               | 0,22                         |                    |  |                            |                              |
| 685.000,00         | United Airlines Inc 4.375% 15-04-2026          | 711.543,75                 | 0,11                         |                    |  |                            |                              |
| 840.000,00         | Univision Communications Inc 4.5% 01-05-2029   | 848.400,00                 | 0,13                         |                    |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US High Yield Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| Land                   |              | Sektor               |              |
|------------------------|--------------|----------------------|--------------|
| USA                    | 81,57        | Unternehmensanleihen | 95,44        |
| Kanada                 | 4,63         |                      |              |
| Niederlande            | 1,86         |                      |              |
| Länderübergreifend     | 1,82         |                      |              |
| Frankreich             | 1,53         |                      |              |
| Luxemburg              | 1,25         |                      |              |
| Vereinigtes Königreich | 1,05         |                      |              |
| Italien                | 0,43         |                      |              |
| Panama                 | 0,40         |                      |              |
| Deutschland            | 0,35         |                      |              |
| Liberia                | 0,26         |                      |              |
| Finnland               | 0,20         |                      |              |
| Kaimaninseln           | 0,08         |                      |              |
| <b>Summe</b>           | <b>95,44</b> | <b>Summe</b>         | <b>95,44</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - US High Yield Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 1.264.749,489,18                                  | DKK               | 191.597,418,63     | USD                | 1.151.775,35   | 28.01.2022 |
| 135.254.411,28                                    | EUR               | 152.374.636,85     | USD                | 906.080,23   | 28.01.2022 |
| 254.253.468,15                                    | NOK               | 28.395.249,74      | USD                | 434.553,93   | 28.01.2022 |
| 1.176.162,52                                      | PLN               | 279.992,82         | USD                | 9.310,33   | 28.01.2022 |
| 1.953.204.735,79                                  | SEK               | 217.184.583,24     | USD                | (1.342.575,59)   | 28.01.2022 |
| 3.099.443,06                                      | USD               | 20.472.280,01      | DKK                | (20.554,54)  | 28.01.2022 |
| 1.980.870,22                                      | USD               | 1.761.175,21       | EUR                | (15.029,04)  | 28.01.2022 |
| 456.371,52  | USD               | 4.114.888,73       | NOK                | (10.215,62)  | 28.01.2022 |
| 3.065,43  | USD               | 12.831,85          | PLN                | (90,85)  | 28.01.2022 |
| 6.735.383,63                                      | USD               | 61.114.941,20      | SEK                | (18.218,07)  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>1.095.036,13</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.



# Nordea 1 - US Total Return Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD)

| Anzahl/<br>Nominal  | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse notiert sind</b> |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 5.000.000,00  | United States Treasury Note/ 1.375% 15-11-2031 | 4.940.625,00               | 0,70                         | 20.000.000,00      | CHL Mortgage Pass-Through Tr 6% 25-01-2038    | 2.049.258,08               | 0,29                         |
| 28.000.000,00   | United States Treasury Note/ 1.875% 15-11-2051 | 27.776.875,00              | 3,93                         | 27.240.000,00      | CHL Mortgage Pass-Through Tr 6% 25-03-2037    | 1.109.468,35               | 0,16                         |
| 31.000.000,00   | United States Treasury Note/ 2.375% 15-05-2051 | 34.240.468,75              | 4,85                         | 67.579.000,00      | CHL Mortgage Pass-Through Tr 6% 25-04-2037    | 3.159.639,43               | 0,45                         |
|   |  | <b>66.957.968,75</b>       | <b>9,48</b>                  | 10.000.000,00      | CHL Mortgage Pass-Through Tr 6% 25-05-2036    | 393.613,26                 | 0,06                         |
|   |  |                            |                              | 18.000.000,00      | CHL Mortgage Pass-Through Tr 6% 25-05-2037    | 2.028.676,65               | 0,29                         |
|   |  |                            |                              | 20.000.000,00      | CHL Mortgage Pass-Through Tr 6% 25-08-2037    | 1.125.205,84               | 0,16                         |
|   |  |                            |                              | 8.933.000,00       | CHL Mortgage Pass-Through Tr 6% 25-08-2037    | 693.092,98                 | 0,10                         |
|   |  | <b>66.957.968,75</b>       | <b>9,48</b>                  | 26.046.000,00      | CHL Mortgage Pass-Through Tr FRN 20-02-2036   | 1.920.460,15               | 0,27                         |
|   |  |                            |                              | 30.000.000,00      | CHL Mortgage Pass-Through Tr MULTI 20-05-2036 | 2.012.642,27               | 0,29                         |
|   |  |                            |                              | 46.000.000,00      | CHL Mortgage Pass-Through Tr MULTI 25-03-2037 | 5.814.237,52               | 0,82                         |
|   |  |                            |                              | 24.774.000,00      | Citigroup Commercial Mortgag MULTI 10-02-2049 | 911.832,23                 | 0,13                         |
|   |  |                            |                              | 1.440.000,00       | Citigroup Commercial Mortgag MULTI 10-06-2048 | 1.471.316,83               | 0,21                         |
|   |  |                            |                              | 3.000.000,00       | Citigroup Commercial Mortgag MULTI 10-09-2058 | 2.970.747,00               | 0,42                         |
|   |  |                            |                              | 10.769.000,00      | Citigroup Mortgage Loan Trus 5.75% 25-04-2047 | 1.714.431,10               | 0,24                         |
|   |  |                            |                              | 20.000.000,00      | Citigroup Mortgage Loan Trus 6.5% 25-06-2037  | 1.277.049,91               | 0,18                         |
|   |  |                            |                              | 5.600.000,00       | Citigroup Mortgage Loan Trus MULTI 25-10-2036 | 1.786.997,25               | 0,25                         |
|   |  |                            |                              | 3.204.000,00       | Comm 2013-CCRE13 Mortgage Tr MULTI 10-11-2046 | 3.333.496,71               | 0,47                         |
|   |  |                            |                              | 2.566.000,00       | COMM 2015-CCRE26 Mortgage Tr MULTI 10-10-2048 | 2.697.807,98               | 0,38                         |
|   |  |                            |                              | 40.000.000,00      | COMM 2015-DC1 Mortgage Trust MULTI 10-02-2048 | 686.977,24                 | 0,10                         |
|   |  |                            |                              | 2.301.000,00       | COMM 2016-CR28 Mortgage Trus MULTI 10-02-2049 | 2.429.650,75               | 0,34                         |
|   |  |                            |                              | 23.817.000,00      | COMM 2016-DC2 Mortgage Trust MULTI 10-02-2049 | 604.380,48                 | 0,09                         |
|   |  |                            |                              | 1.484.000,00       | COMM 2016-DC2 Mortgage Trust MULTI 10-02-2049 | 1.544.028,99               | 0,22                         |
|   |  |                            |                              | 1.003.000,00       | COMM 2017-PANW Mortgage Trus MULTI 10-10-2029 | 1.014.133,60               | 0,14                         |
|   |  |                            |                              | 1.674.000,00       | COMM 2017-PANW Mortgage Trus MULTI 10-10-2029 | 1.655.060,70               | 0,23                         |
|   |  |                            |                              | 10.000.000,00      | Commonbond Student Loan Trus 3.32% 25-05-2040 | 1.517.083,64               | 0,21                         |
|   |  |                            |                              | 45.000.000,00      | CSAIL 2015-C1 Commercial Mor MULTI 15-04-2050 | 781.622,04                 | 0,11                         |
|   |  |                            |                              | 43.338.000,00      | CSAIL 2015-C4 Commercial Mor MULTI 15-11-2048 | 1.034.977,25               | 0,15                         |
|   |  |                            |                              | 13.694.000,00      | CSAIL 2017-CX9 Commercial Mo MULTI 15-09-2050 | 267.931,22                 | 0,04                         |
|   |  |                            |                              | 500.000,00         | CSMC Mortgage-Backed Trust 2 6% 25-02-2037    | 63.061,86                  | 0,01                         |
|   |  |                            |                              | 1.500.000,00       | CSMC Mortgage-Backed Trust 2 6% 25-04-2037    | 65.592,91                  | 0,01                         |
|   |  |                            |                              | 9.367.000,00       | CSMC Mortgage-Backed Trust 2 6.25% 25-08-2036 | 487.722,51                 | 0,07                         |
|   |  |                            |                              | 9.175.000,00       | CSMC Trust 2013-9R MULTI 27-05-2043           | 1.434.705,97               | 0,20                         |
|   |  |                            |                              | 33.824.666,00      | Deutsche Alt-A Securities Mo FRN 25-10-2047   | 5.792.230,31               | 0,82                         |
|   |  |                            |                              | 12.000.000,00      | Fannie Mae Pool 1.895% 01-05-2030             | 12.120.590,64              | 1,72                         |
|   |  |                            |                              | 5.400.000,00       | Fannie Mae Pool 2.5% 01-04-2051               | 5.123.761,46               | 0,73                         |
|   |  |                            |                              | 10.023.024,00      | Fannie Mae Pool 2.5% 01-09-2051               | 10.187.516,18              | 1,44                         |
|   |  |                            |                              | 10.000.000,00      | Fannie Mae Pool 2.5% 01-10-2050               | 8.992.125,53               | 1,27                         |
|   |  |                            |                              | 7.500.000,00       | Fannie Mae Pool 2.5% 01-10-2051               | 7.658.486,36               | 1,08                         |
|   |  |                            |                              | 21.909.707,00      | Fannie Mae Pool 3% 01-01-2033                 | 4.936.059,77               | 0,70                         |
|   |  |                            |                              | 22.000.000,00      | Fannie Mae Pool 3% 01-02-2043                 | 6.925.184,43               | 0,98                         |
|   |  |                            |                              | 25.324.033,00      | Fannie Mae Pool 3% 01-03-2053                 | 8.457.167,74               | 1,20                         |
|   |  |                            |                              | 4.000.000,00       | Fannie Mae Pool 3% 01-04-2038                 | 948.074,42                 | 0,13                         |
|   |  |                            |                              | 3.000.000,00       | Fannie Mae Pool 3% 01-10-2032                 | 621.524,10                 | 0,09                         |
|   |  |                            |                              | 5.700.000,00       | Fannie Mae Pool 3.145% 01-08-2034             | 6.328.254,57               | 0,90                         |
|   |  |                            |                              | 15.000.000,00      | Fannie Mae Pool 3.5% 01-02-2046               | 2.026.164,63               | 0,29                         |
|   |  |                            |                              | 1.000.000,00       | Fannie Mae Pool 3.5% 01-07-2032               | 168.147,81                 | 0,02                         |
|   |  |                            |                              | 16.500.000,00      | Fannie Mae Pool 3.5% 01-07-2042               | 4.668.615,99               | 0,66                         |
|   |  |                            |                              | 27.868.027,00      | Fannie Mae Pool 3.5% 01-08-2045               | 11.539.275,13              | 1,63                         |
|   |  |                            |                              | 17.592.894,00      | Fannie Mae Pool 3.5% 01-10-2042               | 1.379.396,17               | 0,20                         |
| <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                   |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>Anleihen</b>   |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| <b>USD</b>  |  |                            |                              |                    |   |                            |                              |
| 1.237.000,00  | 20 Times Square Trust 2018-2 MULTI 15-05-2035  | 1.167.974,53               | 0,17                         |                    |   |                            |                              |
| 1.181.000,00  | 20 Times Square Trust 2018-2 MULTI 15-05-2035  | 1.099.026,08               | 0,16                         |                    |   |                            |                              |
| 20.304.000,00   | Alternative Loan Trust 2006- 6% 25-02-2037     | 1.482.884,45               | 0,21                         |                    |   |                            |                              |
| 55.406.000,00   | Alternative Loan Trust 2006- 6% 25-02-2037     | 2.513.959,91               | 0,36                         |                    |   |                            |                              |
| 24.000.000,00   | Alternative Loan Trust 2006- 6% 25-06-2036     | 2.449.190,66               | 0,35                         |                    |   |                            |                              |
| 18.000.000,00   | Alternative Loan Trust 2006- 6% 25-07-2036     | 2.776.045,65               | 0,39                         |                    |   |                            |                              |
| 50.236.000,00   | Alternative Loan Trust 2006- 6.5% 25-08-2036   | 2.937.535,21               | 0,42                         |                    |   |                            |                              |
| 13.000.000,00   | Alternative Loan Trust 2006- FRN 20-05-2046    | 1.717.394,11               | 0,24                         |                    |   |                            |                              |
| 22.410.000,00   | Alternative Loan Trust 2007- 5.75% 25-03-2037  | 1.900.547,80               | 0,27                         |                    |   |                            |                              |
| 14.000.000,00   | Alternative Loan Trust 2007- 6.5% 25-11-2037   | 1.733.077,43               | 0,25                         |                    |   |                            |                              |
| 25.798.000,00   | Alternative Loan Trust 2007- FRN 25-03-2047    | 2.629.067,39               | 0,37                         |                    |   |                            |                              |
| 43.564.000,00   | Alternative Loan Trust 2007- MULTI 25-03-2047  | 4.369.034,00               | 0,62                         |                    |   |                            |                              |
| 1.750.000,00  | American Airlines 2017-2 Cla 3.7% 15-10-2025   | 1.090.460,10               | 0,15                         |                    |   |                            |                              |
| 7.500.000,00  | Aqua Finance Trust 2017-A 3.72% 15-11-2035     | 1.561.806,65               | 0,22                         |                    |   |                            |                              |
| 3.204.000,00  | Atrium Hotel Portfolio Trust FRN 15-06-2035    | 3.115.512,89               | 0,44                         |                    |   |                            |                              |
| 2.658.000,00  | Atrium Hotel Portfolio Trust FRN 15-12-2036    | 2.511.130,08               | 0,36                         |                    |   |                            |                              |
| 5.000.000,00  | Banc of America Alternative 5.5% 25-11-2035    | 550.850,82                 | 0,08                         |                    |   |                            |                              |
| 10.000.000,00   | Banc of America Alternative 5.75% 25-12-2035   | 1.171.037,50               | 0,17                         |                    |   |                            |                              |
| 15.000.000,00   | Banc of America Alternative 6% 25-12-2035      | 1.017.106,04               | 0,14                         |                    |   |                            |                              |
| 20.400.000,00   | Banc of America Mortgage 200 6% 25-05-2037     | 2.600.150,72               | 0,37                         |                    |   |                            |                              |
| 1.391.000,00  | BANK 2017-BNK4 MULTI 15-05-2050                | 1.461.298,22               | 0,21                         |                    |   |                            |                              |
| 44.990.000,00   | BANK 2018-BNK10 MULTI 15-02-2061               | 1.641.312,57               | 0,23                         |                    |   |                            |                              |
| 5.269.567,00  | BCAP LLC 2010-RR6 Trust MULTI 26-06-2036       | 3.429.429,81               | 0,49                         |                    |   |                            |                              |
| 855.000,00  | BX Trust 2017-SLCT FRN 15-07-2034              | 104.266,06                 | 0,01                         |                    |   |                            |                              |
| 1.448.000,00  | BX Trust 2017-SLCT FRN 15-07-2034              | 1.230.400,36               | 0,17                         |                    |   |                            |                              |
| 29.160.000,00   | CFCRE Commercial Mortgage Tr MULTI 10-01-2048  | 939.000,51                 | 0,13                         |                    |   |                            |                              |
| 13.000.000,00   | Chase Mortgage Finance Trust 6% 25-02-2037     | 1.344.413,90               | 0,19                         |                    |   |                            |                              |
| 50.000.000,00   | Chase Mortgage Finance Trust MULTI 25-07-2037  | 1.967.500,70               | 0,28                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US Total Return Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                 | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|
| 9.733.313,00       | Fannie Mae Pool 3.79% 01-01-2029             | 10.580.872,18              | 1,50                         | 837.593,00         | Government National Mortgage 4.5% 20-11-2039               | 325.516,86                 | 0,05                         |
| 30.000.000,00      | Fannie Mae Pool 4% 01-11-2041                | 3.014.005,61               | 0,43                         | 6.000.000,00       | Government National Mortgage FRN 20-02-2040                | 65.204,45                  | 0,01                         |
| 14.901.114,00      | Fannie Mae Pool 4% 01-12-2044                | 3.835.360,74               | 0,54                         | 30.064.527,00      | Government National Mortgage FRN 20-02-2044                | 612.231,79                 | 0,09                         |
| 17.723.967,00      | Fannie Mae REMICS 2.5% 25-04-2034            | 18.082.402,33              | 2,56                         | 22.185.750,00      | Government National Mortgage FRN 20-04-2043                | 333.491,62                 | 0,05                         |
| 6.684.317,00       | Fannie Mae REMICS 3% 25-01-2041              | 267.179,63                 | 0,04                         | 1.400.000,00       | Government National Mortgage FRN 20-05-2040                | 11.959,42                  | 0,00                         |
| 30.000.000,00      | Fannie Mae REMICS 3% 25-01-2046              | 3.201.898,82               | 0,45                         | 75.000.000,00      | Government National Mortgage FRN 20-07-2043                | 852.375,25                 | 0,12                         |
| 12.523.000,00      | Fannie Mae REMICS 3% 25-02-2043              | 974.159,09                 | 0,14                         | 18.441.000,00      | Government National Mortgage FRN 20-12-2050                | 3.350.631,65               | 0,47                         |
| 4.789.891,00       | Fannie Mae REMICS 3.5% 25-03-2041            | 733.268,84                 | 0,10                         | 27.687.000,00      | Government National Mortgage MULTI 16-02-2063              | 2.061.380,67               | 0,29                         |
| 10.000.000,00      | Fannie Mae REMICS 3.5% 25-05-2041            | 1.525.004,32               | 0,22                         | 27.215.000,00      | Government National Mortgage MULTI 16-04-2063              | 1.798.502,54               | 0,25                         |
| 6.114.793,00       | Fannie Mae REMICS 4% 25-11-2041              | 2.149.108,43               | 0,30                         | 27.098.000,00      | Government National Mortgage MULTI 16-10-2062              | 2.077.771,11               | 0,29                         |
| 15.160.000,00      | Fannie Mae REMICS 4.5% 25-07-2040            | 970.444,60                 | 0,14                         | 24.850.000,00      | Government National Mortgage MULTI 16-12-2062              | 2.014.553,02               | 0,29                         |
| 828.000,00         | Fannie Mae REMICS 4.5% 25-12-2041            | 922.690,91                 | 0,13                         | 600.000,00         | GS Mortgage Securities Corp FRN 15-07-2031                 | 578.802,72                 | 0,08                         |
| 96.857.142,00      | Fannie Mae REMICS FRN 25-10-2036             | 528.492,47                 | 0,07                         | 600.000,00         | GS Mortgage Securities Corp FRN 15-07-2031                 | 578.978,46                 | 0,08                         |
| 74.360.367,00      | Fannie Mae REMICS FRN 25-10-2040             | 552.196,78                 | 0,08                         | 600.000,00         | GS Mortgage Securities Corp FRN 15-07-2031                 | 570.913,74                 | 0,08                         |
| 16.828.000,00      | Fannie Mae-Aces MULTI 25-09-2031             | 1.991.412,82               | 0,28                         | 600.000,00         | GS Mortgage Securities Corp FRN 15-07-2031                 | 521.709,90                 | 0,07                         |
| 27.488.437,00      | First Horizon Alternative Mo 5.5% 25-04-2037 | 1.193.689,87               | 0,17                         | 600.000,00         | GS Mortgage Securities Corp FRN 15-07-2031                 | 260.335,68                 | 0,04                         |
| 15.000.000,00      | First Horizon Alternative Mo FRN 25-08-2037  | 1.947.385,47               | 0,28                         | 261.000,00         | GS Mortgage Securities Corp FRN 15-07-2031                 | 742.193,85                 | 0,11                         |
| 18.000.000,00      | Freddie Mac Gold Pool 3% 01-01-2033          | 4.054.124,46               | 0,57                         | 40.960.000,00      | GS Mortgage Securities Trust MULTI 10-02-2048              | 1.092.404,65               | 0,15                         |
| 24.096.200,00      | Freddie Mac Gold Pool 3% 01-05-2045          | 5.871.953,93               | 0,83                         | 32.250.000,00      | GS Mortgage Securities Trust MULTI 10-10-2048              | 1.193.052,65               | 0,17                         |
| 36.158.489,00      | Freddie Mac Gold Pool 3.5% 01-02-2046        | 10.873.319,57              | 1,54                         | 30.424.000,00      | GS Mortgage Securities Trust MULTI 10-10-2049              | 2.128.551,80               | 0,30                         |
| 15.036.173,00      | Freddie Mac Gold Pool 3.5% 01-03-2046        | 6.165.701,33               | 0,87                         | 2.000.000,00       | GS Mortgage Securities Trust MULTI 10-11-2048              | 2.807.054,11               | 0,40                         |
| 8.644.836,00       | Freddie Mac Gold Pool 3.5% 01-10-2042        | 1.194.328,47               | 0,17                         | 2.650.000,00       | GS Mortgage Securities Trust MULTI 10-11-2050              | 3.554.096,75               | 0,50                         |
| 25.000.000,00      | Freddie Mac Gold Pool 4% 01-04-2026          | 1.033.779,40               | 0,15                         | 55.698.800,00      | HarborView Mortgage Loan Tru FRN 19-05-2046                | 2.495.690,00               | 0,35                         |
| 7.876.324,00       | Freddie Mac Gold Pool 4% 01-08-2043          | 2.007.480,78               | 0,28                         | 1.417.000,00       | HAYFN 2018-8A A Hilton USA Trust 2016-HHV MULTI 05-11-2038 | 1.468.396,15               | 0,21                         |
| 8.517.393,00       | Freddie Mac Gold Pool 4% 01-09-2043          | 2.899.790,12               | 0,41                         | 45.000.000,00      | IndyMac IMSC Mortgage Loan T MULTI 25-06-2037              | 5.204.879,35               | 0,74                         |
| 8.023.731,00       | Freddie Mac Gold Pool 4% 01-12-2043          | 2.103.945,67               | 0,30                         | 18.362.000,00      | IndyMac INDA Mortgage Loan T MULTI 25-07-2037              | 1.254.206,66               | 0,18                         |
| 4.241.150,00       | Freddie Mac Gold Pool 4% 01-12-2043          | 530.243,23                 | 0,08                         | 3.127.500,00       | JP Morgan Alternative Loan T 5.5% 25-12-2035               | 406.493,74                 | 0,06                         |
| 9.000.000,00       | Freddie Mac Pool 2% 01-10-2051               | 8.855.196,24               | 1,25                         | 23.512.800,00      | JP Morgan Alternative Loan T 6% 25-03-2036                 | 3.577.059,16               | 0,51                         |
| 15.000.000,00      | Freddie Mac Pool 2% 01-11-2050               | 14.677.916,44              | 2,08                         | 14.000.000,00      | JP Morgan Alternative Loan T MULTI 25-11-2036              | 1.829.752,56               | 0,26                         |
| 9.500.000,00       | Freddie Mac Pool 2.5% 01-10-2050             | 8.240.305,05               | 1,17                         | 12.584.000,00      | JP Morgan Alternative Loan T MULTI 25-12-2036              | 4.682.502,93               | 0,66                         |
| 9.000.000,00       | Freddie Mac REMICS 2% 15-05-2041             | 165.366,13                 | 0,02                         | 1.357.000,00       | JP Morgan Chase Commercial M FRN 15-06-2032                | 86.180,54                  | 0,01                         |
| 20.235.518,00      | Freddie Mac REMICS 2.5% 15-09-2044           | 24.613.509,49              | 3,49                         | 20.190.000,00      | JP Morgan Mortgage Trust 200 6% 25-03-2037                 | 2.718.288,92               | 0,39                         |
| 10.600.000,00      | Freddie Mac REMICS 3% 15-07-2043             | 14.095.251,05              | 2,00                         | 840.000,00         | JP Morgan Mortgage Trust 200 6% 25-08-2037                 | 61.730,56                  | 0,01                         |
| 9.000.000,00       | Freddie Mac REMICS 3% 15-08-2040             | 560.119,23                 | 0,08                         | 2.000.000,00       | JPMBB Commercial Mortgage Se 3.986% 15-10-2048             | 2.018.716,00               | 0,29                         |
| 19.781.960,00      | Freddie Mac REMICS 3% 15-09-2044             | 26.217.528,81              | 3,71                         | 2.566.000,00       | JPMBB Commercial Mortgage Se MULTI 15-03-2049              | 2.715.234,97               | 0,38                         |
| 2.000.000,00       | Freddie Mac REMICS 4% 15-02-2031             | 1.646.550,88               | 0,23                         | 1.493.000,00       | JPMBB Commercial Mortgage Se MULTI 15-09-2050              | 1.540.628,34               | 0,22                         |
| 650.561,00         | Freddie Mac REMICS 4% 15-03-2041             | 305.117,31                 | 0,04                         | 25.812.000,00      | JPMBB Commercial Mortgage Se MULTI 15-06-2049              | 1.016.961,16               | 0,14                         |
| 14.785.586,00      | Freddie Mac REMICS 4% 15-10-2041             | 2.049.876,54               | 0,29                         | 6.000.000,00       | Laurel Road Prime Student Lo 3.72% 26-05-2043              | 3.333.702,49               | 0,47                         |
| 512.000,00         | Freddie Mac REMICS 4.5% 15-05-2041           | 927.350,84                 | 0,13                         | 12.500.000,00      | Lehman Mortgage Trust 2006-1 5.5% 25-02-2036               | 1.624.434,78               | 0,23                         |
| 927.924,00         | Freddie Mac REMICS FRN 15-09-2040            | 5.538,57                   | 0,00                         | 5.596.000,00       | Lehman Mortgage Trust 2006-6 6% 25-12-2036                 | 121.430,04                 | 0,02                         |
| 7.100.000,00       | Ginnie Mae II Pool 2.5% 20-08-2051           | 7.214.473,24               | 1,02                         | 50.457.000,00      | Lehman XS Trust Series 2006-FRN 25-04-2046                 | 6.019.331,63               | 0,85                         |
| 5.250.000,00       | Ginnie Mae II Pool 2.5% 20-10-2051           | 5.395.463,64               | 0,76                         | 4.500.000,00       | MAPS 2018-1 Ltd 4.212% 15-05-2043                          | 2.941.870,96               | 0,42                         |
| 20.034.000,00      | Government National Mortgage 2.5% 20-02-2051 | 2.783.213,32               | 0,39                         |                    |  |                            |                              |
| 21.094.000,00      | Government National Mortgage 2.5% 20-10-2050 | 2.306.518,80               | 0,33                         |                    |  |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.  
Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US Total Return Bond Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte per 31.12.2021 (in USD) (Fortsetzung)

| Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung                                   | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens | Anzahl/<br>Nominal | Beschreibung  | Marktwert<br>(Anmerkung 2) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--|----------------------------|------------------------------|--------------------|---|----------------------------|------------------------------|
| 23.959.000,00      | MASTR Asset Securitization T 6.5% 25-11-2037   | 724.952,52                 | 0,10                         | 45.000.000,00      | Washington Mutual Mortgage P 6% 25-04-2037  | 3.389.063,67               | 0,48                         |
| 2.000.000,00       | Morgan Stanley Bank of Ameri 4% 15-12-2047     | 2.061.401,80               | 0,29                         | 3.000.000,00       | Washington Mutual Mortgage P 6.5% 25-03-2036  | 364.053,92                 | 0,05                         |
| 28.873.000,00      | Morgan Stanley Bank of Ameri MULTI 15-01-2049  | 864.792,52                 | 0,12                         | 3.500.000,00       | Washington Mutual Mortgage P MULTI 25-10-2036   | 700.344,63                 | 0,10                         |
| 40.000.000,00      | Morgan Stanley Bank of Ameri MULTI 15-02-2046  | 219.816,38                 | 0,03                         | 10.000.000,00      | WELF 2018-3A A1A  | 10.003.960,00              | 1,42                         |
| 20.612.000,00      | Morgan Stanley Bank of Ameri MULTI 15-09-2049  | 991.904,06                 | 0,14                         | 12.500.000,00      | Wells Fargo Alternative Loan 6% 25-03-2037  | 1.198.665,71               | 0,17                         |
| 3.200.000,00       | Morgan Stanley Bank of Ameri MULTI 15-10-2048  | 3.347.957,76               | 0,47                         | 1.500.000,00       | Wells Fargo Alternative Loan 6% 25-07-2037  | 112.276,09                 | 0,02                         |
| 2.000.000,00       | Morgan Stanley Capital I Tru MULTI 11-07-2040  | 1.781.159,60               | 0,25                         | 1.300.000,00       | Wells Fargo Commercial Mortg 3.894% 15-02-2048  | 1.280.566,56               | 0,18                         |
| 1.764.000,00       | Morgan Stanley Capital I Tru MULTI 15-12-2048  | 1.812.409,63               | 0,26                         | 1.793.000,00       | Wells Fargo Commercial Mortg 3.896% 15-03-2059  | 1.837.773,00               | 0,26                         |
| 1.860.000,00       | Morgan Stanley Mortgage Loan 6% 25-02-2036     | 75.173,70                  | 0,01                         | 2.239.000,00       | Wells Fargo Commercial Mortg 3.959% 15-12-2047  | 2.323.099,30               | 0,33                         |
| 49.500.000,00      | Morgan Stanley Mortgage Loan 6.25% 25-08-2037  | 2.322.317,28               | 0,33                         | 1.400.000,00       | Wells Fargo Commercial Mortg 4.591% 15-01-2060  | 1.496.476,10               | 0,21                         |
| 24.325.000,00      | Morgan Stanley Mortgage Loan MULTI 25-05-2036  | 2.705.113,20               | 0,38                         | 45.000.000,00      | Wells Fargo Commercial Mortg MULTI 15-02-2048   | 767.314,86                 | 0,11                         |
| 20.000.000,00      | Morgan Stanley Mortgage Loan MULTI 25-10-2037  | 1.208.469,88               | 0,17                         | 18.580.000,00      | Wells Fargo Commercial Mortg MULTI 15-03-2059   | 774.108,50                 | 0,11                         |
| 26.951.000,00      | Morgan Stanley Mortgage Loan MULTI 25-11-2035  | 1.935.379,21               | 0,27                         | 35.000.000,00      | Wells Fargo Commercial Mortg MULTI 15-04-2050   | 917.347,18                 | 0,13                         |
| 14.000.000,00      | National Collegiate Student FRN 25-03-2033     | 5.714.767,20               | 0,81                         | 35.000.000,00      | Wells Fargo Commercial Mortg MULTI 15-05-2048   | 711.210,76                 | 0,10                         |
| 3.210.000,00       | Natis Commercial Mortgage FRN 15-06-2035       | 2.488.075,80               | 0,35                         | 432.000,00         | Wells Fargo Commercial Mortg MULTI 15-06-2049   | 408.933,84                 | 0,06                         |
| 15.000.000,00      | PR Mortgage Loan Trust 2014-MULTI 25-10-2049   | 6.695.842,32               | 0,95                         | 99.000.000,00      | Wells Fargo Mortgage Backed MULTI 25-10-2036  | 2.634.621,00               | 0,37                         |
| 15.000.000,00      | Prime Mortgage Trust 2007-1 5.5% 25-03-2037    | 1.761.040,84               | 0,25                         | 2.277.000,00       | WFRBS Commercial Mortgage Tr MULTI 15-10-2057   | 2.242.735,48               | 0,32                         |
| 1.000.000,00       | RALI Series 2005-QS10 Trust 6% 25-08-2035      | 40.747,22                  | 0,01                         | 29.474.600,00      | WFRBS Commercial Mortgage Tr MULTI 15-11-2047   | 482.289,19                 | 0,07                         |
| 1.675.000,00       | RALI Series 2005-QS15 Trust 6% 25-10-2035      | 123.048,29                 | 0,02                         |                    |   | <b>606.267.739,50</b>      | <b>85,88</b>                 |
| 20.000.000,00      | RALI Series 2006-QS13 Trust 6% 25-09-2036      | 2.024.956,61               | 0,29                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>606.267.739,50</b>      | <b>85,88</b>                 |
| 16.922.000,00      | RALI Series 2007-QS1 Trust 6% 25-01-2037       | 2.701.546,43               | 0,38                         |                    | <b>Summe an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> | <b>606.267.739,50</b>      | <b>85,88</b>                 |
| 2.030.000,00       | RALI Series 2007-QS1 Trust 6% 25-01-2037       | 133.227,13                 | 0,02                         |                    | <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |                            |                              |
| 75.000.000,00      | RBSGC Mortgage Loan Trust 20 6% 25-01-2037     | 1.913.023,28               | 0,27                         |                    | <b>Anleihen</b>   |                            |                              |
| 16.424.000,00      | Residential Asset Securitiza 6.25% 25-07-2036  | 3.537.417,38               | 0,50                         |                    | <b>USD</b>  |                            |                              |
| 32.500.000,00      | RFMSI Series 2006-S3 Trust 5.5% 25-03-2036     | 980.882,34                 | 0,14                         | 1.000.000,00       | Alternative Loan Trust 2007- 5.5% 25-05-2022  | 34,72                      | 0,00                         |
| 4.000.000,00       | RFMSI Series 2006-S6 Trust 6% 25-07-2036       | 418.251,45                 | 0,06                         | 5.500.000,00       | Blackbird Capital Aircraft L MULTI 16-12-2041   | 3.744.321,48               | 0,53                         |
| 1.000.000,00       | RFMSI Series 2007-S4 Trust 6% 25-04-2037       | 78.981,83                  | 0,01                         | 1.000.000,00       | MASTR Adjustable Rate Mortga FRN 25-03-2047   | 0,00                       | 0,00                         |
| 19.400.000,00      | RFMSI Series 2007-S7 Trust 6% 25-07-2037       | 1.411.005,04               | 0,20                         | 1.500.000,00       | Morgan Stanley Re-REMIC Trus 0.500001% 17-12-2049   | 0,00                       | 0,00                         |
| 1.300.000,00       | SG Commercial Mortgage Secur 3.933% 10-10-2048 | 1.333.200,44               | 0,19                         | 2.000.000,00       | Thunderbolt Aircraft Lease L MULTI 17-05-2032   | 1.130.849,44               | 0,16                         |
| 20.000.000,00      | Shenton Aircraft Investment 4.75% 15-10-2042   | 8.200.140,77               | 1,16                         |                    |   | <b>4.875.205,64</b>        | <b>0,69</b>                  |
| 6.000.000,00       | SNDPT 2014-2RA A                               | 6.002.364,00               | 0,85                         |                    | <b>Summe Anleihen</b>   | <b>4.875.205,64</b>        | <b>0,69</b>                  |
| 2.565.000,00       | Sofi Consumer Loan Program 2 3.97% 25-02-2027  | 2.587.890,57               | 0,37                         |                    | <b>Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                     | <b>4.875.205,64</b>        | <b>0,69</b>                  |
| 2.500.000,00       | SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGR 3.62% 25-01-2041  | 2.578.807,25               | 0,37                         |                    | <b>Summe Wertpapieranlagen</b>  | <b>678.100.913,89</b>      | <b>96,06</b>                 |
| 19.909.000,00      | STARM Mortgage Loan Trust 20 MULTI 25-04-2037  | 831.016,34                 | 0,12                         |                    | <b>Bankguthaben</b>   | <b>26.322.326,06</b>       | <b>3,73</b>                  |
| 2.500.000,00       | STCR 2018-2A A                                 | 2.500.115,00               | 0,35                         |                    | <b>Sonstige Nettovermögenswerte</b>   | <b>1.521.058,54</b>        | <b>0,22</b>                  |
| 14.000.000,00      | Structured Adjustable Rate M MULTI 25-09-2036  | 1.096.540,10               | 0,16                         |                    | <b>Summe Nettovermögen</b>  | <b>705.944.298,49</b>      | <b>100,00</b>                |
| 8.000.000,00       | Structured Adjustable Rate M MULTI 25-09-2037  | 549.567,62                 | 0,08                         |                    |   |                            |                              |
| 13.746.000,00      | Suntrust Alternative Loan Tr 6% 25-12-2035     | 811.121,64                 | 0,11                         |                    |   |                            |                              |
| 30.000.000,00      | TBW Mortgage-Backed Pass-Thr 5.5% 25-04-2036   | 1.074.115,04               | 0,15                         |                    |   |                            |                              |
| 1.017.000,00       | UBS Commercial Mortgage Trus MULTI 15-12-2050  | 1.082.294,55               | 0,15                         |                    |   |                            |                              |
| 1.085.000,00       | UBS Commercial Mortgage Trus MULTI 15-12-2051  | 1.123.627,95               | 0,16                         |                    |   |                            |                              |
| 10.000.000,00      | VENTR 2014-19A ARR                             | 10.023.950,00              | 1,42                         |                    |   |                            |                              |
| 20.020.000,00      | Washington Mutual Mortgage P 6% 25-03-2036     | 2.400.856,57               | 0,34                         |                    |   |                            |                              |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt. Die beiliegenden Anmerkungen sind Bestandteil des Abschlusses.

# Nordea 1 - US Total Return Bond Fund

## Aufgliederung der Wertpapieranlagen nach Ländern und Sektoren per 31.12.2021 (in % des Nettovermögens)

| <b>Land</b>  |              | <b>Sektor</b>               |              |
|--------------|--------------|-----------------------------|--------------|
| USA          | 89,39        | Unternehmensanleihen        | 51,35        |
| Kaimaninseln | 6,25         | Kündbare Hypothekenanleihen | 26,52        |
| Bermuda      | 0,42         | Staatsanleihen              | 9,48         |
|              |              | Hypothekenanleihen          | 8,70         |
| <b>Summe</b> | <b>96,06</b> | <b>Summe</b>                | <b>96,06</b> |

Differenzen in den Prozentsätzen des Nettovermögens sind rundungsbedingt.

# Nordea 1 - US Total Return Bond Fund

## Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente

### Devisenterminkontrakte

| Erworbener Betrag                                 | Erworbene Währung | Veräußerter Betrag | Veräußerte Währung | Nicht realisierte(r) Wertzuwachs (Wertminderung) im Teilfonds Basiswährung (USD) | Fälligkeit |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--|------------|
| <b>Anteilsklassenabsicherung:</b>                 |                   |                    |                    |  |            |
| <b>Gegenpartei: JPMorgan Chase Bank NA/London</b> |                   |                    |                    |  |            |
| 967.813,58  | CHF               | 1.039.390,41       | USD                | 22.623,51  | 28.01.2022 |
| 101.720.503,49                                    | EUR               | 114.588.873,91     | USD                | 688.635,61   | 28.01.2022 |
| 15.686.873,53                                     | GBP               | 20.955.175,10      | USD                | 194.275,78   | 28.01.2022 |
| 6.776,03  | USD               | 6.196,60           | CHF                | (23,71)  | 28.01.2022 |
| 6.572.849,63                                      | USD               | 5.809.492,82       | EUR                | (10.916,22)  | 28.01.2022 |
| 118.760,04  | USD               | 88.138,43          | GBP                | (70,52)  | 28.01.2022 |
|   |                   |                    |                    | <b>894.524,45</b>  |            |

Kontrakte mit identischer Laufzeit sowie gleicher erworbener Währung und gleicher veräußerter Währung wurden in obiger Tabelle aufaddiert.

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021

## Anmerkung 1 – Allgemeines

Die Gesellschaft ist eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und mehreren Teilfonds, eine Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV) à compartiments multiples, (jeder einzelne Teilfonds wird hierin nachfolgend als „Teilfonds“ bezeichnet und ist im Prospekt als „Fonds“ definiert) gemäß dem Gesetz vom 10. August 1915 über Handelsgesellschaften in der geänderten Fassung und gemäß dem Gesetz vom 17. Dezember 2010, Teil I, bezüglich Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) in der geänderten Fassung (das „Gesetz“). Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat Nordea Investment Funds S.A. als Verwaltungsgesellschaft (die „Verwaltungsgesellschaft“) bestellt. Die Verwaltungsgesellschaft ist für das Portfoliomanagement, die Verwaltung und den Vertrieb der Gesellschaft zuständig. J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. wurde als Verwahrstelle (die „Verwahrstelle“) der Gesellschaft bestellt.

