



PIMCO

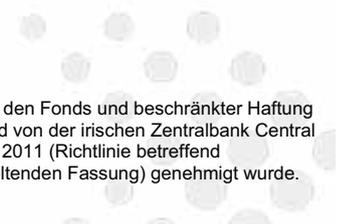
PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

# Halbjahresbericht

30. Juni 2024



Eine offene Anlagegesellschaft mit variablem Kapital, gesonderter Haftung zwischen den Fonds und beschränkter Haftung gemäß dem Companies Act 2014, die unter der Register-Nr. 276928 eingetragen und von der irischen Zentralbank Central Bank of Ireland nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Richtlinie betreffend Organismen für die gemeinsame Anlage in Wertpapiere [„OGAW“]) (in der jeweils geltenden Fassung) genehmigt wurde.



ALLGEMEINE KENNDATEN

**Fondstyp:**

OGAW

**Anzahl an Fonds der Gesellschaft:**

57 Fonds

**Zum 30. Juni 2024 angebotene Anteilsklassen der Gesellschaft:\***

Institutional  
 Institutional AUD (Hedged)  
 Institutional BRL (Hedged)  
 Institutional CAD (Hedged)  
 Institutional CHF (Hedged)  
 Institutional CHF (Partially Hedged)  
 Institutional CZK (Hedged)  
 Institutional EUR (Currency Exposure)  
 Institutional EUR (Hedged)  
 Institutional EUR (Partially Hedged)  
 Institutional EUR (Unhedged)  
 Institutional GBP (Currency Exposure)  
 Institutional GBP (Hedged)  
 Institutional GBP (Partially Hedged)  
 Institutional GBP (Unhedged)  
 Institutional HKD (Unhedged)  
 Institutional ILS (Hedged)  
 Institutional JPY (Hedged)  
 Institutional MXN (Hedged)  
 Institutional NOK (Hedged)  
 Institutional NOK (Partially Hedged)  
 Institutional NZD (Hedged)  
 Institutional RMB (Hedged)  
 Institutional RMB (Unhedged)  
 Institutional SEK (Hedged)  
 Institutional SGD (Hedged)  
 Institutional USD (Currency Exposure)  
 Institutional USD (Hedged)  
 Investor  
 Investor AUD (Hedged)  
 Investor CAD (Hedged)  
 Investor CHF (Hedged)  
 Investor EUR (Hedged)  
 Investor EUR (Unhedged)  
 Investor GBP (Hedged)  
 Investor HKD (Unhedged)  
 Investor JPY (Hedged)  
 Investor NOK (Hedged)  
 Investor RMB (Hedged)  
 Investor SEK (Hedged)  
 Investor SGD (Hedged)  
 Investor USD (Unhedged)  
 Administrative  
 Administrative AUD (Hedged)  
 Administrative CHF (Hedged)  
 Administrative EUR (Hedged)  
 Administrative GBP (Hedged)  
 Administrative HKD (Unhedged)  
 Administrative JPY (Hedged)  
 Administrative SEK (Hedged)  
 Administrative SGD (Hedged)  
 BE Retail  
 BM Retail  
 BM Retail AUD (Hedged)  
 BM Retail Decumulation  
 BM Retail USD (Hedged)  
 E Class  
 E Class AUD (Hedged)  
 E Class AUD (Partially Hedged)  
 E Class CHF (Hedged)  
 E Class EUR (Currency Exposure)

E Class EUR (Hedged)  
 E Class EUR (Partially Hedged)  
 E Class EUR (Unhedged)  
 E Class GBP (Hedged)  
 E Class GBP (Partially Hedged)  
 E Class HKD (Unhedged)  
 E Class JPY (Hedged)  
 E Class RMB (Hedged)  
 E Class SGD (Hedged)  
 E Class SGD (Partially Hedged)  
 E Class USD (Currency Exposure)  
 E Class USD (Hedged)  
 G Retail EUR (Hedged)  
 H Institutional  
 H Institutional USD (Currency Exposure)  
 H Institutional USD (Hedged)  
 M Retail  
 M Retail AUD (Hedged)  
 M Retail Decumulation  
 M Retail GBP (Hedged)  
 M Retail HKD (Unhedged)  
 M Retail SGD (Hedged)  
 M Retail USD (Hedged)  
 N Retail  
 R Class  
 R Class AUD (Hedged)  
 R Class EUR (Hedged)  
 R Class GBP (Hedged)  
 T Class  
 T Class EUR (Hedged)  
 T Class USD (Hedged)  
 UM Retail  
 UM Retail SGD (Hedged)  
 W Class  
 W Class CHF (Hedged)  
 W Class EUR (Hedged)  
 W Class GBP (Hedged)  
 W Class NOK (Hedged)  
 W Class SGD (Hedged)  
 Z Class  
 Z Class AUD (Hedged)

**Anteilsarten:**

Innerhalb jeder Klasse darf die Gesellschaft, vorbehaltlich der jeweiligen Ergänzung, ausschüttende Anteile (Gewinne ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Gewinne thesaurierende Anteile), ausschüttende II-Anteile (Anteile, die eine höhere Rendite erzielen sollen) und Decumulation-Anteile (Anteile, die eine über die Erträge hinausgehende Ausschüttung anstreben) ausgeben.

**Nettovermögen (Angaben in Tausend):**

USD 176.405.639

**Mindestbestand:**

Die Mindestbeteiligung für die Anteilsklassen Institutional, Investor, Administrative, H Institutional und W Class liegt bei 500.000 USD oder dem Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse. Die Mindestbeteiligung für die Anteilsklassen BE Retail Class, BM Retail Class, BN Retail Class, E Class, G Retail, M Retail, N Retail, R Class und T Class liegt bei 1.000 USD oder bei Bedarf beim Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse. Der Mindestbestand für die Anteilsklassen Z liegt bei 20 Mio. USD oder dem Gegenwert in der jeweiligen Anteilsklassenwährung. Die Pacific Investment Management Company LLC („PIMCO“) ist nach eigenem Ermessen befugt, auf das Erfordernis der Mindestanfangszeichnung und des Mindestbestandes gemäß dem aktuellen Verkaufsprospekt zu verzichten.

### ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

#### **Handelstag:**

Für einen Fonds bezeichnet er den Tag oder die Tage, die die jeweilige Ergänzung zu diesem Fonds vorgibt, wobei es alle vierzehn Tage mindestens einen Handelstag geben muss. Der Verwaltungsrat hat PIMCO die Befugnis erteilt, die Häufigkeit der Handelstage je Fonds zu ändern. Jegliche Änderung an der Häufigkeit der Handelstage erfordert die vorherige Zustimmung der Verwahrstelle. Dies wird den Anteilhabern des/der betroffenen Fonds im Voraus mitgeteilt.

Ungeachtet der vorangehenden Ausführungen ist ein Tag für einen Fonds kein Handelstag, wenn es entweder aufgrund von Feiertagen oder einer Markt- bzw. Börsenschließung in jeglichem Rechtsgebiet schwierig ist, (i) einen Fonds zu verwalten oder (ii) einen Teil des Fondsvermögens zu bewerten. Anteilhaber und potenzielle Anleger können weitere Einzelheiten über geplante Schließungen von Fonds während des Jahres beim Administrator erfragen oder sie im Feiertagskalender der Fonds finden (eine Kopie desselben kann beim Administrator angefordert werden).

#### **Funktionswährung der Fonds:**

USD (\$), mit Ausnahme der Fonds UK Corporate Bond Fund und UK Long Term Corporate Bond Fund, die auf Pfund Sterling (£) lauten, sowie der Fonds Dynamic Multi-Asset Fund, Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro, Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, Euro Short-Term Fund, PIMCO European High Yield Bond Fund und PIMCO European Short-Term Opportunities Fund, die auf Euro (€) lauten.

## ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

### Zulassung in Hongkong:

Die Gesellschaft und bestimmte ihrer Fonds sind von der Securities and Futures Commission in Hongkong („SFC“) zugelassen und unterliegen den Anforderungen des von der SFC herausgegebenen Code on Unit Trusts and Mutual Funds („Code“). Derzeit können die folgenden Fonds Finanzderivate zu Anlagezwecken, zur Absicherung und/oder zur effizienten Portfolioverwaltung erwerben. Der Einsatz von Finanzderivaten erfolgt vorbehaltlich der voraussichtlichen Höchstgrenzen im überarbeiteten Code, wie nachstehend aufgeführt. Die Einstufung der Fonds entweder als Derivatfonds oder als Nicht-Derivatfonds ist ebenfalls nachstehend angegeben. Es gibt keine Änderungen zum Einsatz von Finanzderivaten durch die folgenden Fonds:

Fonds	Erwartetes maximales Nettoengagement in Derivaten (% des Nettoinventarwerts)	Einstufung des Fonds
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	bis zu 50 %	Nicht-Derivatfonds
Asia Strategic Interest Bond Fund	bis zu 50 %	Nicht-Derivatfonds
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	bis zu 50 %	Nicht-Derivatfonds
Commodity Real Return Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Diversified Income Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Emerging Local Bond Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Emerging Markets Bond Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Global Bond Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Global High Yield Bond Fund	bis zu 50 %	Nicht-Derivatfonds
Global Investment Grade Credit Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Global Real Return Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Income Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Income Fund II	bis zu 50 %	Nicht-Derivatfonds
Low Average Duration Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Total Return Bond Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
US High Yield Bond Fund	bis zu 50 %	Nicht-Derivatfonds

Die folgenden Fonds sind in Hongkong nicht zugelassen und für Einwohner von Hongkong nicht erhältlich:

PIMCO Capital Securities Fund  
PIMCO Climate Bond Fund  
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund  
Diversified Income Duration Hedged Fund  
Diversified Income ESG Fund  
Dynamic Bond Fund  
Dynamic Multi-Asset Fund  
Emerging Local Bond ESG Fund  
Emerging Markets Bond ESG Fund  
Emerging Markets Corporate Bond Fund  
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund  
PIMCO ESG Income Fund  
Euro Bond Fund  
Euro Credit Fund  
Euro Income Bond Fund  
Euro Long Average Duration Fund  
Euro Short-Term Fund  
PIMCO European High Yield Bond Fund  
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund  
Global Advantage Fund  
Global Bond ESG Fund  
Global Bond Ex-US Fund  
Global High Yield Bond ESG Fund  
Global Investment Grade Credit ESG Fund  
Global Low Duration Real Return Fund  
Inflation Multi-Asset Fund  
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund  
Low Duration Income Fund  
Low Duration Opportunities Fund  
Low Duration Opportunities ESG Fund  
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund  
Mortgage Opportunities Fund  
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund  
StocksPLUS™ Fund  
Strategic Income Fund  
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

UK Corporate Bond Fund  
UK Long Term Corporate Bond Fund  
US Investment Grade Corporate Bond Fund  
US Short-Term Fund

### Zulassung in Singapur

Diese Fonds werden von der Monetary Authority of Singapore gemäß dem Securities and Futures Act, Kapitel 289 von Singapur, nicht anerkannt und stehen Privatanlegern in Singapur nicht zur Verfügung:

PIMCO Credit Opportunities Bond Fund  
Diversified Income ESG Fund  
Emerging Local Bond ESG Fund  
Emerging Markets Bond ESG Fund  
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund  
Euro Credit Fund  
Euro Income Bond Fund  
Euro Long Average Duration Fund  
Euro Short-Term Fund  
PIMCO European High Yield Bond Fund  
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund  
Global Bond ESG Fund  
Global High Yield Bond ESG Fund  
Global Investment Grade Credit ESG Fund  
Global Low Duration Real Return Fund  
Low Duration Opportunities Fund  
Low Duration Opportunities ESG Fund  
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund  
Mortgage Opportunities Fund  
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund  
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund  
UK Corporate Bond Fund  
UK Long Term Corporate Bond Fund  
US Short-Term Fund

### Reuters-Seite:

PAFPPLC

™ Eingetragenes Warenzeichen oder Warenzeichen der Pacific Investment Management Company LLC in den USA und/oder sonstigen Ländern.

	Seite	
Marktkommentare*		4
Wichtige Angaben zu den Fonds		5
Beschreibungen der Vergleichsindizes		69
Finanzstatus		74
Betriebsergebnisrechnung		94
Ausweis der Nettovermögensänderungen		114
Aufstellung der Wertpapieranlagen		120
Erläuterungen zum Abschluss		815
Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung		876
Begriffsbestimmungen		937
Allgemeine Informationen		939
<b>FONDS</b>	<b>Fonds- überblick*</b>	<b>Aufstellung der Wertpapieranlagen</b>
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	7	120
Asia Strategic Interest Bond Fund	8	130
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	9	140
PIMCO Capital Securities Fund	10	159
PIMCO Climate Bond Fund	12	167
Commodity Real Return Fund	13	175
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	14	185
Diversified Income Fund	15	195
Diversified Income Duration Hedged Fund	17	216
Diversified Income ESG Fund	18	229
Dynamic Bond Fund	19	237
Dynamic Multi-Asset Fund	20	256
Emerging Local Bond Fund	21	269
Emerging Local Bond ESG Fund	22	289
Emerging Markets Bond Fund	23	302
Emerging Markets Bond ESG Fund	24	319
Emerging Markets Corporate Bond Fund	25	334
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	26	344
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	27	361
PIMCO ESG Income Fund	28	375
Euro Bond Fund	29	387
Euro Credit Fund	30	395
Euro Income Bond Fund	31	401
Euro Long Average Duration Fund	32	413
Euro Short-Term Fund	33	419
PIMCO European High Yield Bond Fund	34	424
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	35	431
Global Advantage Fund	36	438
Global Bond Fund	37	455
Global Bond ESG Fund	39	480
Global Bond Ex-US Fund	40	498
Global High Yield Bond Fund	41	515
Global High Yield Bond ESG Fund	42	526
Global Investment Grade Credit Fund	43	529
Global Investment Grade Credit ESG Fund	45	552
Global Low Duration Real Return Fund	46	566
Global Real Return Fund	47	575
Income Fund	48	586
Income Fund II	50	626
Inflation Multi-Asset Fund	51	634
Low Average Duration Fund	52	643
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	53	651

FONDS	Fonds- überblick*	Aufstellung der Wertpapieranlagen
Low Duration Income Fund	54	662
Low Duration Opportunities Fund	55	679
Low Duration Opportunities ESG Fund	56	690
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	57	695
Mortgage Opportunities Fund	58	699
StocksPLUS™ Fund	59	709
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	60	718
Strategic Income Fund	61	724
Total Return Bond Fund	62	742
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	63	758
UK Corporate Bond Fund	64	773
UK Long Term Corporate Bond Fund	65	780
US High Yield Bond Fund	66	786
US Investment Grade Corporate Bond Fund	67	796
US Short-Term Fund	68	808

Dieser Halbjahresbericht kann in andere Sprachen übersetzt werden. Diese Übersetzungen dürfen ausschließlich dieselben Informationen wie der englischsprachige Halbjahresbericht enthalten und müssen dieselbe Bedeutung haben. Soweit zwischen dem englischsprachigen Halbjahresbericht und dem Halbjahresbericht in einer anderen Sprache Abweichungen bestehen, hat der englischsprachige Halbjahresbericht Vorrang, es sei denn, es ist in irgendeinem Rechtsgebiet, in dem die Anteile verkauft werden, gesetzlich vorgeschrieben, dass bei einer Klage, die auf Angaben in einem Halbjahresbericht in einer anderen Sprache als Englisch beruht, die Sprache des Halbjahresberichts, auf der diese Klage beruht, maßgeblich ist. Etwaige Streitigkeiten bezüglich der Bedingungen des Halbjahresberichts unterliegen unabhängig von der Sprache des Halbjahresberichts irischem Recht und werden in Übereinstimmung mit diesem ausgelegt.