Am Ende des Berichtsjahrs bestand die Gesellschaft aus folgenden Teilfonds:

| Name des Teilfonds  | Basiswährung | Auflegungsdatum |
|---|--------------|-----------------|
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund                                      | EUR          | 23.05.2018      |
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                                     | EUR          | 01.10.2009      |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund                                     | EUR          | 15.06.2011      |
| Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund                            | USD          | 06.01.1994      |
| Nordea 1 - Asian Stars Equity Fund                              | USD          | 28.04.2020      |
| Nordea 1 - Balanced Income Fund                                 | EUR          | 22.02.2012      |
| Nordea 1 - Chinese Bond Fund (Anmerkung 1c)                     | CNH          | 05.05.2015      |
| Nordea 1 - Chinese Equity Fund                                  | USD          | 02.12.2013      |
| Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund                       | EUR          | 14.05.2020      |
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund                             | DKK          | 21.02.1997      |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund                            | USD          | 30.05.2012      |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund              | USD          | 03.09.2012      |
| Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund                  | USD          | 15.11.2011      |
| Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund              | USD          | 21.11.2017      |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund                             | USD          | 17.01.2019      |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund                           | USD          | 18.04.2011      |
| Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund                       | USD          | 26.10.2015      |
| Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund (Anmerkung 1b)           | EUR          | 03.11.2008      |
| Nordea 1 - European Corporate Bond Fund                         | EUR          | 20.10.1989      |
| Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund                   | EUR          | 10.01.2019      |
| Nordea 1 - European Covered Bond Fund                           | EUR          | 05.06.1996      |
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund             | EUR          | 29.01.2019      |
| Nordea 1 - European Cross Credit Fund                           | EUR          | 22.02.2012      |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund                         | EUR          | 28.09.2012      |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund                        | EUR          | 01.01.2006      |
| Nordea 1 - European High Yield Credit Fund                      | EUR          | 12.03.2011      |
| Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund                  | EUR          | 15.01.2019      |
| Nordea 1 - European Inflation Linked Bond Fund                  | EUR          | 25.11.2020      |
| Nordea 1 - European Small and Mid Cap Equity Fund               | EUR          | 23.03.2009      |
| Nordea 1 - European Stars Equity Fund                           | EUR          | 14.11.2017      |
| Nordea 1 - Flexible Credit Fund (Anmerkung 1b)                  | EUR          | 18.03.2020      |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund                           | EUR          | 03.05.2013      |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund (Anmerkung 1a)       | EUR          | 20.01.2021      |
| Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund                          | GBP          | 13.10.2015      |
| Nordea 1 - Global Bond Fund                                     | EUR          | 20.10.1989      |
| Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund                  | EUR          | 13.03.2008      |
| Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund (Anmerkung 1a) | USD          | 06.07.2021      |
| Nordea 1 - Global Disruption Fund                               | USD          | 19.02.2019      |
| Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund                    | EUR          | 10.06.2020      |
| Nordea 1 - Global Gender Diversity Fund                         | USD          | 21.02.2019      |
| Nordea 1 - Global Green Bond Fund (Anmerkung 1a)                | EUR          | 21.04.2021      |
| Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund                          | USD          | 11.02.2010      |
| Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund                    | USD          | 04.03.2019      |

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

| Name des Teilfonds  | Basiswahrung | Auflegungsdatum |
|---|---------------|-----------------|
| Nordea 1 - Global Opportunity Fund                                  | EUR           | 13.11.2013      |
| Nordea 1 - Global Portfolio Fund                                    | EUR           | 01.02.2010      |
| Nordea 1 - Global Real Estate Fund                                  | USD           | 15.11.2011      |
| Nordea 1 - Global Small Cap Fund                                    | USD           | 11.03.2014      |
| Nordea 1 - Global Social Empowerment Fund (Anmerkung 1c)            | USD           | 03.12.2020      |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund                                | EUR           | 01.01.2006      |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged                  | EUR           | 05.03.2007      |
| Nordea 1 - Global Stars Equity Fund                                 | USD           | 18.05.2016      |
| Nordea 1 - Indian Equity Fund                                       | USD           | 05.07.2012      |
| Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged          | USD           | 04.12.2012      |
| Nordea 1 - Latin American Equity Fund                               | EUR           | 01.08.2007      |
| Nordea 1 - Long Duration US Bond Fund                               | USD           | 26.06.2019      |
| Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund                  | EUR           | 24.10.2017      |
| Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund                     | USD           | 03.03.2011      |
| Nordea 1 - Nordic Equity Fund                                       | EUR           | 04.05.1992      |
| Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund                             | EUR           | 15.01.2007      |
| Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund                                 | EUR           | 30.04.2013      |
| Nordea 1 - Nordic Stars Equity Fund                                 | EUR           | 19.08.2014      |
| Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund                      | USD           | 04.12.2012      |
| Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund (Anmerkung 1a) | USD           | 17.11.2021      |
| Nordea 1 - North American Small Cap Fund                            | USD           | 01.10.2012      |
| Nordea 1 - North American Stars Equity Fund                         | USD           | 30.05.2012      |
| Nordea 1 - North American Value Fund                                | USD           | 14.03.1997      |
| Nordea 1 - Norwegian Bond Fund                                      | NOK           | 15.05.1998      |
| Nordea 1 - Norwegian Equity Fund                                    | NOK           | 21.11.1997      |
| Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund                           | NOK           | 18.07.1997      |
| Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund                      | USD           | 03.10.2011      |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                                       | EUR           | 02.11.2005      |
| Nordea 1 - Swedish Bond Fund  | SEK           | 04.08.1995      |
| Nordea 1 - Swedish Short-Term Bond Fund                             | SEK           | 27.01.1995      |
| Nordea 1 - US Corporate Bond Fund                                   | USD           | 15.01.2010      |
| Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund (Anmerkung 1a)              | USD           | 09.11.2021      |
| Nordea 1 - US High Yield Bond Fund                                  | USD           | 28.07.2008      |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                                | USD           | 25.09.2012      |

## a) Auflegung von Teilfonds

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat beschlossen, folgende Teilfonds aufzulegen:

| Name des Teilfonds                                   | 1. NIW:    |
|--|------------|
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund           | 22.01.2021 |
| Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund     | 07.07.2021 |
| Nordea 1 - Global Green Bond Fund                    | 23.04.2021 |
| Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund | 17.11.2021 |
| Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund              | 10.11.2021 |

## b) Liquidation und Zusammenlegung von Teilfonds

Folgende Teilfonds wurden im Jahresverlauf liquidiert oder zusammengelegt:

| Geschlossener Teilfonds                         | Aufnehmender Teilfonds                 | Wirksamkeitstag |
|---|--|-----------------|
| Nordea 1 - Emerging Markets Small Cap Fund      | Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund | 26.08.2021      |
| Nordea 1 - European Corporate Bond Fund Plus    | Liquidiert                             | 29.10.2021      |
| Nordea 1 - Latin American Corporate Bond Fund   | Liquidiert                             | 10.03.2021      |
| Nordea 1 - Unconstrained Bond Fund - USD Hedged | Nordea 1 - Flexible Credit Fund        | 25.06.2021      |



# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

## c) Namensänderung bei Teilfonds

Folgende Teilfonds wurden im Jahresverlauf umbenannt:

| Alter Name                    | Neuer Name                                | Wirksamkeitstag |
|-------------------------------|---|-----------------|
| Nordea 1 - Global Impact Fund | Nordea 1 - Global Social Empowerment Fund | 18.01.2021      |
| Nordea 1 - Renminbi Bond Fund | Nordea 1 - Chinese Bond Fund              | 14.12.2021      |

## Anmerkung 2 – Wichtige Grundsätze der Rechnungslegung

Der Abschluss wird in Übereinstimmung mit den in Luxemburg für Investmentfonds geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen auf Grundlage der Unternehmensfortführungsprämisse erstellt.

### a) Bewertung der Wertpapierbestände

Wertpapiere werden wie folgt bewertet:

1. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die amtlich notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt in Europa, Nord- oder Südamerika, Asien, Australien, Neuseeland oder Afrika gehandelt werden, der ordnungsgemäß funktioniert, anerkannt und öffentlich zugänglich ist, werden auf der Grundlage des letzten zum Bewertungszeitpunkt verfügbaren Kurses bewertet. Falls das gleiche Wertpapier oder Geldmarktinstrument an verschiedenen Märkten notiert ist, wird die Notierung des Hauptmarkts für dieses Wertpapier oder Geldmarktinstrument verwendet. Falls es keine angemessene Notierung gibt, oder falls die Notierung keinen angemessenen Wert repräsentiert, wird die Wertfestsetzung vom Verwaltungsrat der Gesellschaft oder dessen Beauftragten nach bestem Ermessen vorgenommen, um einen wahrscheinlichen Verkaufspreis für solche Wertpapiere festzusetzen.
2. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an einer Börse notiert sind, werden vom Verwaltungsrat oder dessen Beauftragten nach bestem Ermessen auf der Grundlage ihres wahrscheinlichen Verkaufspreises bewertet.
3. Liquide Mittel und Kredite werden zu ihrem Nennwert zuzüglich aufgelaufener Zinsen bewertet.
4. Aktien/Anteile von OGAW, die gemäß der Richtlinie 2009/65/EG in ihrer geänderten Fassung zugelassen sind, und/oder andere gleichwertige OGA werden zu ihrem letzten verfügbaren Nettoinventarwert bewertet.
5. Für die Bewertung von Pensionsgeschäften wird der Rücknahmepreis (zukünftige Zahlung) auf den Kauftermin abgezinst. Ferner werden die zum Kauftermin aufgelaufenen Stückzinsen abgezogen.

### b) Realisierter Nettogewinn oder -verlust aus dem Verkauf von Wertpapieren

Durch den Verkauf von Wertpapieren realisierte Nettogewinne oder -verluste werden auf der Grundlage des durchschnittlichen Einstandspreises der verkauften Wertpapiere ermittelt.

### c) Währungsumrechnung

Der Rechnungsabschluss jedes einzelnen Teilfonds der Gesellschaft wird in der Basiswährung des betreffenden Teilfonds aufgestellt. Aktiva und Passiva in anderen Währungen als der Basiswährung werden zu den am Jahresende geltenden Wechselkursen in die Basiswährung umgerechnet. Erträge und Aufwendungen in anderen Währungen als der Basiswährung werden zu den an den Zahltagen geltenden Wechselkursen in die Basiswährung umgerechnet. Die sich hieraus ergebenden Kursgewinne oder -verluste werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens berücksichtigt.

Die wichtigsten zum Jahresende herangezogenen Wechselkurse:

|                        |                        |                          |
|------------------------|------------------------|--------------------------|
| 1 EUR = 1,56281476 AUD | 1 EUR = 1,03292017 CHF | 1 EUR = 7,20410706 CNH   |
| 1 EUR = 7,43630031 DKK | 1 EUR = 0,84005785 GBP | 1 EUR = 130,40765775 JPY |
| 1 EUR = 9,98402659 NOK | 1 EUR = 4,59646360 PLN | 1 EUR = 10,25178505 SEK  |
| 1 EUR = 1,52862444 SGD | 1 EUR = 1,13265000 USD |                          |

### d) Einstandspreis der Wertpapiere

Der Einstandspreis der Wertpapiere, die auf eine andere Währung als die Basiswährung des betreffenden Teilfonds lauten, wird zu dem am Kauftag geltenden Wechselkurs in die Basiswährung umgerechnet.

### e) Dividenden und Zinsen

Dividenden werden nach Abzug der Quellensteuern verbucht. Sie werden an dem Tag als Ertrag ausgewiesen, an dem die Wertpapiere zum ersten Mal ex Dividende notiert werden, sofern diese Informationen dem Teilfonds zur Verfügung stehen. Zinsen auf Anleihen laufen täglich auf.

### f) Finanzterminkontrakte

Die Gesellschaft darf Finanzterminkontrakte erwerben und veräußern. Bei Abschluss eines Kontrakts hinterlegt die Gesellschaft beim Clearing Broker Merrill Lynch International Limited eine Barsicherheit und sie hält weitere Barmittel vor. Die zur Erfüllung der Mindestdeckungshöhe eventuell erforderlichen Nachschüsse werden im Cash Account der Gesellschaft täglich angepasst; Erlöse aus offenen Positionen gelten als zu diesem Zeitpunkt realisiert. Im Abschluss werden sie jedoch als nicht realisierte Gewinne/(Verluste) ausgewiesen („Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten“/„Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten“). Die Margin entspricht der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts am vorangegangenen Bewertungstag und dem Wert des Finanzterminkontrakts am Bewertungstag.



# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

## g) Devisenterminkontrakte

Devisenterminkontrakte werden zu dem am Stichtag der Nettovermögensaufstellung geltenden Terminkurs für die Zeit bis zur Fälligkeit bewertet.

Der nicht realisierte Nettowertzuwachs bzw. die nicht realisierte Nettowertminderung aus offenen Devisenterminkontrakten zum Jahresende wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus Devisenterminkontrakten“ ausgewiesen.

## h) Equity Swaps

Ein Equity Swap ist ein zweiseitiger Vertrag, bei dem eine Partei das wirtschaftliche Exposure gegenüber der Performance eines Referenzaktivums für einen bestimmten Zeitraum erwirbt, ohne dieses Referenzaktivum tatsächlich zu besitzen.

Das zugrunde liegende Aktivum kann eine Aktie, ein Aktienkorb, ein Index oder ein Indexkorb sein.

Equity Swaps sind gehebelte Positionen, d. h. mit ihnen können Anleger ein Exposure gegenüber der Kursentwicklung von Aktien erwerben, ohne die Barmittel aufzuwenden, die für einen Erwerb dieser Aktien erforderlich wären.

Der nicht realisierte Wertzuwachs bzw. die nicht realisierte Wertminderung wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus Equity Swaps“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne bzw. Verluste sowie die hieraus resultierende Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses bzw. der nicht realisierten Wertminderung werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Equity Swaps“ bzw. „Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Equity Swaps“ ausgewiesen.

Die zur Erfüllung der Mindestdeckungshöhe eventuell erforderlichen Nachschüsse werden im Cash Account der Gesellschaft monatlich angepasst; Erlöse aus offenen Positionen werden als nicht realisierte Gewinne/(Verluste) ausgewiesen („Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Equity Swaps“/„Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Equity Swaps“).

## i) Credit Default Swaps (CDS)

Ein Credit Default Swap ist eine Kreditderivat-Transaktion, bei der zwei Parteien einen Vertrag abschließen. Eine Partei (der Sicherungsnehmer) zahlt der anderen Partei (Sicherungsgeber) eine laufende Prämie für die festgelegte Vertragsdauer. Im Gegenzug erhält der Sicherungsnehmer eine Ausfallzahlung, wenn beim zugrunde liegenden Referenzaktivum ein Kreditereignis eintritt.

Im Fall eines Kreditereignisses muss der Sicherungsgeber eine Zahlung leisten, und zwar: (i) einen Barausgleich (cash settlement) in Höhe des Nominalwerts des Swaps abzüglich des Auktionswerts des Referenzaktivums, oder (ii) den Nominalwert des Swaps gegen Lieferung des Referenzaktivums. Ein Sicherungsverkauf erhöht den Hebel des Portfolios eines Fonds bis zum Nominalwert des Swapkontrakts.

Credit Default Swaps werden an jedem NIW-Berechnungstag zum Marktwert bewertet. Der Marktwert basiert auf den im Kontrakt festgelegten Bewertungselementen. Er wird anhand interner Modelle ermittelt und anschließend mit der Bewertung eines externen Pricing Agents (GlobeOp) oder der Clearing-Gegenpartei (CCP) verglichen. Der Anfangswert des Kontrakts entspricht dem Marktwert bei Abschluss. Um zu gewährleisten, dass der wirtschaftliche Wert des Kontrakts beim Abschluss für beide Seiten bei 0 liegt, zahlt eine der beiden Parteien eine so genannte Upfront (einmalige Leistung beim Abschluss).

Der nicht realisierte Wertzuwachs bzw. die nicht realisierte Wertminderung wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus Credit Default Swaps“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne bzw. Verluste sowie hieraus resultierende Veränderungen des nicht realisierten Wertzuwachses bzw. der nicht realisierten Wertminderung werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Credit Default Swaps“ bzw. „Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Credit Default Swaps“ ausgewiesen. Die beim Kontraktabschluss vorab bezahlte bzw. erhaltene Upfront-Gebühr ist im Anfangswert des Kontrakts enthalten und wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Credit Default Swaps zum Einstandspreis“ ausgewiesen.

## j) Zinsswaps (IRS)

Ein Zinsswap ist ein zweiseitiger Vertrag, bei dem die Vertragspartner den Tausch von Zinszahlungen gegen andere Zinszahlungen (in der Regel fest/variabel) auf Basis eines Nominalbetrags vereinbaren, der als Berechnungsbasis dient und normalerweise nicht ausgetauscht wird.

Zinsswaps werden an jedem NIW-Berechnungstag zum Marktwert bewertet. Der Marktwert basiert auf den im Kontrakt festgelegten Bewertungselementen und wird über interne Modelle ermittelt, die mit der Bewertung eines Dritten (GlobeOp) verglichen werden.

Der nicht realisierte Wertzuwachs bzw. die nicht realisierte Wertminderung wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus Zinsswaps“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne bzw. Verluste sowie die hieraus resultierende Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses bzw. der nicht realisierten Wertminderung werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Zinsswaps“ bzw. „Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Zinsswaps“ ausgewiesen. Die gegebenenfalls beim Kontraktabschluss vorab bezahlte bzw. erhaltene Upfront-Gebühr ist im Anfangswert des Kontrakts enthalten und wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Zinsswaps zum Einstandspreis“ ausgewiesen.

## k) Total Return Swaps (TRS) auf einen Index

Ein Total Return Swap („TRS“) auf einen Index ist ein Vertrag, bei dem eine Partei (Total-Return-Zahler) die gesamte wirtschaftliche Performance eines zugrunde liegenden Basiswerts an die andere Partei (Total-Return-Empfänger) überträgt, die im Gegenzug Zahlungen auf Grundlage eines festen oder variablen Satzes leistet. Die gesamte wirtschaftliche Performance umfasst Erträge aus Dividenden, Zinsen und Gebühren oder Verluste aus Marktbewegungen sowie Bonitätsverluste. Die Gesellschaft darf diese Transaktionen nur durch regulierte Finanzinstitute mit einem Mindestbonitätsrating von „Investment Grade“ und Sitz in einem OECD-Land eingehen.

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

Der nicht realisierte Wertzuwachs bzw. die nicht realisierte Wertminderung wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne bzw. Verluste sowie die hieraus resultierende Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses bzw. der nicht realisierten Wertminderung werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Total Return Swaps“ bzw. „Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen.

Die zur Erfüllung der Mindestdeckungshöhe eventuell erforderlichen Nachschüsse werden im Cash Account der Gesellschaft monatlich angepasst; Erlöse aus offenen Positionen werden als nicht realisierte Gewinne/(Verluste) ausgewiesen („Bereits verbuchter nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swaps“/„Bereits verbuchter nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps“).

## l) Optionen

Optionen sind Kontrakte, die den Inhaber berechtigten, eine bestimmte Anzahl von Anteilen oder Einheiten eines bestimmten Wertpapiers zu einem bestimmten Preis vor dem im Kontrakt angegebenen Verfalltermin zu kaufen oder zu verkaufen. Gekaufte Optionen werden als Anlagen ausgewiesen; verkaufte Optionen werden als Verbindlichkeit ausgewiesen.

Führt die Ausübung einer Option zu einem Barausgleich, wird der Differenzbetrag zwischen der Prämie (ursprünglicher Optionswert) und dem Abwicklungserlös als realisierter Gewinn oder Verlust ausgewiesen. Werden bei Ausübung der Option Wertpapiere erworben oder geliefert, erfolgt eine Anpassung der Anschaffungskosten oder des Verkaufserlöses um die Höhe der Prämie. Erfolgt eine Glatstellung der Option, wird der Differenzbetrag zwischen der Prämie und den Kosten der Positionsglatstellung als realisierter Gewinn oder Verlust ausgewiesen. Verfällt eine Option, wird die Prämie als realisierter Gewinn aus verkauften Optionen oder realisierter Verlust aus gekauften Optionen ausgewiesen.

Die Gesellschaft verkauft Optionen auf Wertpapiere, Terminkontrakte und Zinsswaps („Swaptions“). Diese Optionen werden durch Barausgleich abgewickelt und bergen ein unbegrenztes Verlustrisiko für die Gesellschaft. Die Gesellschaft unterliegt jedoch bei verkauften Optionen keinem Kreditrisiko, da die Gegenpartei die ihr aus dem Kontrakt obliegende Verpflichtung (Prämienzahlung bei Vertragsabschluss) bereits erfüllt hat.

Börsennotierte Optionen werden zu den Quotierungen von Refinitiv oder Bloomberg bewertet. Bei im Geld und am Geld liegenden Optionen (In-the-Money- und At-the-Money-Optionen), für die es keine Notierung gibt, wird ein theoretisches Modell angewandt, das den Preis des Basiswerts und die implizite Volatilitätskurve heranzieht.

Die Bewertung nicht börsengehandelter Optionen (OTC-Optionen) wie Devisenoptionen (FX-Optionen) basiert auf einem theoretischen Modell, das den Devisenkassakurs, die Volatilitätsdaten der FX-Optionen und den Zins als Eingangsgrößen heranzieht.

Die Bewertung von Swaptions erfolgt auf Basis eines theoretischen Modells, das die Volatilitätsdaten der Swaptions und den Zins heranzieht. Das Modell berücksichtigt die Settlement-Konventionen der ISDA.

Der Marktwert der Optionen wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Gekaufte oder verkaufte Optionen zum Marktwert“ ausgewiesen. Die Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses bzw. der nicht realisierten Wertminderung ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionen“ und „Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Optionen“ ausgewiesen.

## m) Definition von Begriffen aus der Aufstellung der Wertpapieranlagen und anderer Nettovermögenswerte und den Tabellen zu den Credit Default Swaps (CDS)

**FRN (Floating Rate Note):** Eine Anleihe, deren Kupon an einen Referenzzinssatz, z.B. LIBOR oder Euribor, zuzüglich/abzüglich eines Spreads gekoppelt ist. Zum Emissionszeitpunkt sind nur die Anpassungstermine bekannt.

**MULTI:** Fixed-to-Float- oder Fixed-to-Variable-Anleihen, bei denen eine Änderung des Zinssatzes von fest zu variabel erfolgen kann, wobei die Zinssätze und Anpassungstermine zum Emissionszeitpunkt feststehen.

**VAR:** Anleihe mit variabler Verzinsung, jedoch keine FRN oder MULTI.

**PERPETUAL:** Dieser Begriff bezeichnet Anleihen ohne Endfälligkeit (so genannte ewige Anleihen). Eine Rückzahlung des Kapitalbetrags an den Anleger ist nicht vorgesehen. Dafür verbiefen diese Anleihen eine endlose regelmäßige Zinszahlung.

**P-NOTE (Participatory Note):** P-Notes werden von registrierten ausländischen institutionellen Investoren (FII) an ausländische Anleger weitergegeben, die an der indischen Börse investieren möchten, ohne sich selbst beim Securities and Exchange Board of India (SEBI) zu registrieren.

**No ref obligation:** Dies ist in den Tabellen zu den Credit Default Swaps angegeben, wenn keine zugrunde liegende Referenzanleihe in der offiziellen RED-Datenbank von Markit zur Verfügung steht.