\* In diesem Dokument sind die Ansichten der Gesellschaft enthalten. Diese Ansichten können sich ohne Vorankündigung ändern. Dieses Material wurde ausschließlich zu Informationszwecken verteilt. Prognosen, Schätzungen und bestimmte hierin enthaltene Informationen beruhen auf firmeneigenem Research und sollten nicht als Anlageberatung oder Empfehlung eines bestimmten Wertpapiers, einer bestimmten Strategie oder eines bestimmten Anlageprodukts erachtet werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. Die hierin enthaltenen Informationen wurden aus Quellen bezogen, die als verlässlich erachtet werden. Eine diesbezügliche Garantie wird jedoch nicht abgegeben. Kein Teil dieses Dokuments darf ohne ausdrückliche schriftliche Zustimmung in jedweder Form reproduziert werden, und es ist ebenso untersagt, in anderen Veröffentlichungen darauf Bezug zu nehmen. PIMCO ist in den USA und weltweit eine Marke von Allianz Asset Management of America LLC. ©2024, PIMCO.

## Sehr geehrte Anteilinhaberin, sehr geehrter Anteilinhaber,

Dieser Halbjahresbericht bezieht sich auf den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024 (der „Berichtszeitraum“). Auf den nachfolgenden Seiten finden Sie nähere Einzelheiten zu den Anlageergebnissen sowie eine Erörterung bestimmter Faktoren, die während des Berichtszeitraums Einfluss auf die Wertentwicklung hatten.

Die Weltwirtschaft wuchs weiter, wenn auch etwas langsamer, trotz anhaltender Inflation, erhöhter Zinssätze und geopolitischer Sorgen.

### Mehrere Zentralbanken passten ihre Geldpolitik an

Die Inflationsrate ging im Berichtszeitraum zurück, lag in den meisten großen Volkswirtschaften jedoch weiterhin über den Zielvorgaben der Zentralbanken. Nachdem die US-Notenbank (die „Fed“) den Leitzins um insgesamt 5,25 % angehoben hatte, hielt sie die Zinsen seit Juli 2023 konstant. Auf ihrer Sitzung im Juni 2024 teilte die Fed mit, dass die Inflation zwar nach wie vor hoch sei, aber Fortschritte beim Erreichen des Inflationsziels der Fed von 2 % erzielt worden seien. Einigen Vertretern zufolge erfordere ein Beginn von Zinssenkungen weiteres Vertrauen in eine nachhaltige Rückkehr der Inflation auf 2 %, die meisten Fed-Vertreter gingen jedoch davon aus, dass moderate Zinssenkungen im Jahr 2024 beginnen würden. Die Europäische Zentralbank und die Bank of Canada führten hingegen auf ihren Sitzungen im Juni 2024 erste Zinssenkungen durch. Die Bank of England signalisierte ebenfalls, dass Zinssenkungen bald beginnen könnten. Demgegenüber bleibt die Bank of Japan der Ausreißer unter den wichtigsten Industrieländern, da sie ihren kurzfristigen Leitzins im März 2024 von -0,1 % auf null bis 0,1 % anhebte und damit ihren längeren akkommodierenden geldpolitischen Kurs beendete.

### Die Finanzmärkte verzeichneten im Allgemeinen positive Renditen.

Die Rendite der als Benchmark dienenden 10-jährigen US-Staatsanleihen ist im Berichtszeitraum gestiegen. In vielen anderen Industrieländern stiegen die Renditen für 10-jährige Staatsanleihen ebenfalls. Insgesamt verzeichnete der globale Anleihemarkt gegen Ende 2023 Gewinne, gestützt durch die politischen Äußerungen der Zentralbanken, die ein mögliches Ende der geldpolitischen Straffung signalisierten. Der Markt war dann unruhig, schwächte sich im ersten Halbjahr 2024 jedoch insgesamt ab. Während des Berichtszeitraums schnitten globale Anleihen mit niedrigerem Rating im Allgemeinen besser ab als ihre Pendanten mit höherem Rating. Die globalen Aktien zogen an, ebenso wie viele Rohstoffe. Der US-Dollar legte gegenüber dem japanischen Yen, dem Euro und dem britischen Pfund zu.

Wir arbeiten weiterhin unermüdlich daran, die dynamischen globalen Märkte zu erkunden und das Vermögen, das Sie uns anvertraut haben, zu verwalten. Bitte sprechen Sie mit Ihrem Finanzberater über Ihre Ziele und besuchen Sie die Website [global.pimco.com](http://global.pimco.com), um sich über unsere neuesten Erkenntnisse zu informieren.

Mit freundlichem Gruß



Craig A. Dawson  
Vorsitzender

Gesamtrenditen bestimmter Anlageklassen für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024	
Anlageklasse (gemessen am, Währung)	12 Monate
US-Large-Cap-Aktien (S&P 500 Index, USD)	15,29 %
Globale Aktien (MSCI World Index, USD)	11,75 %
Europäische Aktien (MSCI Europe Index, EUR)	9,05 %
Schwellenländeraktien (MSCI Emerging Markets Index, EUR)	7,49 %
Japanische Aktien (Nikkei 225 Index, JPY)	19,3 %
Auf Landeswährungen lautende Schwellenmarktanleihen (JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index, USD Unhedged)	-3,71 %
Auslandsschulden von Schwellenländern (JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, USD Hedged)	1,84 %
Anleihen mit einem Rating unter „Investment Grade“ (ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged)	2,92 %
Kreditanleihen mit Investment Grade (Bloomberg Global Aggregate Credit Index, USD Hedged)	0,23 %
Festverzinsliche Staatsanleihen in Lokalwährung der Investment-Grade-Länder (Bloomberg Global Treasury Index, USD Hedged)	-0,15 %

Zum 30. Juni 2024. QUELLE: PIMCO.

US-amerikanische Large Cap-Aktien gemessen am S&P 500 Index, globale Aktien gemessen am MSCI World Index, europäische Aktien gemessen am MSCI Europe Index, Schwellenmarktaktien gemessen am MSCI Emerging Markets Index, japanische Aktien gemessen am Nikkei 225 Index, auf Landeswährungen lautende Schwellenmarktanleihen gemessen am JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index, Auslandsschulden von Schwellenländern gemessen am JPMorgan Emerging Markets Bond Index, Anleihen mit einem Rating unter „Investment Grade“ gemessen am ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index, Globale Anleihen mit Investment Grade-Rating gemessen am Bloomberg Global Aggregate Credit Index, festverzinsliche, auf Lokalwährung lautende staatliche Schuldtitel von Ländern mit Investment Grade-Rating gemessen am Bloomberg Global Treasury Index.

**Nur zu Informationszwecken und für den Marktkontext. Sofern nicht im Verkaufsprospekt und im entsprechenden Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen/Basisinformationsblatt anders angegeben, werden die vorgenannten Indizes nicht für die aktive Verwaltung eines Fonds verwendet.**

Quelle: Trading Economics

Aussagen zu Finanzmarktrends sind auf aktuellen Marktbedingungen begründet, die schwanken können. Es kann nicht garantiert werden, dass diese Anlagestrategien unter allen Marktbedingungen funktionieren oder für alle Anleger geeignet sind. Alle Anleger sollten insbesondere in Zeiten eines Marktabschwungs hinterfragen, ob sie auch langfristig anlegen können. Ausblick und Strategien können sich ohne Vorankündigung ändern.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit bietet keine Garantie für künftige Ergebnisse. Sofern nichts Anderweitiges angegeben ist, spiegeln Indexrenditen die Wiederanlage etwaiger Ertragsausschüttungen und Kapitalgewinne wider; Gebühren, Maklerprovisionen und sonstige Anlagekosten bleiben jedoch unberücksichtigt. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

## Wichtige Angaben zu den Fonds

Dieses Dokument darf nur in Verbindung mit dem aktuellen Verkaufsprospekt der PIMCO Funds: Global Investors Series plc verwendet werden. Anleger sollten vor einer Anlage in den Fonds deren Anlageziele, Risiken, Gebühren und Auslagen sorgfältig prüfen. Diese und andere Informationen sind im Verkaufsprospekt enthalten. Bitte lesen Sie den Verkaufsprospekt sorgfältig, bevor Sie eine Anlage tätigen oder Gelder anweisen.

Nach unserer Überzeugung spielen Anleihe-Fonds in einem gut diversifizierten Anlageportfolio eine wichtige Rolle. Es gilt jedoch zu beachten, dass in einem Umfeld, in dem die Zinssätze einer Aufwärtstendenz folgen können, steigende Zinsen einen negativen Einfluss auf die Wertentwicklung der meisten Anleihe-Fonds haben und die von einem Fonds gehaltenen Rentenpapiere voraussichtlich an Wert verlieren. Die Kursschwankungsintensität von Rentenpapieren kann in Zeiten steigender Zinsen ebenfalls zunehmen und dadurch zu erhöhten Verlusten für die Fonds führen. Anleihe-Fonds und einzelne Anleihen mit einer längeren Duration (ein Maß zur Bestimmung der Sensitivität des Kurses eines Wertpapiers gegenüber Zinsänderungen) neigen zu stärkeren Reaktionen auf Zinssatzänderungen, was sie gewöhnlich schwankungsanfälliger macht als Wertpapiere oder Fonds mit kürzeren Durationen. Die längerfristige Wertentwicklung der meisten Anleihe-Fonds hat von den Kapitalgewinnen profitiert, die sich zum Teil aus einem längeren Zeitraum fallender Zinsen ergeben. Bei steigenden Zinsen ist nicht davon auszugehen, dass diese Kapitalgewinne wiederkehren.

Die Fonds können zusätzlich zu den vorstehend, im Verkaufsprospekt der Fonds und im Abschnitt „Finanzrisiken“ in den Erläuterungen zum Abschluss beschriebenen Risiken weiteren Risiken unterliegen. Bei einigen dieser Risiken kann es sich unter anderem um folgende handeln: Realzinsrisiko, Derivatrisiko, die mit kleinen Unternehmen, Auslandswertpapieren und Hochzinsspapieren verbundenen Risiken, die mit einem bestimmten Sektor einhergehenden Anlagerisiken und die Risiken in Verbindung mit einer Epidemie/Pandemie. Die Fonds dürfen zu Absicherungszwecken oder als Teil einer Anlagestrategie derivative Instrumente verwenden. Der Einsatz dieser Instrumente kann mit bestimmten Kosten und Risiken einhergehen, wie zum Beispiel Liquiditätsrisiko, Zinssatzrisiko, Marktrisiko, Kreditrisiko, Verwaltungsrisiko und dem Risiko, dass ein Fonds eine Position nicht dann glattstellen kann, wenn es für ihn am vorteilhaftesten wäre. Fonds, die in derivative Instrumente anlegen, können einen höheren Betrag als den in diese Instrumente angelegten Kapitalbetrag verlieren. Anlagen in Auslandswerten können Risiken bergen, die von den ausländischen wirtschaftlichen und politischen Entwicklungen abhängen. Dieses Risiko kann bei Anlagen in Schwellenmärkten steigen. Hochzinsanleihen erhalten grundsätzlich eine niedrigere Bonitätsbewertung als andere Anleihen. Anleihen mit niedrigerem Rating sind in der Regel in Bezug auf das Anleihekaptial mit einem höheren Risiko behaftet als höher bewertete Anleihen. Kleinere Unternehmen können schwankungsanfälliger als größere Unternehmen und deshalb mit einem höheren Risiko verbunden sein. Auch die Konzentration von Anlagen auf einzelne Sektoren kann im Gegensatz zu einem diversifizierten Fonds mit einem zusätzlichen Risiko und einer zusätzlichen Volatilität einhergehen.

Einige Fonds können eine ESG-Anlagestrategie (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) verfolgen, gemäß derer Wertpapiere bestimmter Emittenten in der Regel aus anderen Gründen als der Wertentwicklung ausgewählt oder ausgeschlossen werden. Diese Strategie birgt das Risiko, dass sich die Wertentwicklung eines Fonds von ähnlichen Fonds, die keine ESG-Anlagestrategie verfolgen, unterscheidet. Diese Strategie könnte sich etwa auf das Engagement eines Fonds in bestimmten Bereichen oder Anlagearten auswirken und somit negative Folgen für die Wertentwicklung eines Fonds mit sich bringen. Es gibt keine Garantie dafür, dass die vom Anlageberater angewendeten Faktoren die Meinungen eines bestimmten Anlegers widerspiegeln; diese vom Anlageberater angewendeten Faktoren können von denjenigen abweichen, die ein bestimmter Anleger bei der Beurteilung der ESG-Praktiken eines Emittenten für relevant hält. Zukünftige ESG-Entwicklungen und -Regulierungen können die Umsetzung der Anlagestrategie eines Fonds beeinflussen. Darüber hinaus können sich Kosten aus ESG-bezogenen Due Diligence-Prüfungen, vermehrten Berichterstattungen und der Inanspruchnahme externer ESG-Datenanbieter ergeben.

Die Klassifizierung der Portfoliopositionen eines Fonds in diesem Bericht erfolgt gemäß den Standards für Finanzberichterstattung. Die Einstufung einer bestimmten Portfolioposition im Abschnitt mit der Aufstellung des Wertpapierbestands und in anderen Abschnitten in diesem Bericht kann von der Einstufung abweichen, die für die Compliance-Berechnungen eines Fonds verwendet wird. Dies gilt unter anderem für diejenigen, die jeweils im Verkaufsprospekt, in den Anlagezielen oder in aufsichtsrechtlichen und anderen Anlagebeschränkungen und -richtlinien des Fonds verwendet werden, welche gegebenenfalls auf anderen Klassifizierungen in Bezug auf Anlageklassen, Sektoren oder geografische Regionen beruhen können. Alle Teilfonds werden bezüglich der Einhaltung der im Verkaufsprospekt sowie in maßgeblichen Vorschriften enthaltenen Anforderungen separat überwacht. In der Aufstellung des Wertpapierbestands können bestimmte Portfoliobestände zusammengefasst werden, wenn die Anlagen dieselben Attribute (Anleihezins und Fälligkeitstermine) aufweisen.

Die geografischen Klassifizierungen von Wertpapieren in diesem Bericht richten sich nach dem Gründungsland des jeweiligen Unternehmens. Unter bestimmten Umständen kann das Gründungsland eines Wertpapiers vom Land, in dem es wirtschaftlich engagiert ist, abweichen.

Bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investieren kann, stützen sich gegebenenfalls in bestimmter Weise auf den London Interbank Offered Rate („LIBOR“). Der LIBOR ist ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmt und den sich Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel berechnen. Angesichts der schrittweisen Einstellung der Nutzung des LIBOR müssen sich die entsprechenden Fonds auf einen anderen Vergleichsindex umstellen (z. B. des Secured Overnight Financing Rate (SOFR), der den USD-LIBOR ersetzen soll, und mit dem die Kosten von Übernachtkrediten in Form von mit US-Schatzpapieren besicherten Pensionsgeschäften gemessen wird). Die möglichen Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR auf einen Fonds oder auf bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investiert, lassen sich gegebenenfalls nur schwer ermitteln, und sie können abhängig von diesen Faktoren unterschiedlich ausfallen: Der Übergang kann außerdem zu einer Verringerung des Werts bestimmter von einem Fonds gehaltener Anlagen oder zu einer Verringerung der Wirksamkeit damit verbundener Fondstransaktionen wie z.B. Absicherungen führen. Derartige Folgen des Übergangs weg vom LIBOR sowie andere unvorhergesehene Auswirkungen könnten dazu führen, dass ein Fonds Verluste erleidet.