## n) Konsolidierte Aufstellung

Die konsolidierte Nettovermögensaufstellung sowie die konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens der Gesellschaft entsprechen der Summe der Aufstellungen aller Fonds nach Umrechnung in Euro zu den am Ende des Berichtsjahres geltenden Wechselkursen. Die Differenz zwischen dem gesamten Anfangsnettovermögen zu den Wechselkursen am Jahresanfang und seinem Wert am Ende des Berichtsjahrs wird in der konsolidierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens als Wechselkursdifferenz unter „Bewertungsdifferenz zum gesamten Anfangsnettovermögen“ ausgewiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

## o) Letzter handelbarer Nettoinventarwert des Jahres

Der Jahresbericht berücksichtigt bei allen Teilfonds den Nettoinventarwert vom 31. Dezember 2021. Für die folgenden Teilfonds war der letzte handelbare Nettoinventarwert der Nettoinventarwert vom 30. Dezember 2021, weil die Märkte in bestimmten Ländern am 31. Dezember 2021 geschlossen waren:

|   |  |
|---|--|
| Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund              | Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund        |
| Nordea 1 - Asian Stars Equity Fund                | Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund            |
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund               | Nordea 1 - Nordic Stars Equity Fund            |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund             | Nordea 1 - Norwegian Bond Fund                 |
| Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund         | Nordea 1 - Norwegian Equity Fund               |
| Nordea 1 - European Small and Mid Cap Equity Fund | Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund      |
| Nordea 1 - European Stars Equity Fund             | Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund |
| Nordea 1 - Global Small Cap Fund                  | Nordea 1 - Swedish Bond Fund                   |
| Nordea 1 - Latin American Equity Fund             | Nordea 1 - Swedish Short-Term Bond Fund        |
| Nordea 1 - Nordic Equity Fund                     |  |

## p) Rückstellungen für die indische Kapitalertragssteuer

Kapitalerträge, die bei der Veräußerung indischer börsennotierter Aktien innerhalb von zwölf Monaten nach dem Kauf realisiert werden, (kurzfristige Erträge) unterliegen einer Kapitalertragssteuer. Kapitalerträge aus einer zwölf Monate nach dem Kauf erfolgten Veräußerung indischer börsennotierter Aktien (langfristige Erträge) waren bis April 2018 steuerfrei. Ab April 2018 führte Indien auch für langfristige Kapitalerträge eine Kapitalertragssteuer ein. Bis zum 9. Dezember 2021 wurden die Kapitalertragssteuern zum Zeitpunkt ihres Anfalls einige Tage nach jeder Transaktion zum anwendbaren Satz für kurz- und langfristige Erträge ohne Bildung einer Rückstellung erfasst. Ab dem 9. Dezember 2021 werden die Kapitalertragssteuern für Fonds, die in Indien investieren, als antizipativer Posten im Nettoinventarwert abgezogen.

Die Rückstellung ist unter „Sonstige Nettoforderungen“ bzw. „Sonstige Nettoverbindlichkeiten“ in der Nettovermögensaufstellung und unter „Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Wertpapieren“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen.

| Fondsname                                      | Basiswährung | Betrag        |
|--|--------------|---------------|
| Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund           | USD          | 94.973,54     |
| Nordea 1 - Asian Stars Equity Fund             | USD          | 807.739,86    |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund          | USD          | 20.503.645,99 |
| Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund         | EUR          | 150.310,29    |
| Nordea 1 - Indian Equity Fund                  | USD          | 3.439.192,19  |
| Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund | USD          | 1.735.150,92  |

## Anmerkung 3 - Kosten, die von der Gesellschaft im Laufe eines Jahres getragen werden

Die Kosten decken die Betriebskosten der einzelnen Teilfonds ab, einschließlich der Verwaltungs- und Vertriebskosten, des Honorars für die zentrale Verwaltung und der Taxe d'Abonnement. Diese Gebühren fallen täglich auf das Gesamtvermögen der jeweiligen Anteilsklassen und Teilfonds an und werden vom Teilfonds-Vermögen vierteljährlich abgezogen und verringern daher die Performance Ihrer Anlage.

Diese Gebühren sind für alle Anteilsinhaber eines bestimmten Teilfonds und einer bestimmten Anteilsklasse gleich hoch.

**a) Verwaltungsgebühr:** Diese Gebühren werden aus dem Vermögen des jeweiligen Teilfonds gezahlt und stehen der Verwaltungsgesellschaft zu. Verwaltungsgebühren für D- und Z-Anteile unterliegen den gesonderten Bedingungen, die für die Anleger gelten, die in diese Anteile investieren. Die Verwaltungsgebühren für X-Anteile werden nicht vom Teilfonds, sondern von den Anlegern getragen, die in diese Anteilsklasse investieren. Die Verwaltungsgebühren für Y-Anteile sind null.

**b) Betriebskosten:** Diese Aufwendungen bestehen aus einem Honorar für die zentrale Verwaltung, einer Verwahrgebühr (für die Verwahrung und andere damit verbundene Dienstleistungen) und der Taxe d'Abonnement.

Die Taxe d'Abonnement (Zeichnungssteuer) wird vierteljährlich auf den aufaddierten Nettoinventarwert der umlaufenden Anteile der SICAV berechnet und ist vierteljährlich zahlbar. Sie wird zu folgenden Sätzen aus den Betriebskosten gezahlt:

Klassen C, E, F, N, P, Q und S: 0,05%

Klassen D, I, V, X, Y und Z: 0,01%

Die Vermögenswerte in Form von Anteilen oder Aktien anderer luxemburgischer Organismen für gemeinsame Anlagen sind von jeglicher Zeichnungssteuer befreit, sofern diese Anteile oder Aktien dieser Steuer in Luxemburg bereits unterliegen.

Die Verwahrgebühr und damit verbundene Verwaltungsaufwendungen basieren auf dem Wert der verwahrten Vermögenswerte und variieren von Teilfonds zu Teilfonds, je nachdem, in welchen Ländern der betreffende Teilfonds investiert.

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

Die Betriebskosten umfassen ferner:

- sämtliche Prüfungs- und Rechtsberatungskosten
- sämtliche Aufwendungen im Zusammenhang mit der Veröffentlichung und Bereitstellung von Informationen für die Anteilhaber, insbesondere die Kosten für den Druck und Vertrieb der Finanzberichte sowie jedweder Prospekte
- sämtliche Aufwendungen im Zusammenhang mit der Führung, der Produktion, dem Druck, der Übersetzung, dem Vertrieb, dem Versand, der Speicherung und der Archivierung der wesentlichen Anlegerinformationen
- etwaige Werbekosten und Aufwendungen mit Ausnahme der vorstehend angegebenen, die nach Auffassung der Verwaltungsgesellschaft direkt mit dem Angebot oder Vertrieb der Anteile verbunden sind
- Sämtliche Aufwendungen im Zusammenhang mit der Registrierung und Aufrechterhaltung der Registrierung der SICAV bei den Aufsichtsbehörden und an Börsen

**Nicht enthalten in den vorstehenden Aufwendungen sind:**

- sämtliche zu entrichtende Steuern auf die Vermögenswerte und/oder Erträge mit Ausnahme der Taxe d'Abonnement
- Transaktionsgebühren der Verwahrstelle
- andere transaktionsbezogene Gebühren wie gewöhnliche Brokergebühren und -provisionen, Bankkosten, Stempelsteuern und ähnliche Abgaben
- Kosten von Rechtsstreitigkeiten
- jedwede außerordentlichen Aufwendungen oder sonstige unvorhersehbare Kosten
- sämtliche anderen von der SICAV zu tragenden Aufwendungen

Die folgenden Tabellen zeigen die Verwaltungsgebühren und die Betriebskosten der Anteilklassen, die i) institutionellen Anlegern und ii) allen Anlegern außer institutionellen Anlegern zur Verfügung stehen

Verwaltungsgebühren und Betriebskosten der Anteilklassen, die institutionellen Anlegern zur Verfügung stehen:

|  | Verwaltungsgebühr |        |        |                               |        |        | Betriebskosten (Höchstbetrag) |        |        |        |        |        |
|--|-------------------|--------|--------|-------------------------------|--------|--------|-------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
|  | D                 | I      | V      | X                             | Y      | Z      | D                             | I      | V      | X      | Y      | Z      |
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund                         | k.A.              | 0,900% | 0,900% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                        | k.A.              | 1,000% | 1,000% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund                        | k.A.              | 1,200% | 1,200% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund               | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,150% | 0,200% |
| Nordea 1 - Asian Stars Equity Fund                 | k.A.              | 0,750% | 0,750% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,150% | 0,200% |
| Nordea 1 - Balanced Income Fund                    | k.A.              | 0,650% | 0,650% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - Chinese Bond Fund (Anmerkung 1c)        | k.A.              | 0,500% | 0,500% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | 0,450% | 0,300%                        | 0,300% | 0,300% | 0,250% | 0,100% | 0,250% |
| Nordea 1 - Chinese Equity Fund                     | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund          | k.A.              | 0,100% | 0,100% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,150%                        | 0,150% | 0,150% | 0,100% | 0,100% | 0,100% |
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund                | k.A.              | 0,300% | 0,300% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund               | k.A.              | 0,500% | 0,500% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund | k.A.              | 0,700% | 0,700% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,300%                        | 0,300% | 0,300% | 0,250% | 0,150% | 0,250% |
| Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund     | k.A.              | 0,800% | 0,800% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund | k.A.              | 0,700% | 0,700% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,300%                        | 0,300% | 0,300% | 0,250% | 0,150% | 0,250% |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund                | k.A.              | 0,500% | 0,500% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund              | k.A.              | 0,750% | 0,750% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,250% | 0,150% | 0,250% |

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

|   | Verwaltungsgebühr |        |        |                               |        |        | Betriebskosten (Höchstbetrag) |        |        |        |        |        |
|---|-------------------|--------|--------|-------------------------------|--------|--------|-------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
|   | D                 | I      | V      | X                             | Y      | Z      | D                             | I      | V      | X      | Y      | Z      |
| Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund                       | k.A.              | 0,600% | 0,600% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,300%                        | 0,300% | 0,300% | 0,250% | 0,150% | 0,250% |
| Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund (Anmerkung 1b)           | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - European Corporate Bond Fund                         | k.A.              | 0,300% | 0,300% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund                   | k.A.              | 0,300% | 0,300% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - European Covered Bond Fund                           | k.A.              | 0,300% | 0,300% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund             | k.A.              | 0,350% | 0,350% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,150%                        | 0,150% | 0,150% | 0,100% | 0,100% | 0,100% |
| Nordea 1 - European Cross Credit Fund                           | k.A.              | 0,500% | 0,500% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund                         | 0,450%            | 0,500% | 0,500% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund                        | k.A.              | 0,500% | 0,500% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - European High Yield Credit Fund                      | k.A.              | 0,500% | 0,500% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund                  | k.A.              | 0,500% | 0,500% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - European Inflation Linked Bond Fund                  | k.A.              | 0,300% | 0,300% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - European Small and Mid Cap Equity Fund               | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - European Stars Equity Fund                           | k.A.              | 0,750% | 0,750% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Flexible Credit Fund (Anmerkung 1b)                  | k.A.              | 0,650% | 0,650% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | 0,425% | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund                           | k.A.              | 0,400% | 0,400% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund (Anmerkung 1a)       | k.A.              | 0,500% | 0,500% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund                          | 0,430%            | 0,700% | 0,700% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,100%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Global Bond Fund                                     | k.A.              | 0,300% | 0,300% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund                  | k.A.              | 0,750% | 0,750% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund (Anmerkung 1a) | k.A.              | 0,750% | 0,750% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Global Disruption Fund                               | k.A.              | 0,750% | 0,750% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,150% | 0,202% |
| Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund                    | k.A.              | 1,000% | 1,000% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

|   | Verwaltungsgebühr |        |        |                               |        |        | Betriebskosten (Höchstbetrag) |        |        |        |        |        |
|---|-------------------|--------|--------|-------------------------------|--------|--------|-------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
|   | D                 | I      | V      | X                             | Y      | Z      | D                             | I      | V      | X      | Y      | Z      |
| Nordea 1 - Global Gender Diversity Fund                             | k.A.              | 0,750% | 0,750% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,150% | 0,200% |
| Nordea 1 - Global Green Bond Fund (Anmerkung 1a)                    | k.A.              | 0,300% | 0,300% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund                              | k.A.              | 0,600% | 0,600% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund                        | k.A.              | 0,800% | 0,800% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,300%                        | 0,300% | 0,300% | 0,250% | 0,150% | 0,250% |
| Nordea 1 - Global Opportunity Fund                                  | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Global Portfolio Fund                                    | k.A.              | 0,500% | 0,500% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Global Real Estate Fund                                  | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,300%                        | 0,300% | 0,300% | 0,250% | 0,100% | 0,250% |
| Nordea 1 - Global Small Cap Fund                                    | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Global Social Empowerment Fund (Anmerkung 1c)            | k.A.              | 0,750% | 0,750% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,150% | 0,200% |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund                                | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | 0,450% | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,300% |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged                  | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Global Stars Equity Fund                                 | k.A.              | 0,750% | 0,750% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,150% | 0,200% |
| Nordea 1 - Indian Equity Fund                                       | k.A.              | 1,000% | 1,000% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,350%                        | 0,350% | 0,350% | 0,300% | 0,150% | 0,300% |
| Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged          | k.A.              | 0,600% | 0,600% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Latin American Equity Fund                               | k.A.              | 1,000% | 1,000% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,300%                        | 0,300% | 0,300% | 0,250% | 0,150% | 0,250% |
| Nordea 1 - Long Duration US Bond Fund                               | k.A.              | 0,300% | 0,300% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund                  | k.A.              | 0,250% | 0,250% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,150%                        | 0,150% | 0,150% | 0,100% | 0,100% | 0,100% |
| Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund                     | k.A.              | 0,600% | 0,600% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Nordic Equity Fund                                       | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund                             | k.A.              | 1,000% | 1,000% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund                                 | k.A.              | 1,000% | 1,000% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Nordic Stars Equity Fund                                 | k.A.              | 0,750% | 0,750% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund                      | k.A.              | 0,600% | 0,600% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund (Anmerkung 1a) | k.A.              | 0,600% | 0,600% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A.   | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |



# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

|  | Verwaltungsgebühr |        |        |                               |        |      | Betriebskosten (Höchstbetrag) |        |        |        |        |        |
|--|-------------------|--------|--------|-------------------------------|--------|------|-------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
|  | D                 | I      | V      | X                             | Y      | Z    | D                             | I      | V      | X      | Y      | Z      |
| Nordea 1 - North American Small Cap Fund               | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - North American Stars Equity Fund            | k.A.              | 0,750% | 0,750% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - North American Value Fund                   | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Norwegian Bond Fund                         | k.A.              | 0,300% | 0,300% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - Norwegian Equity Fund                       | k.A.              | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund              | k.A.              | 0,125% | 0,125% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,100% | 0,100% | 0,100% |
| Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund         | k.A.              | 1,000% | 1,000% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,150% | 0,200% |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                          | 0,500%            | 0,850% | 0,850% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - Swedish Bond Fund                           | k.A.              | 0,300% | 0,300% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,150% | 0,100% | 0,150% |
| Nordea 1 - Swedish Short-Term Bond Fund                | k.A.              | 0,125% | 0,125% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,200%                        | 0,200% | 0,200% | 0,100% | 0,100% | 0,100% |
| Nordea 1 - US Corporate Bond Fund                      | k.A.              | 0,350% | 0,350% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund (Anmerkung 1a) | k.A.              | 0,350% | 0,350% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - US High Yield Bond Fund                     | k.A.              | 0,600% | 0,600% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,250%                        | 0,250% | 0,250% | 0,200% | 0,100% | 0,200% |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | 0,400%            | 0,550% | 0,550% | Anlegern in Rechnung gestellt | 0,000% | k.A. | 0,350%                        | 0,350% | 0,350% | 0,300% | 0,100% | 0,300% |

Verwaltungsgebühren und Betriebskosten der Anteilsklassen, die allen Anlegern zur Verfügung stehen (ohne die Klassen, die institutionellen Anlegern vorbehalten sind):

|   | Verwaltungsgebühr |        |        |        |      |      | Betriebskosten (Höchstwert) |        |
|---|-------------------|--------|--------|--------|------|------|-----------------------------|--------|
|   | P                 | Q      | E      | C      | S    | F    | N                           |        |
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund                            | 1,600%            | k.A.   | 1,600% | 1,000% | k.A. | k.A. | 0,900%                      | 0,350% |
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                           | 1,700%            | k.A.   | 1,700% | 1,100% | k.A. | k.A. | 1,000%                      | 0,350% |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund                           | 2,000%            | k.A.   | 2,000% | 1,300% | k.A. | k.A. | 1,200%                      | 0,350% |
| Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund                  | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,950% | k.A. | k.A. | 0,850%                      | 0,350% |
| Nordea 1 - Asian Stars Equity Fund                    | 1,500%            | 1,350% | 1,500% | 0,850% | k.A. | k.A. | 0,750%                      | 0,350% |
| Nordea 1 - Balanced Income Fund                       | 1,200%            | k.A.   | 1,200% | 0,750% | k.A. | k.A. | 0,650%                      | 0,300% |
| Nordea 1 - Chinese Bond Fund (Anmerkung 1c)           | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,600% | k.A. | k.A. | 0,500%                      | 0,400% |
| Nordea 1 - Chinese Equity Fund                        | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,950% | k.A. | k.A. | 0,850%                      | 0,350% |
| Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund             | 0,175%            | k.A.   | 0,175% | 0,150% | k.A. | k.A. | 0,100%                      | 0,250% |
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund                   | 0,600%            | k.A.   | 0,600% | 0,400% | k.A. | k.A. | 0,300%                      | 0,300% |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund                  | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,600% | k.A. | k.A. | 0,500%                      | 0,400% |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund    | 1,200%            | k.A.   | 1,200% | 0,800% | k.A. | k.A. | 0,700%                      | 0,400% |
| Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund        | 1,200%            | k.A.   | 1,200% | 0,900% | k.A. | k.A. | 0,800%                      | 0,400% |
| Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund    | 1,300%            | k.A.   | 1,300% | 0,800% | k.A. | k.A. | 0,700%                      | 0,400% |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund                   | 0,900%            | k.A.   | 0,900% | 0,600% | k.A. | k.A. | 0,500%                      | 0,350% |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund                 | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,850% | k.A. | k.A. | 0,750%                      | 0,350% |
| Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund             | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,700% | k.A. | k.A. | 0,600%                      | 0,400% |
| Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund (Anmerkung 1b) | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,950% | k.A. | k.A. | 0,850%                      | 0,350% |

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

|  | Verwaltungsgebühr |        |        |        |        |      | Betriebskosten<br>(Höchstwert) |        |
|--|-------------------|--------|--------|--------|--------|------|--------------------------------|--------|
|  | P                 | Q      | E      | C      | S      | F    |                                | N      |
| Nordea 1 - European Corporate Bond Fund                                | 0,600%            | k.A.   | 0,600% | 0,400% | k.A.   | k.A. | 0,300%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund                          | 0,600%            | k.A.   | 0,600% | 0,400% | k.A.   | k.A. | 0,300%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - European Covered Bond Fund                                  | 0,600%            | k.A.   | 0,600% | 0,400% | k.A.   | k.A. | 0,300%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund                    | 0,700%            | k.A.   | 0,700% | 0,450% | k.A.   | k.A. | 0,350%                         | 0,250% |
| Nordea 1 - European Cross Credit Fund                                  | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,600% | k.A.   | k.A. | 0,500%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund                                | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,600% | k.A.   | k.A. | 0,500%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund                               | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,600% | k.A.   | k.A. | 0,500%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - European High Yield Credit Fund                             | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,600% | k.A.   | k.A. | 0,500%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund                         | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,600% | k.A.   | k.A. | 0,500%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - European Inflation Linked Bond Fund                         | 0,600%            | k.A.   | 0,600% | 0,400% | k.A.   | k.A. | 0,300%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - European Small and Mid Cap Equity Fund                      | 1,300%            | k.A.   | 1,300% | 0,950% | k.A.   | k.A. | 0,850%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - European Stars Equity Fund                                  | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,850% | 1,250% | k.A. | 0,750%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Flexible Credit Fund (Anmerkung 1b)                         | 1,200%            | k.A.   | 1,200% | 0,750% | k.A.   | k.A. | 0,650%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund                                  | 0,800%            | k.A.   | 0,800% | 0,500% | k.A.   | k.A. | 0,400%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund (Anmerkung 1a)              | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,600% | k.A.   | k.A. | 0,500%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund                                 | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,700% | k.A.   | k.A. | 0,700%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Global Bond Fund  | 0,600%            | k.A.   | 0,600% | 0,400% | k.A.   | k.A. | 0,300%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund<br>(Soft Closure)       | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,850% | 1,250% | k.A. | 0,750%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund<br>(Anmerkung 1a)     | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,850% | k.A.   | k.A. | 0,750%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Global Disruption Fund                                      | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,850% | k.A.   | k.A. | 0,750%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund                           | 1,750%            | k.A.   | 1,750% | 1,100% | k.A.   | k.A. | 1,000%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Global Gender Diversity Fund                                | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,850% | 1,250% | k.A. | 0,750%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Global Green Bond Fund (Anmerkung 1a)                       | 0,600%            | 0,450% | 0,600% | 0,400% | k.A.   | k.A. | 0,300%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund                                 | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,700% | k.A.   | k.A. | 0,600%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund                           | 1,600%            | k.A.   | 1,600% | 0,900% | k.A.   | k.A. | 0,800%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - Global Opportunity Fund                                     | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,950% | k.A.   | k.A. | 0,850%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - Global Portfolio Fund                                       | 0,750%            | k.A.   | 0,750% | 0,600% | k.A.   | k.A. | 0,500%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Global Real Estate Fund                                     | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,950% | k.A.   | k.A. | 0,850%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - Global Small Cap Fund                                       | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,950% | k.A.   | k.A. | 0,850%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - Global Social Empowerment Fund (Anmerkung 1c)               | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,850% | k.A.   | k.A. | 0,750%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund                                   | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,950% | k.A.   | k.A. | 0,850%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged                     | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,950% | k.A.   | k.A. | 0,850%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Global Stars Equity Fund                                    | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,850% | 1,250% | k.A. | 0,750%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Indian Equity Fund  | 1,800%            | k.A.   | 1,800% | 1,100% | k.A.   | k.A. | 1,000%                         | 0,500% |
| Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged             | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,700% | k.A.   | k.A. | 0,600%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - Latin American Equity Fund                                  | 1,600%            | k.A.   | 1,600% | 1,100% | k.A.   | k.A. | 1,000%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - Long Duration US Bond Fund                                  | 0,600%            | k.A.   | 0,600% | 0,400% | k.A.   | k.A. | 0,300%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund                     | 0,500%            | k.A.   | 0,500% | 0,350% | k.A.   | k.A. | 0,250%                         | 0,250% |
| Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund                        | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,700% | k.A.   | k.A. | 0,600%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - Nordic Equity Fund  | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,950% | k.A.   | k.A. | 0,850%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund                                | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 1,100% | k.A.   | k.A. | 1,000%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund                                    | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 1,100% | k.A.   | k.A. | 1,000%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Nordic Stars Equity Fund                                    | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,850% | k.A.   | k.A. | 0,750%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund                         | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,700% | k.A.   | k.A. | 0,600%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund<br>(Anmerkung 1a) | 1,000%            | k.A.   | 1,000% | 0,700% | k.A.   | k.A. | 0,600%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - North American Small Cap Fund                               | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,950% | k.A.   | k.A. | 0,850%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - North American Stars Equity Fund                            | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,850% | k.A.   | k.A. | 0,750%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - North American Value Fund                                   | 1,500%            | k.A.   | 1,500% | 0,950% | k.A.   | k.A. | 0,850%                         | 0,400% |



# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

|  | Verwaltungsgebühr |      |        |        |      |      | Betriebskosten<br>(Höchstwert) |        |
|--|-------------------|------|--------|--------|------|------|--------------------------------|--------|
|  | P                 | Q    | E      | C      | S    | F    | N                              |        |
| Nordea 1 - Norwegian Bond Fund                         | 0,600%            | k.A. | 0,600% | 0,400% | k.A. | k.A. | 0,300%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - Norwegian Equity Fund                       | 1,500%            | k.A. | 1,500% | 0,950% | k.A. | k.A. | 0,850%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund              | 0,125%            | k.A. | 0,125% | 0,125% | k.A. | k.A. | 0,125%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund         | 1,800%            | k.A. | 1,800% | 1,100% | k.A. | k.A. | 1,000%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                          | 1,500%            | k.A. | 1,500% | 0,950% | k.A. | k.A. | 0,850%                         | 0,350% |
| Nordea 1 - Swedish Bond Fund                           | 0,600%            | k.A. | 0,600% | 0,400% | k.A. | k.A. | 0,300%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - Swedish Short-Term Bond Fund                | 0,125%            | k.A. | 0,125% | 0,125% | k.A. | k.A. | 0,125%                         | 0,300% |
| Nordea 1 - US Corporate Bond Fund                      | 0,700%            | k.A. | 0,700% | 0,450% | k.A. | k.A. | 0,350%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund (Anmerkung 1a) | 0,700%            | k.A. | 0,700% | 0,450% | k.A. | k.A. | 0,350%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - US High Yield Bond Fund                     | 1,000%            | k.A. | 1,000% | 0,700% | k.A. | k.A. | 0,600%                         | 0,400% |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                   | 1,100%            | k.A. | 1,100% | 0,650% | k.A. | k.A. | 0,550%                         | 0,450% |

**c) Vertriebsgebühr:** Diese Gebühr wird der Verwaltungsgesellschaft gezahlt und grundsätzlich an die lokale Vertriebsstelle oder den Vermittler weitergeleitet. Die Gebühr fällt lediglich für E-Anteile an und beläuft sich auf 0,75% pro Jahr.

**d) Performancegebühr:** Die Verwaltungsgesellschaft kann eine Performancegebühr erhalten. Die Performancegebühr wird vom Nettoinventarwert abgezogen und dem Anlageverwalter des jeweiligen Teilfonds weitergereicht.

Bei Anteilen für institutionelle Anleger (mit Ausnahme von I-Anteilen) kann die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem Ermessen vor der Erstanlage entscheiden, ob eine Performancegebühr erhoben werden soll oder nicht und wie hoch diese Performancegebühr für die Anteilsklasse sein soll.

Bei den X-Anteilsklassen kann entsprechend der zwischen den einzelnen Anlegern und der Verwaltungsgesellschaft vereinbarten separaten Honorarstruktur direkt von der Verwaltungsgesellschaft eine Performancegebühr bei den Anteilsinhabern eingezogen werden.

Der Anlageverwalter kann auf seinen Anspruch auf Zahlung einer Performancegebühr verzichten. In diesem Fall ist die Verwaltungsgesellschaft nicht berechtigt, eine Performancegebühr vom jeweiligen Teilfonds zu empfangen.

Eine Performancegebühr fällt gegebenenfalls an, wenn der Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Performancebewertungszeitraums seine jeweilige High Watermark und seine seit Zahlung der letzten Performancegebühr aufgelaufene Hurdle Rate übersteigt.

Die Performance einer Anteilsklasse wird am Ende jedes Kalenderjahres bewertet. Wird eine Anteilsklasse im Laufe eines Kalenderjahres neu aufgelegt, läuft der Performancebewertungszeitraum vom Auflegungsdatum der Anteilsklasse bis zum Ende des betreffenden Kalenderjahres.

Die High Watermark eines Anteils entspricht dem höheren der folgenden Werte: (i) der ursprüngliche Nettoinventarwert je Anteil oder (ii) der höchste Nettoinventarwert am Ende eines jeden Kalenderjahres. Der Referenzzeitraum für die Messung der Performance entspricht der gesamten Laufzeit des Teilfonds und kann nicht neu festgelegt werden.

Die geltenden Hurdle Rates sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt. Für die Hurdle Rate gilt eine Untergrenze von 0%, d. h. solange der als Hurdle Rate für eine Anteilsklasse herangezogene Zinssatz negativ ist, wird eine Hurdle Rate von 0% angesetzt. Wenn der Wert der Anteile im Kalenderjahr sinkt oder unverändert bleibt, fällt also keine Performancegebühr an.

| Teilfonds                                    | Hurdle Rate     | Max. Gebühr %<br>Klassen C, E, P, I und Q |
|--|-----------------|---|
| Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund | EURIBOR 1 Month | 15%                                       |

Die Performancegebühr fällt täglich an und wird täglich berechnet. Ihre Zahlung erfolgt jährlich nachträglich für jedes Kalenderjahr.

Am Ende des Kalenderjahres, für das die Performancegebühr berechnet werden soll, entspricht die Performancegebühr pro Anteil höchstens 15% des Wertzuwachses des Nettoinventarwerts je Anteil (ohne Performancegebühr), der die ab dem Zeitpunkt der letzten Zahlung der Performancegebühr geltende High Watermark nach Abzug der seit der letzten Zahlung der Performancegebühr aufgelaufenen Hurdle Rate übersteigt. Eine gegebenenfalls fällige Performancegebühr wird in der Regel innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem Ende jedes Kalenderjahres gezahlt.

Wird ein Teilfonds liquidiert oder zusammengelegt oder kommt es an einem Bewertungstag zu Nettorücknahmen, so gilt der anteilige Betrag der seit Jahresbeginn aufgelaufenen Wertentwicklung als fällig, der auf diese Anteile entfällt, unabhängig von der Performance, die der Teilfonds im Anschluss an die Liquidation, Zusammenlegung oder Nettorücknahmen verzeichnet.

Die frühere Performance gegenüber der Hurdle Rate wird, sobald sie verfügbar ist, in den jeweiligen wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) veröffentlicht.

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

## Beispiele für die Berechnung der Performancegebühr

| Kalenderjahr | NIW am Ende des Kalenderjahres | Performance (netto) am Ende des Kalenderjahres | Hurdle Rate | Aufgelaufene Hurdle Rate seit letzter Performancegebühr | High Watermark seit letzter Performancegebühr | Gebührensatz | Fällige Performancegebühr            |
|--------------|--------------------------------|--|-------------|---|---|--------------|--------------------------------------|
| Jahr 1       | 105                            | 5,00%  | 1,50%       | 1,50%   | Übertroffen um 5,00%*                         | 15,00%       | 5,00% - 1,50%<br>x 15,00% =<br>0,53% |
| Jahr 2       | 104                            | (0,95%)  | 1,00%       | 1,00%   | Unverändert                                   | 15,00%       | Keine                                |
| Jahr 3       | 103                            | (0,96%)  | 0%**        | 1,00%   | Unverändert                                   | 15,00%       | Keine                                |
| Jahr 4       | 106                            | 2,91%  | 3,00%       | 4,03%   | Übertroffen um 0,95%                          | 15,00%       | Keine                                |
| Jahr 5       | 113                            | 6,60%  | 1,00%       | 5,07%   | Übertroffen um 7,62%                          | 15,00%       | 7,62% - 5,07%<br>x 15,00% =<br>0,38% |

\* Der Erstzeichnungspreis stellt die erste High Watermark dar. In diesem Fall ist der Erstzeichnungspreis 100.

\*\* Bei negativem Wert wird eine Hurdle Rate von 0% angesetzt.

## Anmerkung 4 – Pensionsgeschäfte

Der Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund ist am 31.12.2021 Pensionsgeschäfte eingegangen, die in der Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente ausgewiesen sind.

Die Erträge/(Aufwendungen) aus den Pensionsgeschäften sind wie folgt:

| Name des Teilfonds                                  | Währung des Fonds | Erträge / (Aufwendungen) |
|---|-------------------|--------------------------|
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund | EUR               | 1.853.854,63             |

Die Erträge/(Aufwendungen) sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Dividenden- und Zinsforderungen“ und in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter „Nettozinsen aus Pensionsgeschäften“ ausgewiesen.

## Anmerkung 5 – Aufstellung über die Änderung der Wertpapieranlagen

Eine Aufstellung aller Käufe und Verkäufe je Teilfonds während des jeweiligen Berichtsjahrs ist in Papierform am eingetragenen Geschäftssitz der Gesellschaft, bei der Verwahrstelle und der Hauptvertriebsstelle oder den im Abschnitt „Vertreter, Zahl- und Informationsstellen außerhalb Luxemburgs“ genannten Gesellschaften kostenlos erhältlich.

## Anmerkung 6 – Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio - TER)

Diese Kennzahl drückt die Summe aller Kosten und Provisionen aus, die das Vermögen des Teilfonds auf fortlaufender Basis belasten (Betriebsaufwendungen wie in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter „Aufwendungen“ ausgewiesen, allerdings ohne „Transaktionsbezogene Kosten“) und die rückwirkend als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens des Teilfonds veranschlagt werden. Die Kennzahl enthält keine im Rahmen von Anlagezu- oder -verkäufen angefallenen Transaktionsgebühren. Sie wird gemäß den Leitlinien der Swiss Funds & Asset Management Association vom 20. April 2015 ermittelt und normalerweise nach folgender Formel berechnet:

$$\text{TER \%} = \frac{\text{Gesamtbetriebsaufwendung in WE}^*}{\text{Durchschnittliches Nettovermögen des Teilfonds in WE}^*} \times 100$$

\*WE = Währungseinheiten in der Berichtswährung des Teilfonds

Die TER wird für die vorangegangenen 12 Monate zum Stichtag des Geschäftsjahrs berechnet.

Bei neu aufgelegten Teilfonds werden die Betriebsaufwendungen annualisiert.

## Anmerkung 7 – Änderungen des Prospekts der Gesellschaft während des Berichtsjahres

Im Dezember 2021 wurde der letzte Prospekt des Fonds veröffentlicht.

Die jüngsten Fassungen der Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) für die Anteilsklassen der Fonds der Gesellschaft sind auf der Website [nordea.lu](http://nordea.lu) erhältlich.

Der aktuelle vollständige Prospekt und die aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen für die Anteilsklassen der Fonds der Gesellschaft sind ferner am eingetragenen Geschäftssitz der Gesellschaft und bei der Verwaltungsgesellschaft kostenlos in Papierform erhältlich.

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

Über etwaige wesentliche Änderungen des Prospekts werden Inhaberinnen und Inhaber von Namensanteilen durch den Versand einer Mitteilung informiert. Diese Änderungen werden auch auf [nordea.lu](http://nordea.lu) veröffentlicht. Mitteilungen an die Anteilsinhaberinnen und Anteilsinhaber sind zudem am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft und bei den Vertretern des Fonds außerhalb Luxemburgs erhältlich.

## Anmerkung 8 – Aufteilung des Portfolios nach Ländern und Wirtschaftssektoren (ungeprüft)

Die Aufteilung des Portfolios nach Wirtschaftssektoren erfolgt gemäß der Klassifizierung nach GICS Direct (ein gemeinsames Produkt von MSCI und Standard & Poor's).

## Anmerkung 9 – Anteilkapital und Anteilklassen

Nähere Angaben zum Anteilskapital und den Anteilklassen der Gesellschaft sind in den Abschnitten „die SICAV“ und „Anteilklassen“ des Prospekts der Gesellschaft zu finden.

## Anmerkung 10 – Swing-Faktor

An Geschäftstagen, an denen die Nettotransaktionen mit Teilfondsanteilen einen bestimmten Schwellenwert überschreiten, kann der NIW eines Teilfonds durch einen sogenannten Swing-Faktor angepasst werden. Dieser Faktor entspricht den geschätzten Gesamtkosten (geschätzte Steuern und Handelskosten, die dem Fonds entstehen können, und Geld-Brief-Spannen der Vermögenswerte, in denen der Teilfonds anlegt), die beim Kauf oder Verkauf von Anlagen entstehen, um Nettozeichnungen bzw. Nettorücknahmen von Anteilen nachzukommen (wobei der Teilfonds grundsätzlich eine angemessene tägliche Liquidität wahr, um die regelmäßigen Mittelflüsse ohne größere Auswirkungen auf die ordentliche Anlagetätigkeit zu bewältigen). Der NIW-Preis wird nach oben angepasst, wenn die Nettotransaktionen mit Teilfondsanteilen positiv sind (Nettozeichnungen), und er wird nach unten angepasst, wenn die Nettotransaktionen mit Teilfondsanteilen negativ sind (Nettorücknahmen).

Das Swing Pricing soll die Auswirkungen mindern, die diese Kosten auf die Anteilsinhaber haben, die zu diesem Zeitpunkt nicht mit ihren Anteilen handeln. Es wirkt sich auf die Anteilsinhaber, die mit ihren Anteilen handeln, dahingehend aus, dass deren NIW-Preis um den Swing-Faktor angepasst wird. Sofern an den Märkten auf der Käufer- und Verkäuferseite unterschiedliche Gebührenstrukturen gelten, ist der Swing-Faktor für Nettozeichnungen oder Nettorücknahmen möglicherweise nicht identisch.

Ferner hat der Verwaltungsrat die Entscheidung über die korrekte Anwendung und den Umfang der Swinging Single Pricing-Methode an die Verwaltungsgesellschaft delegiert. Obwohl alle Teilfonds dem Swing Pricing unterliegen können, fallen die von der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Schwellenwerte und Swing-Faktoren unter Umständen je nach Teilfonds unterschiedlich aus. Unter normalen Marktbedingungen beträgt der zur Anpassung verwendete Swing-Faktor höchstens 1,75% (2% ab dem Wirksamkeitstag des Prospekts vom Dezember 2021) des Betrags, auf den sich der Nettoinventarwert für alle Anteilklassen eines Teilfonds andernfalls belaufen hätte.

Die Verwaltungsgesellschaft hat beschlossen, bei der Bewertung des Nettoinventarwerts der folgenden Teilfonds den Swing Pricing-Mechanismus anzuwenden:

|  |  |   |
|--|--|---|
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund               | Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund  | Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund                              |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund | Nordea 1 - European Financial Debt Fund        | Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged          |
| Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund     | Nordea 1 - European High Yield Bond Fund       | Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund                      |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund                | Nordea 1 - European High Yield Credit Fund     | Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund (Anmerkung 1a) |
| Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund          | Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund | Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund (Anmerkung 1a)              |
| Nordea 1 - European Corporate Bond Fund            | Nordea 1 - Flexible Credit Fund (Anmerkung 1b) | Nordea 1 - US Corporate Bond Fund                                   |
|  |  | Nordea 1 - US High Yield Bond Fund                                  |

Zum Jahresende 2021 wurde kein Swing-Faktor ausgewiesen.

## Anmerkung 11 – Transaktionsgebühren

Die Transaktionsgebühren sind grundsätzlich die Summe aus Broker-Kosten und Bankprovisionen.

Transaktionsbezogene Kosten, die in der nachstehenden Tabelle und in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen sind, umfassen die Broker-Gebühren und Bankprovisionen für Derivate.

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

Bei den in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Broker-Kosten handelt es sich um die Aufwendungen und ggf. Börsenumsatzsteuern, die vom Broker direkt in Rechnung gestellt werden und diesem beim Settlement von Aktien, Anleihen und Optionen gezahlt werden. Sie werden zum Zeitpunkt der Transaktion als integraler Bestandteil der Einstandskosten verbucht.

| Name des Teilfonds  | Währung | Broker-Kosten in der Basiswährung des Teilfonds | Transaktionsbezogene Kosten in der Basiswährung des Teilfonds |
|---|---------|---|---|
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund                                      | EUR     | 110.459,66                                      | 178.064,00  |
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                                     | EUR     | 940.511,61                                      | 2.059.446,62  |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund                                     | EUR     | 1.156.507,60                                    | 2.311.587,10  |
| Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund                            | USD     | 360.887,67                                      | 46.782,34   |
| Nordea 1 - Asian Stars Equity Fund                              | USD     | 305.991,93                                      | 28.050,25   |
| Nordea 1 - Balanced Income Fund                                 | EUR     | -   | 187.595,89  |
| Nordea 1 - Chinese Bond Fund (Anmerkung 1c)                     | CNH     | -   | 65.493,08   |
| Nordea 1 - Chinese Equity Fund                                  | USD     | 668.757,11                                      | 57.152,01   |
| Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund                       | EUR     | -   | 14.508,04   |
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund                             | DKK     | -   | 2.092.478,74  |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund                            | USD     | -   | 397.119,78  |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund              | USD     | -   | 27.393,23   |
| Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund                  | USD     | -   | 82.089,58   |
| Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund              | USD     | -   | 53.433,93   |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund                             | USD     | -   | 299.226,74  |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund                           | USD     | 4.589.013,18                                    | 271.541,34  |
| Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund                       | USD     | -   | 15.475,73   |
| Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund (Anmerkung 1b)           | EUR     | 229.414,76                                      | 34.022,70   |
| Nordea 1 - European Corporate Bond Fund                         | EUR     | -   | 135.600,52  |
| Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund                   | EUR     | -   | 73.143,45   |
| Nordea 1 - European Covered Bond Fund                           | EUR     | -   | 596.900,90  |
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund             | EUR     | -   | 174.160,98  |
| Nordea 1 - European Cross Credit Fund                           | EUR     | -   | 44.638,60   |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund                         | EUR     | -   | 136.326,27  |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund                        | EUR     | -   | 307.979,01  |
| Nordea 1 - European High Yield Credit Fund                      | EUR     | -   | 42.106,05   |
| Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund                  | EUR     | -   | 68.794,67   |
| Nordea 1 - European Inflation Linked Bond Fund                  | EUR     | -   | 429,80  |
| Nordea 1 - European Small and Mid Cap Equity Fund               | EUR     | 252.630,69                                      | 8.853,50  |
| Nordea 1 - European Stars Equity Fund                           | EUR     | 1.465.154,19                                    | 17.480,24   |
| Nordea 1 - Flexible Credit Fund (Anmerkung 1b)                  | EUR     | -   | 29.615,57   |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund                           | EUR     | -   | 709.217,55  |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund (Anmerkung 1a)       | EUR     | -   | 16.619,58   |
| Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund                          | GBP     | 1.025.916,85                                    | 350.977,90  |
| Nordea 1 - Global Bond Fund                                     | EUR     | -   | 10.334,64   |
| Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund                  | EUR     | 4.841.918,80                                    | 94.031,37   |
| Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund (Anmerkung 1a) | USD     | 149.678,99                                      | 10.600,62   |
| Nordea 1 - Global Disruption Fund                               | USD     | 103.665,23                                      | 30.918,38   |
| Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund                    | EUR     | 16.486,01                                       | 9.109,52  |
| Nordea 1 - Global Gender Diversity Fund                         | USD     | 65.851,03                                       | 17.501,84   |
| Nordea 1 - Global Green Bond Fund (Anmerkung 1a)                | EUR     | -   | 2.467,36  |
| Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund                          | USD     | -   | 36.976,80   |
| Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund                    | USD     | 489.697,05                                      | 22.522,01   |
| Nordea 1 - Global Opportunity Fund                              | EUR     | 124.006,46                                      | 17.106,36   |
| Nordea 1 - Global Portfolio Fund                                | EUR     | 83.799,05                                       | 7.129,91  |
| Nordea 1 - Global Real Estate Fund                              | USD     | 291.553,94                                      | 14.712,86   |
| Nordea 1 - Global Small Cap Fund                                | USD     | 130.574,80                                      | 11.142,54   |