Die Grafik zur Netto-Wertentwicklung in jeder in diesem Halbjahresbericht enthaltenen Fondszusammenfassung misst die Wertentwicklung unter der Annahme, dass sämtliche Dividendenausschüttungen und Ausschüttungen von Kapitalgewinnen reinvestiert werden. In den Renditen nicht berücksichtigt ist der Abzug von Steuern, die ein Anteilinhaber zahlen würde auf: (i) Ausschüttungen des Fonds; oder (ii) die Rücknahme von Fondsanteilen. In der Tabelle zur Nettowertentwicklung wird die Wertentwicklung jedes Fonds mit der Wertentwicklung eines breit angelegten Wertpapiermarktindex (Vergleichsindex) verglichen. Die frühere Wertentwicklung jedes Fonds vor und nach Steuern ist nicht unbedingt ein Indikator dafür, wie sich der Fonds in der Zukunft entwickeln wird. Anlagen in einem Fonds gelten nicht als Bankeinlagen und werden nicht von einer behördlichen Stelle verbürgt oder versichert. Der Wert der und die Einkünfte aus den Anteilen am Fonds können steigen oder sinken; eventuell erhalten Sie nicht den ursprünglich in den Fonds investierten Betrag zurück.

## Wichtige Angaben zu den Fonds (Forts.)

---

PIMCO Funds: Global Investors Series plc wird vertrieben von PIMCO Europe Ltd., 11 Baker Street, London W1U 3AH, Vereinigtes Königreich; PIMCO Europe GmbH, Seidlstraße 24-24a, 80335 München, Deutschland; PIMCO Asia Pte Ltd., 8 Marina View #30-01, Asia Square Tower 1, Singapur 018960, PIMCO Asia Limited, Suite 2201, 22nd Floor, Two International Finance Centre, 8 Finance Street, Central Hong Kong und PIMCO Australia Pty Ltd., Level 19, 5 Martin Place, Sydney, New South Wales 2000, Australien; [www.pimco.com](http://www.pimco.com).

Definierte Begriffe, die in diesem Halbjahresbericht verwendet werden und nicht anderweitig definiert sind, haben die im Prospekt der Gesellschaft genannte Bedeutung.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	9,28 %	(0,43 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	9,19 %	(0,44 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2021)	9,05 %	(6,24 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)	9,11 %	(3,58 %)
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	9,09 %	(0,91 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 01. Jul. 2020)	8,86 %	(3,01 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	8,87 %	(1,30 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 2021)	9,21 %	(5,08 %)
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Mrz. 2021)	9,25 %	(5,07 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	8,75 %	(1,33 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	9,63 %	0,24 %
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index	10,52 %	(0,14 %) <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	8,60 %	(5,78 %)
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 30. Sep. 2020)	8,55 %	(4,39 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (AUD Hedged)	9,94 %	(3,86 %) <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 23. Okt. 2020)	7,08 %	(5,81 %)
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 23. Okt. 2020)	7,09 %	(5,81 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 23. Okt. 2020)	6,73 %	(6,62 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 23. Okt. 2020)	6,61 %	(6,65 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CHF Hedged)	8,46 %	(5,37 %)
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	7,97 %	(3,78 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CNH Hedged)	9,37 %	(2,99 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	8,58 %	(4,68 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 25. Sep. 2020)	8,52 %	(4,68 %)
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 10. Sep. 2020)	8,26 %	(5,43 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sept. 2020)	8,02 %	(5,51 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 25. Sep. 2020)	8,04 %	(5,52 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (EUR Hedged)	9,73 %	(4,81 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jul. 2021)	9,22 %	(5,30 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Mai 2021)	9,16 %	(6,11 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (GBP Hedged)	10,38 %	(5,55 %) <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	8,89 %	(1,38 %)
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	8,77 %	(1,41 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (HKD Unhedged)	10,50 %	(0,23 %)
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Juli 2021)	8,40 %	(5,47 %)
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 20. Aug. 2020)	8,21 %	(4,13 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	7,88 %	(1,92 %)
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	8,00 %	(1,91 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (SGD Hedged)	9,63 %	(0,92 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er in einen Mix aus festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten, die wirtschaftlich mit asiatischen Ländern, ausgenommen Japan, verbunden sind, sowie verbundenen Derivaten auf diese Wertpapiere investiert. Vom Fonds gekaufte Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) sind von Moody's mindestens mit C oder von S&P oder Fitch gleichwertig bewertet (oder weisen, falls sie kein Rating haben, nach Meinung der Anlageberatungsgesellschaft eine vergleichbare Qualität auf). Ausgenommen davon sind hypothekarisch gesicherte Wertpapiere, für die es kein vorgeschriebenes Mindest-Kreditrating gibt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Schuldtitelauswahl in den Sektoren Konsumgüter und Industrie in China sowie Immobilien in Hongkong trug zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Das übergewichtete Engagement in pakistanischen Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Es gab ansonsten keine anderen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag leisteten.
- » Das untergewichtete Engagement im chinesischen Immobiliensektor beeinträchtigte die relative Wertentwicklung.
- » Die Untergewichtung von quasi-staatlichen Schuldtiteln in Pakistan und China beeinträchtigte die relative Wertentwicklung.
- » Die Schuldtitelauswahl im breiteren asiatischen Markt für hochverzinsliche Unternehmensanleihen außerhalb von China/Hongkong beeinträchtigte die relative Wertentwicklung.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	4,58 %	6,25 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020)	4,49 %	(1,06 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	4,39 %	5,91 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2023)	4,31 %	8,17 %
Class E, thesaurierend (Auflegung 04. Sep. 2020)	4,14 %	(1,88 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2010)	4,16 %	2,60 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung 01. Dez. 2020)	4,86 %	(0,85 %)
JPMorgan Asia Credit Index <sup>3</sup>	2,81 %	3,37 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	3,65 %	4,29 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Mrz. 2021)	3,67 %	(3,35 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	3,46 %	3,95 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2023)	3,43 %	6,42 %
E Class EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2021)	3,21 %	(4,17 %)
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	2,04 %	(2,90 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2011)	7,26 %	3,26 %
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged) <sup>3</sup>	5,97 %	4,48 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 13. Aug. 2021)	4,29 %	(2,78 %)
JPMorgan Asia Credit Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	2,68 %	(2,24 %)
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020)	4,01 %	(1,71 %)
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2011)	4,03 %	1,33 %
JPMorgan Asia Credit Index (HKD Unhedged) <sup>3</sup>	2,76 %	2,37 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	3,63 %	(1,47 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	3,14 %	(2,32 %)
JPMorgan Asia Credit Index (SGD Hedged) <sup>3</sup>	1,94 %	(1,52 %)

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Asia Strategic Interest Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 31. Mai 2016: [90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1-Monats-USD-Libor] \* [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3-Monats-USD-Libor]; seit dem 01. Juni 2016: JPMorgan Asia Credit Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Asia Strategic Interest Bond Fund strebt die Erwirtschaftung attraktiver und stabiler Erträge an. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Fonds kann bis zu 50 % of seines Gesamtvermögens in hoch verzinsliche Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) investieren. Der Fonds konzentriert seine Anlagen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) in Asien, ausgenommen Japan, anlegt. Er kann jedoch bis zu ein Drittel seines Gesamtvermögens in andere Renteninstrumente (wie im Verkaufsprospekt definiert) investieren, darunter auch Papiere von staatlichen Emittenten und Unternehmen außerhalb Asiens, ausgenommen Japan.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement in Unternehmensanleihen der asiatischen Schwellenländer trug zur absoluten Wertentwicklung bei, insbesondere im High-Yield-Segment.
- » Das Engagement im USD-Basis-Carry-Satz trug zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement in Staatsanleihen von Pakistan und Sri Lanka förderte ebenfalls die absolute Wertentwicklung.
- » Das Engagement in der US-Duration beeinträchtigte die absolute Wertentwicklung.
- » Das Engagement in Schwellenmarkt-Unternehmensanleihen in lokaler Währung beeinträchtigte die absolute Wertentwicklung.
- » Es gab keine weiteren Verlustbringer für diesen Fonds.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	8,00 %	5,85 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	7,82 %	4,15 %
Class E, thesaurierend (Auflegung 22. Jun. 2009)	7,36 %	4,38 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Jan. 2011)	7,34 %	3,08 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	7,91 %	5,88 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	7,93 %	5,86 %
BM Retail Decumulation (Auflegung: 10. Apr. 2024)	—	2,48 %
M Retail, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	7,59 %	12,00 %
M Retail Decumulation (Auflegung: 10. Apr. 2024)	—	2,79 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	7,63 %	12,02 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 30. Nov. 2023)	7,64 %	12,05 %
UM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 29. Apr. 2024)	—	3,31 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 06. Jul. 2016)	8,52 %	7,61 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index <sup>3</sup>	6,39 %	8,03 % <sup>2</sup>
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Institutional RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	8,15 %	11,90 %
Institutional RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	8,15 %	11,90 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (RMB Hedged) <sup>3</sup>	6,54 %	10,55 %
<b>Auf CNH lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional RMB (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	10,73 %	14,97 %
Institutional RMB (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	10,73 %	14,97 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index <sup>3</sup>	9,08 %	13,57 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	8,43 %	4,94 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Jun. 2009)	7,81 %	3,47 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 24. Jun. 2011)	7,82 %	2,07 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	6,84 %	6,93 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2010)	9,12 %	4,39 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	7,51 %	6,46 %
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
M Retail HKD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	7,69 %	12,00 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	7,63 %	12,01 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 30. Nov. 2023)	7,64 %	11,94 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index <sup>3</sup>	6,37 %	11,04 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
M Retail SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	8,00 %	12,00 %
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)	8,05 %	12,02 %
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 30. Nov. 2023)	8,05 %	12,05 %
UM Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Apr. 2024)	—	3,21 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (SGD Hedged) <sup>3</sup>	6,74 %	10,82 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Balanced Income and Growth Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 29. November 2023: 60 % MSCI All Country World Index /40 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged; seit dem 30. November 2023: 60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Balanced Income and Growth Fund (ehemals PIMCO Global Core Asset Allocation Fund) strebt bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung die maximal mögliche Gesamtrendite an, indem er sich an einem breiten Spektrum von Vermögensklassen beteiligt, einschließlich Aktien, Rentenwerte, Rohstoffe und Immobilien (wie im Fondsnachtrag beschrieben). Der Teilfonds kann (gemäß dem Verkaufsprospekt) auch in andere PIMCO-Fonds und andere Organismen für gemeinsame Anlagen anlegen.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein Long-Engagement in US-Aktien trug zur Wertentwicklung bei, da US-Aktien im Berichtszeitraum positive Renditen erzielten.
- » Ein Long-Engagement in japanischen Aktien trug zur Wertentwicklung bei, da japanische Aktien im Berichtszeitraum positive Renditen erzielten.
- » Ein Long-Engagement in taiwanesischen Aktien trug zur Wertentwicklung bei, da taiwanesische Aktien im Berichtszeitraum positive Renditen erzielten.
- » Das Long-Engagement im japanischen Yen (JPY) war der Wertentwicklung abträglich, da der JPY während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar (USD) nachgab.
- » Das Long-Engagement in US-Duration war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen während des Berichtszeitraums stiegen.
- » Das Long-Engagement im brasilianischen Real (BRL) war der Wertentwicklung abträglich, da der BRL während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar (USD) nachgab.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	4,45 %	5,31 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2014)	4,47 %	4,58 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2014)	4,29 %	4,14 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	4,19 %	4,14 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	4,21 %	4,72 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	4,22 %	4,72 %
Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 12. Aug. 2022)	4,21 %	5,64 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	3,99 %	4,11 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	3,91 %	3,58 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	4,07 %	3,92 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	4,39 %	4,47 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	3,76 %	3,51 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2013)	4,90 %	5,84 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>	2,73 %	1,65 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Apr. 2024)	—	2,10 %
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Mär. 2024)	—	1,54 %
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	3,70 %	2,60 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Aug. 2015)	4,23 %	4,78 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	2,18 %	1,77 % <sup>2</sup>
<b>Auf BRL lautende Klassen</b>		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jan. 2018)	(7,09 %)	(0,47 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (BRL Hedged) <sup>3</sup>	(8,64 %)	(1,36 %)
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	3,99 %	3,41 %
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) <sup>4</sup>	2,52 %	2,10 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	2,41 %	2,89 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Jun. 2014)	1,95 %	0,95 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>5</sup>	0,79 %	(0,48 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	3,65 %	3,54 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	3,66 %	3,55 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	3,71 %	2,65 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2016)	3,50 %	3,21 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	3,42 %	3,02 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	3,21 %	2,40 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	3,27 %	1,67 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	3,69 %	2,40 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	3,02 %	1,52 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>6</sup>	1,98 %	0,30 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	4,32 %	4,38 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	4,38 %	4,45 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	4,12 %	1,13 %
M Retail GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Mai 2024)	—	0,76 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	4,27 %	3,26 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>7</sup>	2,66 %	1,18 % <sup>2</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Capital Securities Fund strebt Engagements mit Fokus auf Capital Securities (wie im Verkaufsprospekt definiert) zusammen mit einer maximalen Gesamtrendite an, in Übereinstimmung mit der Kapitalerhaltung und umsichtigen Anlageverwaltung durch die Anlage in ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten bestehendes Portfolio (wie im Verkaufsprospekt definiert) und andere Wertpapiere, von denen gemäß den im Verkaufsprospekt des Teilfonds angegebenen Richtlinien mindestens 80 % in Capital Securities angelegt werden. Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Das Engagement in Additional-Tier-1-Anleihen, insbesondere von ausgewählten britischen, niederländischen und spanischen Emittenten, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Engagement in Tier-2-Anleihen, insbesondere von ausgewählten italienischen und französischen Emittenten, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Engagement in erstrangigen Finanzanleihen, insbesondere von ausgewählten italienischen und britischen Emittenten, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Engagement in einem ausgewählten Emittenten außerhalb des Finanzsektors schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads der Anleihen dieses Emittenten ausweiteten.