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

| Name des Teilfonds  | Währung | Broker-Kosten in der Basiswährung des Teilfonds | Transaktionsbezogene Kosten in der Basiswährung des Teilfonds |
|---|---------|---|---|
| Nordea 1 - Global Social Empowerment Fund (Anmerkung 1c)            | USD     | 433.920,28                                      | 18.944,50   |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund                                | EUR     | 1.473.298,90                                    | 51.075,38   |
| Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged                  | EUR     | 326.940,60                                      | 105.461,09  |
| Nordea 1 - Global Stars Equity Fund                                 | USD     | 942.585,10                                      | 30.361,80   |
| Nordea 1 - Indian Equity Fund                                       | USD     | 1.373.598,96                                    | 83.089,39   |
| Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged          | USD     | 85,95   | 54.945,02   |
| Nordea 1 - Latin American Equity Fund                               | EUR     | 116.848,03                                      | 72.954,79   |
| Nordea 1 - Long Duration US Bond Fund                               | USD     | -   | 10.306,53   |
| Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund                  | EUR     | -   | 620.164,21  |
| Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund                     | USD     | -   | 28.693,29   |
| Nordea 1 - Nordic Equity Fund                                       | EUR     | 100.030,19                                      | 7.831,20  |
| Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund                             | EUR     | 61.251,83                                       | 14.529,37   |
| Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund                                 | EUR     | 33.652,93                                       | 7.156,00  |
| Nordea 1 - Nordic Stars Equity Fund                                 | EUR     | 53.640,60                                       | 9.420,00  |
| Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund                      | USD     | 1.141,89  | 111.700,80  |
| Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund (Anmerkung 1a) | USD     | -   | 17.185,10   |
| Nordea 1 - North American Small Cap Fund                            | USD     | 42.176,16                                       | 14.635,50   |
| Nordea 1 - North American Stars Equity Fund                         | USD     | 350.815,07                                      | 34.511,25   |
| Nordea 1 - North American Value Fund                                | USD     | 334.045,02                                      | 34.559,97   |
| Nordea 1 - Norwegian Bond Fund                                      | NOK     | -   | 87.346,35   |
| Nordea 1 - Norwegian Equity Fund                                    | NOK     | 1.009.179,39                                    | 51.739,12   |
| Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund                           | NOK     | -   | 44.589,55   |
| Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund                      | USD     | 835.359,74                                      | 77.031,62   |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                                       | EUR     | 2.816.929,22                                    | 982.030,30  |
| Nordea 1 - Swedish Bond Fund  | SEK     | -   | 70.328,30   |
| Nordea 1 - Swedish Short-Term Bond Fund                             | SEK     | -   | 42.285,49   |
| Nordea 1 - US Corporate Bond Fund                                   | USD     | -   | 636.633,83  |
| Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund (Anmerkung 1a)              | USD     | -   | 34.199,53   |
| Nordea 1 - US High Yield Bond Fund                                  | USD     | -   | 221.097,91  |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                                | USD     | 54.020,02                                       | 74.107,87   |

## Anmerkung 12 – Zwischenausschüttung

### a) Jährliche Ausschüttung

Die Gesellschaft hat, wie im Bericht des Verwaltungsrats des vorangegangenen Geschäftsjahres vorgesehen, am 27. April 2021, dem Ex-Tag, jährliche Dividenden erklärt und am 30. April 2021 ausgezahlt.

### b) Zwischenausschüttung

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat im Berichtsjahr für folgende M-Anteilsklassen monatliche Ausschüttungen beschlossen:

| Name des Teilfonds                             | Anteilsklasse | Monatlicher Ausschüttungssatz | Ausschüttungswährung | Ausgeschütteter Betrag je Anteil |
|--|---------------|-------------------------------|----------------------|----------------------------------|
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                    | HM - SGD      | 0,25%                         | SGD                  | 0,581347                         |
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund            | HMX - JPY     | 0,15%                         | JPY                  | 76,23595                         |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund           | HMX - EUR     | 0,40%*                        | EUR                  | 5,378774                         |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund       | MP            | 0,35%**                       | EUR                  | 1,319037                         |
| Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund   | MP            | 0,25%                         | EUR                  | 0,31239                          |
| Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund | MX            | 0,46%***                      | EUR                  | 6,158469                         |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                  | HM - AUD      | 0,25%                         | AUD                  | 0,770237                         |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                  | HM - GBP      | 0,25%                         | GBP                  | 0,392694                         |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                  | HM - SGD      | 0,25%                         | SGD                  | 0,70424                          |

# Anmerkungen zum Abschluss per 31.12.2021 (Fortsetzung)

| Name des Teilfonds                   | Anteilsklasse | Monatlicher Ausschüttungssatz | Ausschüttungswährung | Ausgeschütteter Betrag je Anteil |
|--------------------------------------|---------------|-------------------------------|----------------------|----------------------------------|
| Nordea 1 - Stable Return Fund        | HM - USD      | 0,25%                         | USD                  | 0,528873                         |
| Nordea 1 - Stable Return Fund        | ME            | 0,25%                         | EUR                  | 0,427672                         |
| Nordea 1 - Stable Return Fund        | MP            | 0,25%                         | EUR                  | 0,444681                         |
| Nordea 1 - US Total Return Bond Fund | MI            | 0,40%****                     | USD                  | 4,869654                         |

(\*) 0,52% im Januar und Februar 2021

(\*\*) 0,36% im Januar und Februar 2021

(\*\*\*) 0,51% im Januar und Februar 2021

(\*\*\*\*) 0,30% im Januar und Februar 2021

Die ausgewiesenen monatlichen Ausschüttungssätze beziehen sich auf das gesamte Nettovermögen der M-Anteilsklassen am letzten Geschäftstag des Vormonats.

## Anmerkung 13 – Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Mit Wirkung ab dem 22. Januar 2022 wurde J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A., die als Verwahrstelle der Gesellschaft fungiert, auf J.P. Morgan AG verschmolzen, die gleichzeitig ihre Rechtsform von einer deutschen Aktiengesellschaft in eine europäische Aktiengesellschaft (Societas Europaea) änderte und nunmehr unter J.P. Morgan SE firmiert, (die „Verschmelzung“). Infolge der Verschmelzung änderte sich der Name der Verwahrstelle in J.P. Morgan SE, Luxembourg Branch.

# Informationen für die Anteilsinhaber

Die folgenden Dokumente sind in Papierform am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, bei der Verwaltungsgesellschaft, oder den Vertretern und Zahlstellen an deren jeweiligen Geschäftstagen kostenlos erhältlich:

- die Satzung der Gesellschaft
- der Verkaufsprospekt der Gesellschaft
- die Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) der Gesellschaft
- der Zeichnungsantrag
- die regelmäßigen Finanzberichte
- die von Zeit zu Zeit veröffentlichten Marketingunterlagen

Eine aktuelle Fassung der Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) wird auf [nordea.lu](http://nordea.lu) und je nach Landessprache(n) der Länder, in denen die Gesellschaft, ein Teilfonds oder eine Anteilsklasse zum öffentlichen Vertrieb zugelassen sind, auf den landesspezifischen Websites von Nordea zur Verfügung gestellt, deren Adressen jeweils auf das internationale Länderkürzel der betreffenden Länder enden. Die portugiesische Fassung der Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) wird jedoch lediglich auf [nordea.lu](http://nordea.lu) zur Verfügung stehen.

Die folgenden Dokumente können am eingetragenen Sitz der Gesellschaft oder bei der Verwaltungsgesellschaft an deren jeweiligen Geschäftstagen eingesehen werden:

- der Verwaltungsgesellschaftsvertrag zwischen der Gesellschaft und Nordea Investment Funds S.A.
- der Depot- und Verwahrstellenvertrag zwischen der Gesellschaft, der Verwaltungsgesellschaft und J.P. Morgan SE.

Einladungen zu allen Hauptversammlungen der Anteilsinhaber werden den Inhabern von Namensanteilen der Gesellschaft per Post zugesandt.

Zeichnungen können nur auf Grundlage des gültigen Prospektes zusammen mit dem neuesten Jahresbericht und dem neuesten Halbjahresbericht, sofern dieser nach dem neuesten Jahresbericht veröffentlicht wurde, vorgenommen werden.

## Angaben zur Risikotransparenz (ungeprüft)

### A) Allgemeines

Die Verwaltungsgesellschaft setzt ein Risikomanagementverfahren ein, mit dessen Hilfe das mit den Anlagepositionen verbundene Risiko sowie der Anteil der Positionen am Gesamtrisikoprofil der Anlageportfolios der Teilfonds jederzeit überwacht werden können. Gemäß dem Luxemburger Gesetz vom 17. Dezember 2010 sowie den geltenden Verordnungen der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) erstattet die Verwaltungsgesellschaft der CSSF regelmäßig über das Risikomanagementverfahren Bericht.

Die Verwaltungsgesellschaft stellt auf der Basis angemessener, geeigneter Methoden sicher, dass das mit Derivaten verbundene Gesamtrisiko den Gesamtnettowert des Portfolios nicht übersteigt. Hierzu setzt die Verwaltungsgesellschaft folgende Methoden ein:

- **Commitment-Ansatz:** Die Positionen in Finanzderivaten werden unter Berücksichtigung aller Aufrechnungs- und Absicherungseffekte in äquivalente Positionen der Basiswerte umgewandelt.
- **Value-at-Risk-Ansatz (VaR-Ansatz):** Beim VaR handelt es sich um ein mathematisch-statistisches Konzept, das im Finanzsektor als Standard-Risikomaß eingesetzt wird. Der VaR gibt den potenziellen Verlust eines Portfolios in einem gegebenen Zeitraum (so genannte Halteperiode) bei einer gegebenen Wahrscheinlichkeit (so genanntes Konfidenzniveau) an. Der VaR wird auf Ebene des gesamten Teilfonds bei einer Halteperiode von höchstens einem Monat (20 Geschäftstage) und einem Konfidenzniveau von mindestens 95% ermittelt,
  - **Relativer VaR-Ansatz:** Der relative VaR-Ansatz misst den VaR an demjenigen eines Referenzportfolios. Der relative VaR darf den VaR des Referenzportfolios um höchstens 100% übersteigen, d.h. das Doppelte des Referenz-VaR betragen (200%). Dabei ist das Referenzportfolio ein korrektes Abbild der Anlagepolitik des Teilfonds.
  - **Absoluter VaR-Ansatz:** Beim absoluten VaR-Ansatz darf der VaR (Konfidenzniveau mindestens 95%, Halteperiode maximal 20 Tage) des Teilfonds höchstens 20% des Nettovermögens des Teilfonds betragen (Konfidenzniveau von 99%, Halteperiode 20 Tage). Die Obergrenze von 20% wird entsprechend angepasst, wenn eine andere Halteperiode oder ein anderes Konfidenzniveau gelten. Informationen zum maximalen Limit sind angegeben.

#### Ergänzungen zum VaR:

Für Teilfonds, für die das mit Derivaten verbundene Gesamtrisiko über den VaR-Ansatz verfolgt und überwacht wird, ermittelt die Verwaltungsgesellschaft zusätzlich die Summe der Nominalwerte bzw. Äquivalenzwerte aller relevanten Derivate und schätzt diesbezüglich einen erwarteten Durchschnittswert (Hebel). Der Schätzwert kann je nach Marktbedingungen vom tatsächlichen Wert am Berichtsstichtag abweichen. Der veröffentlichte erwartete Hebel ist explizit nicht als Anlagelimit zu verstehen.



# Angaben zur Risikotransparenz (ungeprüft) (Fortsetzung)

Der Verwaltungsrat entscheidet, welche Methode zur Ermittlung des Gesamtrisikos jedes Teilfonds von Nordea 1, SICAV gewählt wird. Es muss nicht für alle Teilfonds die gleiche Methode angewandt werden. Bei den meisten Teilfonds der Nordea 1, SICAV wird das Gesamtrisiko über den Commitment-Ansatz ermittelt. Die nachstehende Tabelle enthält alle Teilfonds, bei denen das Gesamtrisiko über den VaR-Ansatz ermittelt wird, zusammen mit dem gewählten Konzept:

| Teilfonds   | Methode       |
|---|---------------|
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund                          | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                         | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund                         | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - Balanced Income Fund                     | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund           | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund  | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund                 | Relativer VaR |
| Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund           | Relativer VaR |
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund             | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - Flexible Credit Fund                     | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund               | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund          | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund              | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund        | Absoluter VaR |
| Nordea 1 - Norwegian Bond Fund                      | Relativer VaR |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                       | Absoluter VaR |

## B) Methoden zur Ermittlung des Gesamtrisikos

### Ad 1) Absoluter VaR-Ansatz:

Im Zeitraum 01.01.2021 bis 31.12.2021 (der „Zeitraum“) wurde der absolute VaR-Ansatz zur Beobachtung und Messung des mit dem Einsatz von Derivaten bei den Teilfonds einhergehenden Gesamtrisikos herangezogen. Die nachstehende Tabelle zeigt:

- (i) Minimum, Maximum und Durchschnitt des täglichen VaR im Zeitraum.
- (ii) Das regulatorische VaR-Limit für jeden dieser Teilfonds.

| Teilfonds   | Minimum | Maximum | Durchschnitt | Regulatorisches Limit |
|---|---------|---------|--------------|-----------------------|
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund                          | 2,3%    | 4,2%    | 3,2%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                         | 3,3%    | 7,5%    | 4,7%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund                         | 5,0%    | 11,7%   | 7,0%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - Balanced Income Fund                     | 1,7%    | 4,6%    | 2,7%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund           | 0,4%    | 1,4%    | 0,7%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund  | 2,8%    | 6,8%    | 4,2%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund | 0,7%    | 4,0%    | 1,6%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund             | 0,7%    | 4,8%    | 1,4%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - Flexible Credit Fund                     | 0,6%    | 2,7%    | 1,2%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund               | 0,8%    | 3,0%    | 1,6%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund          | 1,9%    | 6,0%    | 3,3%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund              | 3,5%    | 6,4%    | 5,1%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund        | 1,8%    | 4,5%    | 2,9%         | 20,0%                 |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                       | 3,8%    | 6,6%    | 5,3%         | 20,0%                 |



# Angaben zur Risikotransparenz (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Summe der Nominalwerte bzw. Äquivalenzwerte aller relevanten Derivate (Hebel) im Zeitraum 01.01.2021 bis 31.12.2021 ergab für 2021 folgenden durchschnittlichen Hebel:

| Teilfonds   | Minimum<br>(in % des NIW)* | Maximum<br>(in % des NIW)* | Durchschnitt<br>(in % des NIW)* |
|---|----------------------------|----------------------------|---------------------------------|
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund                          | 274,4%                     | 541,9%                     | 346,9%                          |
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                         | 386,7%                     | 760,5%                     | 503,5%                          |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund                         | 588,9%                     | 1150,0%                    | 748,0%                          |
| Nordea 1 - Balanced Income Fund                     | 304,3%                     | 504,0%                     | 380,2%                          |
| Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund           | 138,4%                     | 190,9%                     | 150,8%                          |
| Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund  | 200,4%                     | 414,6%                     | 281,0%                          |
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund | 343,5%                     | 833,0%                     | 435,5%                          |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund             | 100,3%                     | 134,7%                     | 110,3%                          |
| Nordea 1 - Flexible Credit Fund                     | 62,8%                      | 97,2%                      | 77,4%                           |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund               | 252,5%                     | 408,2%                     | 304,4%                          |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund          | 361,7%                     | 662,2%                     | 464,5%                          |
| Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund              | 244,4%                     | 404,6%                     | 289,5%                          |
| Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund        | 144,6%                     | 196,4%                     | 169,6%                          |
| Nordea 1 - Stable Return Fund                       | 221,4%                     | 373,6%                     | 263,8%                          |

\* Berechnet auf der Basis von mindestens alle zwei Wochen erfassten Daten.

## Ad 2) Relativer VaR-Ansatz:

Im Zeitraum 01.01.2021 bis 31.12.2021 (der „Zeitraum“) wurde der relative VaR-Ansatz zur Beobachtung und Messung des mit dem Einsatz von Derivaten bei den Teilfonds einhergehenden Gesamtrisikos herangezogen. Die nachstehende Tabelle zeigt:

- (i) Das Referenzportfolio für jeden dieser Teilfonds.
- (ii) Minimum, Maximum und Durchschnitt des täglichen VaR im Zeitraum.
- (iii) Das regulatorische VaR-Limit für jeden dieser Teilfonds.

| Teilfonds                                 | Referenzportfolio   | Minimum | Maximum | Durchschnitt | Regulatorisches Limit |
|---|---|---------|---------|--------------|-----------------------|
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund       | JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified      | 84%     | 151%    | 96%          | 200%                  |
| Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund | JP Morgan GBI Emerging Market Global Diversified              | 83%     | 107%    | 96%          | 200%                  |
| Nordea 1 - Norwegian Bond Fund            | Bloomberg Barclays Series-E Norway Govt All > 1 Yr Bond Index | 68%     | 102%    | 83%          | 200%                  |

Die Summe der Nominalwerte bzw. Äquivalenzwerte aller relevanten Derivate (Hebel) im Zeitraum 01.01.2021 bis 31.12.2021 ergab für 2021 folgende Hebel (Leverage):

| Teilfonds                                 | Minimum<br>(in % des NIW)* | Maximum<br>(in % des NIW)* | Durchschnitt<br>(in % des NIW)* |
|---|----------------------------|----------------------------|---------------------------------|
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund       | 48%                        | 102%                       | 73%                             |
| Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund | 55%                        | 142%                       | 96%                             |
| Nordea 1 - Norwegian Bond Fund            | 65%                        | 79%                        | 75%                             |

\* Berechnet auf der Basis von mindestens alle zwei Wochen erfassten Daten.

## Ad 3) Commitment-Ansatz

Das mit dem Einsatz von Derivaten einhergehende Gesamtrisiko bei den nicht unter Ad 1) bzw. Ad 2) aufgeführten Teilfonds wurde im Berichtszeitraum 01.01.2021 bis 31.12.2021 nach dem Commitment-Ansatz ermittelt.

# Angaben zur Vergütung (ungeprüft)

## A) Allgemeines

Die Verwaltungsgesellschaft hat eine Vergütungspolitik umgesetzt, die auf der Vergütungspolitik der Nordea Group basiert und mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und diesem zuträglich ist und nicht zur Übernahme von Risiken ermutigt, die mit dem Risikoprofil der Fonds unvereinbar sind. Die Verwaltungsgesellschaft betrachtet es als Verpflichtung, dafür Sorge zu tragen, dass alle dieser Politik unterliegenden Einzelpersonen - zu denen die Verwaltungsratsmitglieder, Führungskräfte und Mitarbeiter gehören - diese Politik befolgen.

Die Vergütungspolitik beinhaltet die gute Unternehmensführung und eine Vergütungsstruktur, die ein ausgewogenes Verhältnis zwischen festen und variablen Bestandteilen aufweist, sowie Regeln für die Ausrichtung auf das Risiko und die langfristige Leistung. Diese Ausrichtungsregeln sind so konzipiert, dass sie bei bestimmten Abwägungen beispielsweise im Hinblick auf die Unternehmensstrategie, -ziele, -werte und -interessen, mit den Interessen der Verwaltungsgesellschaft, des Fonds und der Anteilshaberinnen und Anteilshaber vereinbar sind und Maßnahmen zur Vermeidung von Interessenkonflikten umfassen. Die Verwaltungsgesellschaft stellt sicher, dass die Berechnung jedweder variablen Vergütung auf der jeweiligen Mehrjahresperformance des betreffenden Fonds basiert und die tatsächliche Auszahlung dieser Vergütung über denselben Zeitraum verteilt wird. Mitarbeiter in Kontrollfunktionen erhalten keine variable Vergütung.

Die Leistungsbeurteilung erfolgt sowohl auf Ebene der Nordea Group als auch auf Ebene der Verwaltungsgesellschaft. Individuelle Leistungsbeurteilungen basieren auf einer Gewichtung finanzieller und nicht-finanzieller Ziele, die mit den besonderen Aufgaben und Funktionen verbunden sind. Der Grundsatz der individuellen Leistungsbeurteilung basiert daher auf einer Bewertung der erreichten Ziele sowie einer Würdigung der langfristigen Wertschöpfung des Mitarbeiters. Die Leistung spiegelt darüber hinaus eine Beurteilung der fachlichen und sozialen Kompetenz wider und ist mit den erzielten Erfolgen des jeweiligen Mitarbeiters verbunden. Die angewandten Kriterien zur Festlegung der festen Vergütung sind die Komplexität der Tätigkeit, das Maß an Verantwortung, die Berufserfahrung sowie die Bedingungen des lokalen Markts.

Die Politik wird vom Vergütungsausschuss formuliert und vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft genehmigt. Die Politik folgt einem definierten Prozess, der die Grundsätze, Genehmigung, Kommunikation, Umsetzung, Überprüfung und Aktualisierung der Politik festlegt und den Verwaltungsrat sowie das Senior Management, die Personalabteilung, die interne Revision und andere Kontrollfunktionen einbezieht.

## B) Methode

In Anbetracht der funktionalen Struktur der Verwaltungsgesellschaft im Rahmen ihrer Rolle als Verwaltungsgesellschaft von OGAWs und AIFs stellen die nachfolgenden Angaben den Teil der gesamten Mitarbeitervergütung der Verwaltungsgesellschaftsfunktion innerhalb der Verwaltungsgesellschaft dar, der allen verwalteten Fonds, unter Berücksichtigung sowohl von Nicht-OGAWs als auch von OGAWs, im Verhältnis zum gesamten Nettovermögen der Gesellschaft zurechenbar ist und Beauftragte von Unternehmen einschließt, denen die Verwaltungsgesellschaft Portfolioverwaltungsfunktionen übertragen hat, (die „Beauftragten“). Nach dieser Methode belief sich die durchschnittliche Anzahl der berücksichtigten Mitarbeiter auf 340, einschließlich Senior Management.