» Es gab keine weiteren wesentlichen Verlustbringer für diesen Fonds.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	3,88 %	3,00 %
3 Month HIBOR Index	2,55 %	2,14 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Juli 2021)	3,62 %	(0,40 %)
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	3,36 %	3,04 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 12. Aug. 2022)	3,29 %	4,28 %
M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 23. Dez. 2013)	3,16 %	3,54 %
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average <sup>8</sup>	1,85 %	1,46 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis zum 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR (CAD Hedged) Index; ab 01. Juli 2022: Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)

<sup>5</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month USD LIBOR (Hedged to CHF) Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index

<sup>6</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index

<sup>7</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index

<sup>8</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020)	0,63 %	(0,97 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2023)	0,47 %	5,72 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020)	0,82 %	(0,45 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)	(0,35 %)	(2,81 %) <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Apr. 2023)	0,04 %	3,94 %
Bloomberg MSCI Green Bond Index (AUD Hedged)	(0,96 %)	3,95 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 13. Nov. 2020)	(1,37 %)	(3,98 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (CHF Hedged)	(2,36 %)	(5,93 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	(0,22 %)	(2,59 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Dez. 2020)	(0,23 %)	(2,96 %)
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Jan. 2024)	—	0,30 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sept. 2020)	(0,57 %)	(3,42 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (EUR Hedged)	(1,12 %)	(4,49 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	0,53 %	(1,52 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021)	0,51 %	(1,91 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (GBP Hedged)	(0,48 %)	(3,47 %) <sup>2</sup>
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2021)	(0,18 %)	(3,31 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	(0,43 %)	(4,07 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (SEK Hedged)	(1,16 %)	(5,04 %) <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	(0,21 %)	(1,93 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (SGD Hedged)	(1,22 %)	(3,69 %)

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Climate Bond Fund strebt optimale risikobereinigte Renditen bei umsichtiger Vermögensverwaltung an und berücksichtigt dabei langfristige klimabezogene Risiken und Chancen. Der Fonds verfolgt sein Anlageziel, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die schrumpfenden Spreads und der Carry in Unternehmensanleihen mit Investment Grade, insbesondere im Finanzsektor, trugen zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Die schrumpfenden Spreads und die Titelauswahl bei Schuldtiteln aus Schwellenländern, insbesondere im Versorgungssektor, trugen zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Das Long-Engagement in Spreadrisiken hochverzinslicher Unternehmensanleihen, insbesondere im Sektor Automobil, war der absoluten Wertentwicklung zuträglich, da die Spreads schrumpften.
- » Das moderate Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die absolute Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Das moderate Long-Engagement im vorderen und mittleren Bereich der britischen und europäischen Renditekurven belastete die absolute Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2006)	4,27 %	(0,42 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	4,05 %	(1,75 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	3,68 %	(1,71 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	4,11 %	(9,20 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return	5,14 %	(1,59 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2010)	3,43 %	(0,95 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	2,96 %	(3,31 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged)	4,36 %	(1,97 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jun. 2021)	7,49 %	8,37 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Unhedged)	8,39 %	9,69 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2017)	4,06 %	3,15 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Hedged)	5,01 %	2,66 %
<b>Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Nov. 2022)	5,16 %	(8,23 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Unhedged)	6,01 %	(7,80 %)
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
E Class SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2021)	2,95 %	1,87 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (SGD Hedged)	4,26 %	4,65 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Commodity Real Return Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er in (börsennotierte oder im Freiverkehr (OTC) gehandelte) derivative Instrumente investiert. Hierbei kann es sich um Swaps, Futures, Optionen auf Futures und strukturierte Schuldverschreibungen sowie rohstoffindexgebundene Schuldverschreibungen handeln, die es ihm ermöglichen, ein Engagement in Indizes und Teilindizes (einschließlich unter anderem bei Indizes der Bloomberg Commodity-Indexfamilie) einzugehen, die sich auf Rohstoffe beziehen, die die Anforderungen der irischen Zentralbank erfüllen und gegebenenfalls von dieser freigegeben wurden. Nähere Einzelheiten zu den vom Fonds verwendeten Indizes sowie zu den Arten von Rohstoffen, auf die diese sich beziehen, sind auf Anfrage von der Anlageverwaltungsgesellschaft erhältlich. Diese Instrumente bieten ein Engagement gegenüber den Anlagerenditen der Rohstoffmärkte, ohne direkt in physische Rohstoffe zu investieren, und werden durch ein aktiv verwaltetes Portfolio mit internationalen Rentenwerten besichert (wie im Verkaufsprospekt definiert). Der Fonds kann außerdem in Stamm- und Vorzugsaktien sowie in wandelbare Wertpapiere von Emittenten in rohstoffbezogenen Branchen investieren.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Übergewichtung des Teilssektors Erdöl trug zur relativen Wertentwicklung bei, da der Teilssektor positive Renditen erzielte.
- » Das untergewichtete Engagement in den Teilssektoren Erdgas und Getreide trug zur relativen Wertentwicklung bei, da beide Teilssektoren negative Renditen erzielten.
- » Das übergewichtete Engagement in der Breakeven-Inflation in den USA und Japan trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Breakeven-Inflation in den USA und Japan stieg.
- » Das untergewichtete Engagement in deutschen nominalen Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die deutschen nominalen Renditen stiegen.
- » Das Engagement in verbrieften Vermögenswerten, einschließlich Collateralised Loan Obligations („CLO“), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads bei diesen Wertpapieren auf breiter Basis verengten.
- » Die strukturelle Allokation in globalen kurzfristigen inflationsgebundenen Anleihen (ILBs) als Sicherheiten zur Deckung des Rohstoffengagements des Fonds beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da globale kurzfristige ILBs, gemessen am Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged), schlechter abschnitten als die US 3-Month Treasury Bill-Sicherheiten innerhalb des Rohstoffindexes.
- » Das untergewichtete Engagement in den Teilssektoren Basismetalle und Edelmetalle beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da beide Teilssektoren positive Renditen erzielten.
- » Das Engagement in California Carbon Allowances (CCAs) beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da CCAs negative Renditen erzielten.
- » Das übergewichtete Engagement in US-Zinssätzen beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die US-Renditen stiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	3,18 %	3,36 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	2,73 %	1,89 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2024)	—	1,80 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>	2,73 %	1,47 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2012)	1,12 %	0,69 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>4</sup>	0,79 %	(0,46 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	2,39 %	1,99 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	1,94 %	0,42 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>5</sup>	1,98 %	0,36 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR Index; seit dem 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month USD LIBOR (Hedged to CHF) Index; seit dem 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index

<sup>5</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month Euribor Index; seit dem 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche langfristige Rendite erzielen. Der Fonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein Long-Engagement in US-Bargeldzinsen, da Carry zur Wertentwicklung beitrug.
- » Ein Long-Engagement in Investment-Grade-Schuldtiteln, insbesondere von ausgewählten Emittenten aus dem Banken- und Maklersektor, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in hochverzinslichen Schuldtiteln, insbesondere von ausgewählten Emittenten aus den Sektoren Nahrungsmittel und Getränke sowie Pipelines, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.
- » Ein Long-Engagement in der lokalen Duration von Schwellenländern beeinträchtigte die Wertentwicklung, insbesondere ein Long-Engagement in der lokalen Duration Mexikos, da die Zinssätze stiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	2,21 %	5,23 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Sep. 2008)	2,23 %	5,25 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	2,00 %	2,57 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	2,06 %	2,56 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	1,93 %	3,40 %
BM Retail Decumulation (Auflegung: 21. Dez. 2023)	1,25 %	1,50 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	1,51 %	1,07 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	1,77 %	4,24 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	1,72 %	4,31 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2011)	2,17 %	3,73 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Mai 2020)	2,15 %	1,07 %
M Retail Decumulation (Auflegung: 21. Dez. 2023)	1,76 %	2,01 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	1,75 %	3,22 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	1,76 %	2,51 %
N Retail, ausschüttend II (Auflegung 30. Okt. 2020)	1,71 %	(1,39 %)
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	1,61 %	1,90 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	1,49 %	1,89 %
Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,30 %	(0,57 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,27 %	(0,58 %)
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged) <sup>3</sup>	1,63 %	5,08 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012)	1,13 %	2,32 %
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (AUD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (AUD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (AUD Hedged) <sup>3</sup>	0,99 %	3,32 %
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2019)	1,89 %	1,43 %
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (CAD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (CAD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (CAD Hedged) <sup>3</sup>	1,30 %	1,85 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	0,24 %	1,81 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	0,17 %	1,13 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Sept. 2019)	(0,23 %)	(3,02 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,34 %	(3,30 %)
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,26 %	(3,30 %)
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (CHF Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (CHF Hedged) und JPMorgan EMBI Global (CHF Hedged) <sup>3</sup>	(0,42 %)	1,94 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2007)	1,47 %	3,91 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Okt. 2007)	1,42 %	3,92 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2007)	1,23 %	3,69 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	1,30 %	1,11 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jul. 2007)	1,19 %	3,53 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jul. 2007)	0,98 %	3,15 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2009)	1,01 %	2,59 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,81 %	(0,01 %)