Angaben zur Vergütung per 31. Dezember 2021:

| Fonds           | Vergütungsgesamtbetrag (EUR)<br>einschließlich Vergütung etwaiger<br>Beauftragter |               | Senior Management (EUR) |
|-----------------|---|---------------|-------------------------|
|                 | Fest  | Variabel      |                         |
| Nordea 1, SICAV | 28.664.033,03   | 11.377.547,22 | 981.194                 |

# Angaben gemäß der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

Auf Grundlage der Analyse der Verwaltungsgesellschaft erstrecken sich diese Angaben auf Total Return Swaps, Equity Swaps und Pensionsgeschäfte.

## Allgemeine Angaben

Die nachstehende Tabelle zeigt den absoluten Betrag, der in Equity Swaps, Total Return Swaps und Pensionsgeschäfte investiert wurde, (in der Basiswährung des jeweiligen Teilfonds) und als Anteil am Gesamtvermögen:

| Fondsname   | Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund<br>(in EUR) | Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund<br>(in EUR) |
|---|---|---|---|--|
| <b>Marktwert der Equity Swaps (*)</b>                 | 120.695.458,47                          | 243.475.865,48                          | -   | 1.879.508,38   |
| % des Nettovermögens                                  | 2,37%                                   | 4,90%                                   | -   | 6,82%  |
| <b>Marktwert der Total Return Swaps (*)</b>           | 21.202.195,86                           | 56.976.330,79                           | -   | -  |
| % des Nettovermögens                                  | 0,42%                                   | 1,15%                                   | -   | -  |
| <b>Marktwert der Pensionsgeschäfte (**)</b>           | -                                       | -                                       | 536.916.463,35  | -  |
| % des Nettovermögens                                  | -                                       | -                                       | 77,60%  | -  |
| <b>Marktwert der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte</b> | 141.897.654,33                          | 300.452.196,27                          | 536.916.463,35  | 1.879.508,38   |
| % des Nettovermögens                                  | 2,79%                                   | 6,05%                                   | 77,60%  | 6,82%  |

(\*) Summe der absoluten Marktwerte

(\*\*) Der Marktwert repräsentiert die „Verpflichtung in der Basiswährung des Teilfonds“ gemäß dem Ausweis in der Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente und den Wert der Position „Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)“ gemäß dem Ausweis in der Nettovermögensaufstellung.

## Angaben zur Konzentration

Barclays Bank Ireland PLC und BofA Securities Europe SA sind die beiden Gegenparteien bei Equity Swaps und Total Return Swaps. Bei Pensionsgeschäften gibt es fünf Gegenparteien:

- BNP Paribas SA;
- Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA;
- Deutsche Bank AG;
- JP Morgan SE;
- UBS Europe SE.

## Aggregierte Transaktionsdaten für die einzelnen Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

Für Equity Swaps und Total Return Swaps wurden Barsicherheiten gestellt.

Für den Verkauf von Wertpapieren im Rahmen von Pensionsgeschäften entgegengenommene Barmittel werden als Gesamtheit und nicht von anderen Barmitteln getrennt verwaltet. Für Pensionsgeschäfte werden keine Barsicherheiten entgegengenommen oder gestellt, da ein etwaiges Netto-Exposure durch die Neubewertung des Geschäfts ausgeglichen wird.

Sämtliche Geschäfte werden bilateral abgewickelt und gecleart.

In der nachfolgenden Tabellen sind der Marktwert und die Sicherheit der Equity Swaps, Total Return Swaps und Pensionsgeschäfte ausgewiesen, aufgeschlüsselt nach Gegenpartei und Laufzeit:

| Teilfonds<br>Basiswährung<br>Gegenpartei (Land)<br>Instrumentenart<br>Restlaufzeit | Marktwert*<br>in der Basiswährung | Von der Gegenpartei<br>erhaltene/(gezahlte)<br>Sicherheit**<br>in der Basiswährung |
|--|-----------------------------------|--|
| <b>Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund</b>   |                                   |  |
| <b>EUR</b>   |                                   |  |
| <b>Barclays Bank Ireland PLC (Irland)</b>  | <b>13.207.709,97</b>              | <b>(37.990.000,00)</b>   |
| <b>Equity Swaps</b>  |                                   |  |
| Ein bis drei Monate  | (169.030,29)                      |  |
| Drei Monate bis ein Jahr   | 22.029.915,15                     |  |
| Über ein Jahr  | 1.517.758,72                      |  |
| <b>Total Return Swaps</b>  |                                   |  |
| Drei Monate bis ein Jahr   | (10.170.933,61)                   |  |
| <b>BofA Securities Europe SA (Frankreich)</b>                                      | <b>26.547.713,57</b>              | <b>31.960.000,00</b>   |
| <b>Equity Swaps</b>  |                                   |  |
| Drei Monate bis ein Jahr   | 26.547.713,57                     |  |

# Angaben gemäß der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Fortsetzung)

| Teilfonds<br>Basiswährung<br>Gegenpartei (Land)<br>Instrumentenart<br>Restlaufzeit | Marktwert*<br>in der Basiswährung | Von der Gegenpartei<br>erhaltene/ (gezahlte)<br>Sicherheit**<br>in der Basiswährung |
|--|-----------------------------------|---|
| <b>Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund</b>   |                                   |   |
| <b>EUR</b>   |                                   |   |
| <b>Barclays Bank Ireland PLC (Irland)</b>  | <b>39.055.737,21</b>              | <b>(84.180.000,00)</b>  |
| <b>Equity Swaps</b>  |                                   |   |
| Ein bis drei Monate  | (10.665,52)                       |   |
| Drei Monate bis ein Jahr   | 57.359.581,70                     |   |
| Über ein Jahr  | 4.242.054,98                      |   |
| <b>Total Return Swaps</b>  |                                   |   |
| Drei Monate bis ein Jahr   | (22.535.233,95)                   |   |
| <b>BofA Securities Europe SA (Frankreich)</b>                                      | <b>43.604.810,25</b>              | <b>53.370.000,00</b>  |
| <b>Equity Swaps</b>  |                                   |   |
| Drei Monate bis ein Jahr   | 47.072.317,92                     |   |
| <b>Total Return Swaps</b>  |                                   |   |
| Drei Monate bis ein Jahr   | (3.467.507,67)                    |   |
| <b>Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund</b>                         |                                   |   |
| <b>EUR</b>   |                                   |   |
| <b>BNP Paribas SA (Frankreich)</b>   |                                   |   |
| <b>Pensionsgeschäfte</b>   |                                   |   |
| Eine Woche bis ein Monat   | 27.967.199,95                     |   |
| <b>Credit Agricole Corporate &amp; Investment Bank SA (Frankreich)</b>             |                                   |   |
| <b>Pensionsgeschäfte</b>   |                                   |   |
| Ein bis drei Monate  | 48.152.280,83                     |   |
| <b>Deutsche Bank AG (Deutschland)</b>  |                                   |   |
| <b>Pensionsgeschäfte</b>   |                                   |   |
| Eine Woche bis ein Monat   | 158.951.953,33                    |   |
| Ein bis drei Monate  | 50.989.230,00                     |   |
| <b>JP Morgan SE (Deutschland)</b>  |                                   |   |
| <b>Pensionsgeschäfte</b>   |                                   |   |
| Ein Tag bis eine Woche   | 49.970.813,88                     |   |
| Ein bis drei Monate  | 199.128.049,80                    |   |
| <b>UBS Europe SE (Deutschland)</b>   |                                   |   |
| <b>Pensionsgeschäfte</b>   |                                   |   |
| Ein bis drei Monate  | 1.756.935,56                      |   |
| <b>Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund</b>                                |                                   |   |
| <b>EUR</b>   |                                   |   |
| <b>BofA Securities Europe SA (Frankreich)</b>                                      | <b>(596.185,11)</b>               | <b>(2.050.000,00)</b>   |
| <b>Equity Swaps</b>  |                                   |   |
| Ein bis drei Monate  | 17.680,00                         |   |
| Drei Monate bis ein Jahr   | (629.879,90)                      |   |
| Über ein Jahr  | 16.014,79                         |   |

(\*) Für „Equity Swaps“ und „Total Return Swaps“ entspricht der Marktwert dem Wert der Position „Nicht realisierte(r) Wertzuwachs/(-minderung) in der Basiswährung des Teilfonds“ gemäß dem Ausweis in der entsprechenden Tabelle in der Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente. Für „Pensionsgeschäfte“ repräsentiert der Marktwert die „Verpflichtung in der Basiswährung des Teilfonds“ gemäß dem Ausweis in der Aufstellung der derivativen Finanzinstrumente und den Wert der Position „Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften (Anmerkung 2)“ gemäß dem Ausweis in der Nettovermögensaufstellung.

(\*\*) Barsicherheiten werden auf Gegenparteebene zu einem Nettobetrag saldiert und könnten sich daher auf viele Instrumentenarten beziehen.

# Angaben gemäß der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Fortsetzung)

## **Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten**

Barsicherheiten für Equity Swaps und Total Return Swaps werden nicht weiterverwendet, da sie als Einlage platziert werden.

## **Verwahrung von Sicherheiten, die der Organismus für gemeinsame Anlagen im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps erhalten hat.**

Sämtliche Barsicherheiten werden auf Sammelkonten, aber gesondert von den Vermögenswerten von J.P. Morgan gehalten.

## **Verwahrung von Sicherheiten, die der Organismus für gemeinsame Anlagen im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps gestellt hat**

Die von den Teilfonds gestellten Sicherheiten werden auf Sammelkonten bei der Gegenpartei Barclays Bank Ireland PLC und gesonderten Konten bei der Gegenpartei BofA Securities Europe SA gehalten.

## **Angaben zu Rendite und Kosten der einzelnen Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps.**

Sämtliche Renditen für Equity Swaps und Total Return Swaps werden den jeweiligen Teilfonds zugerechnet. Die Transaktionskosten können nicht gesondert ermittelt werden.

# Angaben gemäß der Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)

Unter Artikel 8 fallende Teilfonds

Transparenz bei der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale und nachhaltiger Investitionen in regelmäßigen Berichten:

| Name des Teilfonds  |   |
|---|---|
| Nordea 1 - Asia ex Japan Equity Fund                        | Nordea 1 - Global Listed Infrastructure Fund                        |
| Nordea 1 - Asian Stars Equity Fund                          | Nordea 1 - Global Opportunity Fund                                  |
| Nordea 1 - Chinese Equity Fund                              | Nordea 1 - Global Portfolio Fund                                    |
| Nordea 1 - Danish Covered Bond Fund                         | Nordea 1 - Global Real Estate Fund                                  |
| Nordea 1 - Emerging Markets Debt Total Return Fund          | Nordea 1 - Global Small Cap Fund                                    |
| Nordea 1 - Emerging Stars Bond Fund                         | Nordea 1 - Global Stable Equity Fund                                |
| Nordea 1 - Emerging Stars Equity Fund                       | Nordea 1 - Global Stable Equity Fund - Euro Hedged                  |
| Nordea 1 - Emerging Stars Local Bond Fund                   | Nordea 1 - Global Stars Equity Fund                                 |
| Nordea 1 - Emerging Wealth Equity Fund                      | Nordea 1 - Long Duration US Bond Fund                               |
| Nordea 1 - European Corporate Bond Fund                     | Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund                  |
| Nordea 1 - European Corporate Bond Fund Plus (Anmerkung 1b) | Nordea 1 - Low Duration US High Yield Bond Fund                     |
| Nordea 1 - European Corporate Stars Bond Fund               | Nordea 1 - Nordic Equity Fund                                       |
| Nordea 1 - European Covered Bond Fund                       | Nordea 1 - Nordic Equity Small Cap Fund                             |
| Nordea 1 - European Covered Bond Opportunities Fund         | Nordea 1 - Nordic Ideas Equity Fund                                 |
| Nordea 1 - European Cross Credit Fund                       | Nordea 1 - Nordic Stars Equity Fund                                 |
| Nordea 1 - European Financial Debt Fund                     | Nordea 1 - North American High Yield Stars Bond Fund (Anmerkung 1a) |
| Nordea 1 - European High Yield Bond Fund                    | Nordea 1 - North American Stars Equity Fund                         |
| Nordea 1 - European High Yield Credit Fund                  | Nordea 1 - Norwegian Bond Fund                                      |
| Nordea 1 - European High Yield Stars Bond Fund              | Nordea 1 - Norwegian Equity Fund                                    |
| Nordea 1 - European Inflation Linked Bond Fund              | Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund                           |
| Nordea 1 - European Small and Mid Cap Equity Fund           | Nordea 1 - Stable Emerging Markets Equity Fund                      |
| Nordea 1 - European Stars Equity Fund                       | Nordea 1 - Stable Return Fund                                       |
| Nordea 1 - Flexible Credit Fund (Anmerkung 1b)              | Nordea 1 - Swedish Bond Fund  |
| Nordea 1 - GBP Diversified Return Fund                      | Nordea 1 - Swedish Short-Term Bond Fund                             |
| Nordea 1 - Global Bond Fund                                 | Nordea 1 - US Corporate Stars Bond Fund (Anmerkung 1a)              |
| Nordea 1 - Global Disruption Fund                           | Nordea 1 - US Total Return Bond Fund                                |

Die vorgenannten Teilfonds bewerben ökologische und/oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung (SFDR).

Diese Merkmale wurden im Referenzzeitraum vom 10. März 2021 bis 31. Dezember 2021 in folgendem Umfang erfüllt:

- **Normenbasiertes Screening:** Die Anlagen der Teilfonds entsprachen den im Prospekt beschriebenen ausgewählten Normen, mit Ausnahme von Anlagen in Barmitteln und derivativen Finanzinstrumenten, bei denen das Screening nicht angewandt wird.
- **Ausschlüsse:** Die Teilfonds investierten nicht direkt in Unternehmen, die auf der Ausschlussliste 2021 stehen. Die aktuelle Ausschlussliste kann unter [www.nordea.com/en/sustainability/exclusion](http://www.nordea.com/en/sustainability/exclusion) eingesehen werden.
- **Paris-konforme Strategie bezüglich fossiler Energieträger** (außer Nordea 1 - Norwegian Equity Fund): Die Teilfonds investierten nicht in Unternehmen, die an der Gewinnung und Bereitstellung fossiler Energieträger oder der Erbringung diesbezüglicher Dienstleistungen beteiligt sind, wenn festgestellt wurde, dass sie keine anerkannte Strategie zur Erreichung eines Emissionspfads vorweisen können, der mit den Zielen des Pariser Übereinkommens vereinbar ist [www.nordea.com/en/doc/nam-fossil-fuel-policy-october-2021.pdf](http://www.nordea.com/en/doc/nam-fossil-fuel-policy-october-2021.pdf)
- **Paris-konforme Strategie bezüglich fossiler Energieträger** (nur Nordea 1 - Norwegian Equity Fund): Der Teilfonds investierte nicht in Unternehmen, die an der Gewinnung und Bereitstellung fossiler Energieträger oder der Erbringung diesbezüglicher Dienstleistungen beteiligt sind, wenn festgestellt wurde, dass sie keine anerkannte Strategie zur Erreichung eines Emissionspfads vorweisen können, der mit den Zielen des Pariser Übereinkommens vereinbar ist. Ausnahmen bildeten Engagements bei Aker ASA, Aker BP ASA, DNO ASA und Equinor ASA.
- **Erweiterte Ausschlussfilter und andere Beschränkungen:** Die Teilfonds investierten nicht in Unternehmen aus der Tabakbranche. Die Teilfonds Nordea 1 - Norwegian Bond Fund, Nordea 1 - Norwegian Equity Fund und Nordea 1 - Norwegian Short-Term Bond Fund investierten nicht in Unternehmen, die aus dem *Anlageuniversum des staatlichen Pensionsfonds Norwegens Norwegian Government Pension Fund Global ausgeschlossen sind*, (sogenannte „NBIM-Liste“).

# Angaben gemäß der Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft) (Fortsetzung)

- Aktive Ausübung von Aktionärsrechten und Mitwirkung: Nähere Angaben sind im Nordea-Jahresbericht zu verantwortungsbewusstem Investieren (Responsible Investment, RI) unter [www.nordea.com/en/sustainability/reports](http://www.nordea.com/en/sustainability/reports) und im Nordea-Abstimmungsportal [www.nordea.com/en/sustainability/voting](http://www.nordea.com/en/sustainability/voting) zu finden.
- Ergänzung für die unter Artikel 8 fallende Stars-Strategie: Die Teilfonds investierten nicht in Unternehmen, deren interne ESG-Bewertung unter B minus lag.

## Rechtlicher Hinweis für unter Artikel 8 fallende Produkte:

Die Teilfonds verpflichteten sich nicht, in nachhaltige Anlagen gemäß der Definition der EU-Taxonomie-Verordnung zu investieren. Daher sind die in Artikel 6 der EU-Taxonomie-Verordnung vorgeschriebenen Angaben nicht erforderlich.

## Unter Artikel 6 fallende Teilfonds

### Rechtlicher Hinweis für unter Artikel 6 fallende Produkte:

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Anlagen berücksichtigen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht.

| Name des Teilfonds  |  |
|---|--|
| Nordea 1 - Alpha 10 MA Fund                               | Nordea 1 - Global Equity Market Neutral Fund                   |
| Nordea 1 - Alpha 15 MA Fund                               | Nordea 1 - Global High Yield Bond Fund                         |
| Nordea 1 - Alpha 7 MA Fund                                | Nordea 1 - Indian Equity Fund                                  |
| Nordea 1 - Balanced Income Fund                           | Nordea 1 - International High Yield Bond Fund - USD Hedged     |
| Nordea 1 - Chinese Bond Fund (Anmerkung 1c)               | Nordea 1 - Latin American Corporate Bond Fund (Anmerkung 1b)   |
| Nordea 1 - Conservative Fixed Income Fund                 | Nordea 1 - Latin American Equity Fund                          |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Fund                      | Nordea 1 - North American High Yield Bond Fund                 |
| Nordea 1 - Emerging Market Bond Opportunities Fund        | Nordea 1 - North American Small Cap Fund                       |
| Nordea 1 - Emerging Market Corporate Bond Fund            | Nordea 1 - North American Value Fund                           |
| Nordea 1 - Emerging Markets Small Cap Fund (Anmerkung 1b) | Nordea 1 - Unconstrained Bond Fund - USD Hedged (Anmerkung 1b) |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund                     | Nordea 1 - US Corporate Bond Fund                              |
| Nordea 1 - Flexible Fixed Income Plus Fund (Anmerkung 1a) | Nordea 1 - US High Yield Bond Fund                             |

## Unter Artikel 9 fallende Teilfonds

| Name des Teilfonds  |
|---|
| Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund                  |
| Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund (Anmerkung 1a) |
| Nordea 1 - Global Gender Diversity Fund                         |
| Nordea 1 - Global Green Bond Fund (Anmerkung 1a)                |
| Nordea 1 - Global Social Empowerment Fund (Anmerkung 1c)        |

- Normenbasiertes Screening: Die Anlagen der Teilfonds entsprachen den im Prospekt beschriebenen ausgewählten Normen, mit Ausnahme von Anlagen in Barmitteln und derivativen Finanzinstrumenten, bei denen das Screening nicht angewandt wird.
- Ausschlüsse: Die Teilfonds investierten nicht direkt in Unternehmen, die auf der Ausschlussliste 2021 stehen. Die aktuelle Ausschlussliste kann unter [www.nordea.com/en/sustainability/exclusion](http://www.nordea.com/en/sustainability/exclusion) eingesehen werden.
- Paris-konforme Strategie bezüglich fossiler Energieträger: Die Teilfonds investierten nicht in Unternehmen, die an der Gewinnung und Bereitstellung fossiler Energieträger oder der Erbringung diesbezüglicher Dienstleistungen beteiligt sind, wenn festgestellt wurde, dass sie keine anerkannte Strategie zur Erreichung eines Emissionspfads vorweisen können, der mit den Zielen des Pariser Übereinkommens vereinbar ist [www.nordea.com/en/doc/nam-fossil-fuel-policy-october-2021.pdf](http://www.nordea.com/en/doc/nam-fossil-fuel-policy-october-2021.pdf)
- Erweiterte Ausschlussfilter und andere Beschränkungen: Die Teilfonds investierten nicht in Unternehmen aus der Tabakbranche.
- Aktive Ausübung von Aktionärsrechten und Mitwirkung: Nähere Angaben sind im Nordea-Jahresbericht zu verantwortungsbewusstem Investieren (Responsible Investment, RI) unter [www.nordea.com/en/sustainability/reports](http://www.nordea.com/en/sustainability/reports) und im Nordea-Abstimmungsportal [www.nordea.com/en/sustainability/voting](http://www.nordea.com/en/sustainability/voting) zu finden.

# Angaben gemäß der Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft) (Fortsetzung)

**Der Nordea 1 - Global Climate and Environment Fund** verfolgt das Nachhaltigkeitsziel, positiven Einfluss auf die Umwelt zu nehmen. Dazu investiert er vornehmlich in Unternehmen, die maßgeblich an Wirtschaftstätigkeiten beteiligt sind, die gemäß der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Der Fonds investiert in Unternehmen eines unternehmensinternen Anlageuniversums, das aus Anbietern ökologischer Lösungen besteht. Es wird ermittelt und bewertet, ob und inwieweit die Aktivitäten der Unternehmen auf die Ziele der EU-Taxonomie ausgerichtet sind. Der Fonds verwendet einen Referenzwert, der nicht auf das Nachhaltigkeitsziel des Fonds abgestimmt ist. Stattdessen kommt ein unternehmensinterner EU-Taxonomie-Rahmen zum Einsatz, um den Stand und die Entwicklung des Beitrags der Unternehmen zu den Zielen der EU-Taxonomie zu überwachen.

[https://www.nordea.lu/en/professional/documents/esg---report/ESG-R\\_GCLIMEF\\_eng\\_INT.pdf/](https://www.nordea.lu/en/professional/documents/esg---report/ESG-R_GCLIMEF_eng_INT.pdf/)

**Der Nordea 1 - Global Climate and Social Impact Fund (Anmerkung 1a)** verfolgt das Nachhaltigkeitsziel, positiven Einfluss auf Umwelt und Gesellschaft zu nehmen. Dazu investiert er vornehmlich in Unternehmen, die in maßgeblich an Wirtschaftstätigkeiten beteiligt sind, die gemäß der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten oder zu ausgewählten sozialen SDGs beitragen. Bei den vier Zielen der EU-Taxonomie, für die derzeit noch keine technischen Kriterien bereitstehen, werden ökologisch orientierte SDGs als Leitlinien verwendet. Der Fonds investiert in Unternehmen eines unternehmensinternen Anlageuniversums, das aus Anbietern ökologischer und/oder sozialer Lösungen besteht. Umweltaspekte: Es wird ermittelt und bewertet, ob und inwieweit die Aktivitäten der Unternehmen auf die Ziele der EU-Taxonomie ausgerichtet sind. Soziale Aspekte: Die Unternehmen des Anlageuniversums weisen über unternehmensspezifische Kennzahlen einen Bezug zu den zugrunde liegenden Indikatoren der jeweiligen SDG-Zielwerte auf. Der Fonds verwendet einen Referenzwert, der nicht auf das Nachhaltigkeitsziel des Fonds abgestimmt ist. Stattdessen kommt ein unternehmensinterner Rahmen zum Einsatz, um den Stand und die Entwicklung des Beitrags der Unternehmen zu den Zielen der EU-Taxonomie oder den zugrunde liegenden Indikatoren der jeweiligen SDG-Zielwerte zu überwachen.

[https://www.nordea.lu/en/professional/documents/esg---report/ESG-R\\_GCSIF\\_eng\\_INT.pdf/](https://www.nordea.lu/en/professional/documents/esg---report/ESG-R_GCSIF_eng_INT.pdf/)

**Der Nordea 1 - Global Gender Diversity Fund** verfolgt das Nachhaltigkeitsziel, positiven Einfluss auf die Gesellschaft zu nehmen. Dazu investiert er in Unternehmen, die zu ausgewählten SDGs beitragen, welche die Vielfalt und Gleichstellung der Geschlechter betreffen. Der Fonds investiert in Unternehmen eines unternehmensinternen Anlageuniversums, das aus Unternehmen besteht, die ein hohes Maß an Geschlechtervielfalt und Geschlechtergleichstellung oder einen positiven Trend bei der Verbesserung und Förderung der Geschlechtervielfalt und Geschlechtergleichstellung aufweisen. Die Unternehmen des Anlageuniversums weisen über unternehmensspezifische Kennzahlen einen Bezug zu den zugrunde liegenden Indikatoren der jeweiligen SDG-Zielwerte auf. Anhand dieser Kennzahlen wird gemessen, inwieweit das Nachhaltigkeitsziel erreicht wurde. Der Fonds verwendet einen Referenzwert, der nicht auf das Nachhaltigkeitsziel des Fonds abgestimmt ist. Stattdessen kommt ein unternehmensinterner SDG-Rahmen zum Einsatz, um den Stand und die Entwicklung des Beitrags der Unternehmen zu den zugrunde liegenden Indikatoren der jeweiligen SDG-Zielwerte zu überwachen.

[https://www.nordea.lu/en/professional/documents/esg---report/ESG-R\\_GGDF\\_eng\\_INT.pdf/](https://www.nordea.lu/en/professional/documents/esg---report/ESG-R_GGDF_eng_INT.pdf/)

**Der Nordea 1 - Global Green Bond Fund (Anmerkung 1a)** verfolgt das Nachhaltigkeitsziel, positiven Einfluss auf die Umwelt zu nehmen. Dazu investiert er mindestens 70% seines Vermögens in grüne Anleihen. Der verbleibende Anteil des Fondsvermögens wird in andere Anleihen investiert, die als nachhaltig gelten, unter anderem in konventionelle Anleihen von Emittenten, deren Wirtschaftstätigkeiten für Anlagezwecke als ökologisch nachhaltig eingestuft werden. Der Fonds investiert in grüne und andere nachhaltige Anleihen. Inwieweit eine Ausrichtung auf diese Ziele besteht, wird entweder auf Ebene der Erlösverwendung oder auf Ebene des Emittenten ermittelt und bewertet, je nachdem, wie dies für die einzelnen Anleihearten des Portfolios angemessen ist und soweit die entsprechenden Daten verfügbar sind. Der Fonds zieht einen breit gefassten Referenzwert für grüne Anleihen heran, der auf das Nachhaltigkeitsprofil des Fonds abgestimmt ist. Allerdings erfüllen nicht alle im Referenzwert vertretenen Anleihen die Nachhaltigkeitsanforderungen des Fonds. Der Fonds kann auch Anlagen bei nicht im Referenzwert enthaltenen Werten tätigen, solange seine Nachhaltigkeitsanforderungen erfüllt sind.

**Der Nordea 1 - Global Social Empowerment Fund (Anmerkung 1c)** verfolgt das Nachhaltigkeitsziel, positiven Einfluss auf die Gesellschaft zu nehmen. Dazu investiert er in Unternehmen, die zu ausgewählten sozialen UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) beitragen. Der Fonds investiert in Unternehmen eines unternehmensinternen Anlageuniversums, das aus Anbietern sozialer Lösungen besteht. Die Unternehmen des Anlageuniversums weisen über unternehmensspezifische Kennzahlen einen Bezug zu den zugrunde liegenden Indikatoren der jeweiligen SDG-Zielwerte auf. Anhand dieser Kennzahlen wird gemessen, inwieweit das Nachhaltigkeitsziel erreicht wurde. Der Fonds verwendet einen Referenzwert, der nicht auf das Nachhaltigkeitsziel des Fonds abgestimmt ist. Stattdessen kommt ein unternehmensinterner SDG-Rahmen zum Einsatz, um den Stand und die Entwicklung des Beitrags der Unternehmen zu den zugrunde liegenden Indikatoren der jeweiligen SDG-Zielwerte zu überwachen.

[https://www.nordea.lu/en/professional/documents/esg---report/ESG-R\\_GSEMF\\_eng\\_INT.pdf/](https://www.nordea.lu/en/professional/documents/esg---report/ESG-R_GSEMF_eng_INT.pdf/)



# Organisation

## Eingetragener Geschäftssitz

Nordea 1, SICAV  
562, rue de Neudorf  
L-2220 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

## Verwaltungsrat der Gesellschaft

|  |  |
|--|--|
| Brian Stougård Jensen<br>Kopenhagen<br>Dänemark              | Leiter Product Office und Mitglied der Senior Executive Management Group von Nordea Asset Management (SEM).  |
| Christophe Girondel<br>Luxemburg<br>Großherzogtum Luxemburg  | Globaler Leiter Institutional and Wholesale Distribution von Nordea Asset Management und Mitglied der Senior Executive Management Group von Nordea Asset Management (SEM).   |
| Claude Kremer<br>Luxemburg<br>Großherzogtum Luxemburg        | Gründungspartner der Anwaltskanzlei Arendt & Medernach und Leiter der Abteilung Investment Management der Kanzlei in Luxemburg.  |
| Lars Eskesen<br>Kopenhagen<br>Dänemark                       | Nach 28 Jahren in der Finanzbranche im Ruhestand. Er war nacheinander Mitglied des Geschäftsführungsgremiums der Sparekassen SDS, CEO der Sparekassen SDS und stellvertretender CEO von Unibank A/S. Er war sieben Jahre lang Board-Mitglied des Europäischen Bankenverbands. Heute ist Lars Eskesen Vorsitzender des Verwaltungsrats von Nordea Invest. |
| Sheenagh Gordon-Hart<br>Luxemburg<br>Großherzogtum Luxemburg | Sheenagh Gordon-Hart ist Partner der „The Directors’ Office S.A.“, eines Luxemburger Zusammenschlusses unabhängiger Verwaltungsratsmitglieder.   |

## Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

|   |  |
|---|--|
| Ana Guzman Quintana<br>Madrid<br>Spanien<br>(seit 15. Mai 2021) | CIO und Leiterin Impact Investments der Portocolom Agencia de Valores  |
| Brian Stougård Jensen<br>Kopenhagen<br>Dänemark                 | Leiter Product Office und Mitglied der Senior Executive Management Group von Nordea Asset Management (SEM).  |
| Graham Goodhew<br>Luxemburg<br>Großherzogtum Luxemburg          | Verabschiedete sich nach langjähriger Tätigkeit in der Finanzbranche, im Rahmen derer er unter anderem Positionen als Mitglied des Verwaltungsrats und Conducting Officer bei JP Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l. sowie als Executive Director bei JPMorgan Chase bekleidete, in den Ruhestand. |
| Nils Bolmstrand<br>Stockholm<br>Schweden                        | Leiter von Nordea Asset Management   |

# Organisation

## Conducting Officers der Verwaltungsgesellschaft

Christophe Wadeleux            Leiter Risk Management  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Markku Kotisalo                    Leiter Fund Administration  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Michael Maldener                 Managing Director  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg  
(bis 8. Juli 2021)

Sinor Chhor                         Managing Director  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg  
(seit 8. Juli 2021)

Sinor Chhor                         Chief Compliance Officer  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg  
(bis 8. Juli 2021)

Antoine Sineau                    Chief Compliance Officer  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg  
(seit 8. Juli 2021)

# Organisation

## Anlageverwalter:

Mit Zustimmung der SICAV und der luxemburgischen Finanzaufsicht (Commission de Surveillance du Secteur Financier, CSSF) hat die Verwaltungsgesellschaft die Portfolioverwaltung an Nordea Investment Management AB (einschließlich Niederlassungen) delegiert. Mit Genehmigung der Verwaltungsgesellschaft hat der Anlageverwalter mehrere Unteranlageverwalter und -anlageberater bestellt, die im Folgenden aufgeführt sind:

## Von der Verwaltungsgesellschaft bestellter Anlageverwalter

### Nordea Investment Management AB (einschließlich Niederlassungen).

Mäster Samuelsgatan 21, M540  
Stockholm 10571, Schweden

## Vom Anlageverwalter bestellte Unteranlageverwalter und Unteranlageberater

### Unteranlageverwalter

|   |  |
|---|--|
| <b>Aegon USA Investment Management, LLC</b>   | 6300 C Street SW, Cedar Rapids<br>Iowa, 52499, USA   |
| <b>BICE Inversiones Administradora<br/>General de Fondos S.A.<br/>(bis 12. März 2021)</b>   | Teatinos 280, 5th Floor<br>Santiago, Región Metropolitana 8340434, Chile                         |
| <b>Capital Four Management<br/>Fondsmæglerselskab A/S</b>                                   | Per Henrik Lings Allé 2, 8th Floor<br>DK-2100 Kopenhagen, Dänemark                               |
| <b>CBRE Clarion Securities LLC</b>  | 201 King of Prussia Road, Suite 600<br>Radnor, Pennsylvania, 19087, USA                          |
| <b>DoubleLine Capital LP</b>  | 333 South Grand Ave., 18th Floor<br>Los Angeles, CA 90071, USA                                   |
| <b>Duff &amp; Phelps Investment Management</b>  | 200 South Wacker Drive, Suite 500,<br>Chicago, Illinois 60606, USA                               |
| <b>GW&amp;K Investment Management LLC</b>   | 222 Berkeley Street, 15th Floor,<br>Boston, MA 02116, USA  |
| <b>Itaú USA Asset Management Inc.</b>   | 767 Fifth Avenue, 50th floor,<br>New York, New York, 10153, USA                                  |
| <b>Loomis, Sayles &amp; Company, LP</b>   | c/o Corporation Service Company<br>2711 Centerville Road, Suite 400<br>Wilmington, DE 19808, USA |
| <b>MacKay Shields LLC</b>   | 1345 Avenue of the Americas<br>New York, NY 10105, USA   |
| <b>Manulife Investment Management<br/>(Hong Kong) Limited</b>                               | 16th Floor, Lee Garden One,<br>33 Hysan Avenue, Causeway bay,<br>Hongkong                        |
| <b>Manulife Investment Management<br/>(Singapore) Pte. Ltd<br/>(seit 14. Dezember 2021)</b> | 8 Cross Street, No.16-01,<br>Manulife Tower,<br>Singapur 048424                                  |
| <b>Metlife Investment Management, LLC</b>   | 1717 Arch Street, Suite 1500<br>Philadelphia, PA 19103, USA                                      |
| <b>PGIM Inc (bis 14. Dezember 2021)</b>   | 685 Broad Street, Newark,<br>New Jersey 07102, USA   |
| <b>River Road Asset Management LLC</b>  | 462 S. Fourth Street, Suite 2000,<br>Louisville, Kentucky 40202, USA                             |

### Unteranlageberater

|  |   |
|--|---|
| <b>ICICI Prudential Asset Management<br/>Company Ltd<br/>(bis 14. Dezember 2021)</b> | 12th Floor, Narain Manzil,<br>Barakhambha Road,<br>New Delhi 110 001, India |
|--|---|

# Verwaltung

## Verwaltungsgesellschaft

Nordea Investment Funds S.A.  
562, rue de Neudorf  
L-2220 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg  
Telefon: +352 27 86 51 00  
Fax: +352 27 86 50 11  
Homepage: [nordea.lu](http://nordea.lu)  
E-Mail: [nordeafunds@nordea.com](mailto:nordeafunds@nordea.com)

## Verwahrstelle

J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A.  
6, route de Trèves  
L-2633 Senningerberg  
Großherzogtum Luxemburg

## Verwaltungsstelle

Nordea Investment Funds S.A.  
562, rue de Neudorf  
L-2220 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg  
Telefon: +352 27 86 51 00  
Fax: +352 27 86 50 11  
Homepage: [nordea.lu](http://nordea.lu)  
E-Mail: [nordeafunds@nordea.com](mailto:nordeafunds@nordea.com)

# Berechtigung zum öffentlichen Vertrieb

Nordea 1, SICAV ist in den nachstehenden Ländern ganz oder zum Teil zum öffentlichen Vertrieb berechtigt:

|             |                         |             |
|-------------|-------------------------|-------------|
| Österreich  | Großherzogtum Luxemburg | Spanien     |
| Belgien     | Irland                  | Schweden    |
| Dänemark    | Italien                 | Schweiz     |
| Estland     | Lettland                | Niederlande |
| Finnland    | Litauen                 |             |
| Frankreich  | Norwegen                |             |
| Deutschland | Polen                   |             |

Weitere Einzelheiten über die Berechtigung zum öffentlichen Vertrieb sowie die vollständige Länderliste sind bei der Verwaltungsgesellschaft an der oben angegebenen Adresse erhältlich.

# Vertreter, Zahl- und Informationsstellen außerhalb Luxemburgs

## Österreich Informations- und Zahlstelle

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG  
Am Belvedere 1  
AT-1100 Wien,  
Österreich  
Tel: +43 50100 12139  
Fax: +43 50100 9 12139

## Belgien Finanzdienstleistungsstelle

BNP Paribas Securities Services S.C.A.  
Brussels Branch  
Rue de Loixum, 25  
BE-1000 Brüssel  
Belgien

## Dänemark Vertreter

Nordea Danmark  
Grønjobsvej 10  
Postbox 850  
DK-0900 Kopenhagen C, Dänemark  
Tel: +45 5547 0000

## Estland Vertreter

Luminor Bank AS  
Liivalaia 45  
EE-10145 Tallinn,  
Estland  
Tel: +372 6283 300  
Fax: +372 6283 201

## Frankreich Zentrale Korrespondenzbank

CACEIS Bank  
1-3, place Valhubert  
FR-75206 Paris Cedex 13,  
Frankreich  
Tel: +33 1 41 89 70 00  
Fax: +33 1 41 89 70 05

## Deutschland Informationsstelle

Société Générale S.A. Frankfurt Branch  
Neue Mainzer Straße 46-50  
DE-60311 Frankfurt am Main  
Deutschland

## Irland Facilities Agent

Maples Fund Services (Ireland) Limited  
32 Molesworth Street  
D02 Y512 Dublin 2,  
Irland

## Italien Zahlstelle

State Street Bank International GmbH -  
Succursale Italia  
Via Ferrante Aporti 10  
IT-20125 Mailand,  
Italien  
Tel: +39 02 3211-7001/ 7002  
Fax: +39 02 8796 9964

## Italien Zahlstelle

Allfunds Bank S.A.U. -  
Succursale di Milano  
Via Bocchetto 6  
IT-20123 Mailand,  
Italien  
Tel: +39 02 89 628 301  
Fax: +39 02 89 628 240

## Italien Zahlstelle

Société Générale Securities Services S.p.A.  
Via Benigno Crespi, 19/A -MAC2,  
IT-20159 Mailand,  
Italien  
Tel: +39 02 9178 4661  
Fax: +39 02 9178 3059

## Italien Zahlstelle

Banca Sella Holding S.p.A.  
Piazza Gaudenzio Sella 1  
IT-13900 Biella,  
Italien  
Tel: 39 015 3501 997  
Fax: +39 2433 964

## Italien Zahlstelle

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.  
Piazza Salimbeni 3,  
IT-53100 Siena,  
Italien  
Tel: +39 0577 294111

## Italien Zahlstelle

Caceis Bank S.A., Italian Branch  
Piazza Cavour 2  
IT-20121 Mailand,  
Italien  
Tel: +39 02721 74401  
Fax: +39 02721 74454

Vorbehaltlich des italienischen Rechts und der dortigen Usancen kann eine Zahlstelle in Italien Fondsanteile über einen Sparplan vertreiben. In Italien ansässige Privatanleger können eine Zahlstelle in diesem Land anweisen, Handelsanträge direkt bei der SICAV in ihrem Namen einzureichen (zusammengefasst nach Fonds oder Vertriebsstelle), die Anteile in ihrem oder im Namen eines nominellen Anteilnehmers zu registrieren und alle mit der Ausübung der Rechte der Anteilnehmer verbundenen Dienstleistungen zu erbringen. Nähere Angaben enthält der italienische Zeichnungsantrag.

# Vertreter, Zahl- und Informationsstellen außerhalb Luxemburgs

## **Lettland Vertreter**

Luminor Bank AS  
62 Skanstes iela 12  
LV-1013 Riga,  
Lettland  
Tel: +371 67 096 096  
Fax: +371 67 005 622

## **Polen Zahlstelle**

Bank Handlowy w Warszawie S.A.  
ul. Senatorska 16  
00-923 Warschau,  
Polen  
Tel: +48 22 657 72 00  
Fax: +48 22 692 50 23

## **Schweden Zahlstelle**

Nordea Bank Abp, Swedish Branch  
Smålandsgatan 17  
SE-105 71 Stockholm,  
Schweden  
Tel: +46 8 61 47000  
Fax: +46 8 20 08 46

## **Litauen Vertreter**

Luminor Bank AB  
Konstitucijos pr. 21 A  
LT-03601 Wilna,  
Litauen  
Tel: +370 5 2 361 361  
Fax: +370 5 2 361 362

## **Polen Vertreter**

ProService Finteco Sp. z o.o.  
ul. Puławska 436  
02-801 Warschau,  
Polen  
Tel: +48 22 58 81 900  
Fax: +48 22 58 81 950

## **Schweiz Vertreter und Zahlstelle**

BNP Paribas Securities Services, Paris,  
Succursale de Zurich  
Selnaustrasse 16  
CH-8002 Zürich,  
Schweiz  
Tel: +41 58 212 61 11  
Fax: +41 58 212 63 30

## **Spanien Vertreter**

Allfunds Bank S.A.U.  
C/ de los Padres Dominicos, 7  
ES-28050 Madrid,  
Spanien  
Tel: +34 91 270 95 00  
Fax: +34 91 308 65 67

## **Portugal Zahlstelle Zahlstelle**

BEST - Banco Electrónico de Serviço  
Total, S.A.  
Pç. Marquês de Pombal 3, 3º  
1250 – 161, Lissabon,  
Portugal  
Tel: +351 218 839 252

## **Vereinigtes Königreich Facilities Agent**

FE Fundinfo (UK) Limited  
3rd Floor,  
Hollywood House,  
Church Street East,  
Woking  
GU21 6HJ, Vereinigtes Königreich  
Tel: +44 207 534 7505

# Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
2, rue Gerhard Mercator  
L-2182 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Nordea 1, SICAV  
562, rue de Neudorf  
L-2220 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Tel. +352 27 86 51 00  
Fax +352 27 86 50 11  
nordeafunds@nordea.com  
nordea.lu

HR Luxemburg B-31442