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Diversified Income Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio mit Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl in den Schwellenländern, darunter die Übergewichtung ausgewählter osteuropäischer und lateinamerikanischer Emittenten, trug zur Wertentwicklung bei, da diese Emittenten eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erzielten.
- » Makro-Strategien, insbesondere die Positionierung innerhalb der US-Zinssätze, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze stiegen.
- » Die Titelauswahl bei den Investment-Grade-Schuldtiteln, darunter die Übergewichtung ausgewählter Emittenten im Pipeline- und Dienstleistungssektor, trug zur Wertentwicklung bei, da diese Emittenten eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erzielten.
- » Die Titelauswahl bei den hochverzinslichen Schuldtiteln, einschließlich der Übergewichtung ausgewählter Emittenten im Finanzdienstleistungs- und Telekommunikationssektor, beeinträchtigte die Wertentwicklung, da diese Emittenten eine unterdurchschnittliche Wertentwicklung aufwiesen.
- » Das untergewichtete Engagement in ausgewählten supranationalen Emittenten aus Industrieländern schmälerte die Wertentwicklung, da diese auf risikobereinigter Basis eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erzielten.

## Diversified Income Fund (Cont.)

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,87 %	(0,01 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,56 %	(2,29 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,61 %	(2,28 %)
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (EUR Hedged) und JPMorgan EMBI Global (EUR Hedged) <sup>3</sup>	0,83 %	3,58 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2006)	2,10 %	4,88 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2006)	2,17 %	4,83 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	1,88 %	2,73 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,14 %	(1,21 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,14 %	(1,22 %)
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (GBP Hedged) und JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged) <sup>3</sup>	1,49 %	4,55 % <sup>2</sup>
<b>Auf JPY lautende Klassen</b>		
Administrative JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	(0,84 %)	(6,81 %)
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (JPY Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (JPY Hedged) und JPMorgan EMBI Global (JPY Hedged) <sup>3</sup>	(1,25 %)	(5,09 %)
<b>Auf MXN lautende Klassen</b>		
Institutional MXN (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Dez. 2020)	5,18 %	4,25 %
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (MXN Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (MXN Hedged) und JPMorgan EMBI Global (MXN Hedged) <sup>3</sup>	4,64 %	5,65 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,39 %	4,24 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Dez. 2020)	1,14 %	(3,92 %)
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (SEK Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (SEK Hedged) und JPMorgan EMBI Global (SEK Hedged) <sup>3</sup>	0,77 %	3,90 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	1,36 %	(0,18 %)
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019)	1,16 %	0,26 %
E Class SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Okt. 2019)	0,91 %	(1,08 %)
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,41 %	(1,24 %)
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (SGD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (SGD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (SGD Hedged) <sup>3</sup>	0,76 %	1,35 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Diversified Income Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 09. November 2015: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit Component (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global; seit dem 10. November 2015: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged)

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2011)	5,67 %	3,95 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	5,52 %	3,13 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2013)	5,21 %	2,68 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2011)	5,25 %	3,04 %
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged) <sup>3</sup>	4,72 %	3,85 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2011)	4,93 %	2,80 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	5,00 %	1,96 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	4,46 %	1,98 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Mai 2013)	4,39 %	0,78 %
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (EUR Hedged) und JPMorgan EMBI Global (EUR Hedged) <sup>3</sup>	3,92 %	2,84 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2011)	5,62 %	3,71 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2013)	5,54 %	2,65 %
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (GBP Hedged) und JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged) <sup>3</sup>	4,60 %	3,64 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Diversified Income Duration Hedged Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 9. November 2015: Bogey 4309 (Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch High Yield BB-B Rated Developed Markets Constrained (USD Hedged), JPMorgan EMBI Global; ab 10. November 2015: eine Mischung aus den folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged).

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Diversified Income Duration Hedged Fund versucht, in Übereinstimmung mit umsichtiger Anlageverwaltung die derzeitige Rendite zu maximieren, indem er mindestens 80 % seines Nettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio von variabel und flexibel verzinslichen Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) und Renteninstrumenten mit einer Duration von höchstens einem Jahr sowie fest verzinslichen Renteninstrumenten anlegt.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl in den Schwellenländern, darunter die Übergewichtung ausgewählter osteuropäischer und lateinamerikanischer Emittenten, trug zur Wertentwicklung bei, da diese Emittenten eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erzielten.
- » Die Titelauswahl bei den Investment-Grade-Schuldtiteln, darunter die Übergewichtung ausgewählter Emittenten im Pipeline- und Dienstleistungssektor, trug zur Wertentwicklung bei, da diese Emittenten eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erzielten.
- » Makro-Strategien, insbesondere die taktische Positionierung in einem Korb von Währungen mit höherem Carry, trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Das taktische Engagement in hochverzinslichen Credit Derivative Indizes schmälerte die Wertentwicklung, da sie schlechter abschnitten als Baranleihen.
- » Das untergewichtete Engagement in ausgewählten supranationalen Emittenten aus Industrieländern schmälerte die Wertentwicklung, da diese auf risikobereinigter Basis eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erzielten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,38 %	5,17 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,03 %	4,28 %
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified	1,46 %	5,56 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	0,67 %	2,87 %
E Class EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	0,19 %	1,96 %
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (EUR Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (EUR Hedged)	0,66 %	3,05 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,31 %	4,33 %
Jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (GBP Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (GBP Hedged)	1,32 %	4,42 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Diversified Income ESG Fund ist es, die Erträge mit umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel des Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Anlagen mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen ökologische und soziale Merkmale zu bewerben (wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt) und einen Teil des Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl innerhalb der Schwellenländer trug zur Wertentwicklung bei, unter anderem aufgrund einer Übergewichtung ausgewählter afrikanischer Emittenten, da diese eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erzielten, und einer Untergewichtung ausgewählter Emittenten aus dem Nahen Osten und Asien, da diese Emittenten sich unterdurchschnittlich entwickelten.
- » Makro-Strategien, insbesondere die Positionierung innerhalb der US-Zinssätze, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze stiegen.
- » Die Titelauswahl innerhalb der Investment-Grade-Schuldtitle, einschließlich einer Übergewichtung ausgewählter Emittenten im Finanzdienstleistungs- und Telekommunikationssektor, trug zur Wertentwicklung bei, da diese Emittenten eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erzielten.
- » Die Titelauswahl bei den hochverzinslichen Schuldtitle, darunter eine Übergewichtung ausgewählter Emittenten aus den Sektoren Telekommunikation und Gesundheitswesen, beeinträchtigte die Wertentwicklung, da diese Emittenten eine unterdurchschnittliche Wertentwicklung aufwiesen.
- » Das untergewichtete Engagement in ausgewählten supranationalen Emittenten aus Industrieländern schmälerte die Wertentwicklung, da diese Emittenten auf risikobereinigter Basis eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erzielten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2008)	2,54 %	2,61 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Feb. 2010)	2,64 %	2,31 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	2,37 %	1,66 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	2,41 %	1,65 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	2,28 %	1,78 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2010)	2,14 %	1,27 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2010)	2,12 %	1,28 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	2,48 %	2,00 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,53 %	1,70 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021)	3,01 %	0,96 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>	2,73 %	1,14 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	2,41 %	3,12 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	2,18 %	1,88 %
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	2,33 %	1,65 %
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) <sup>4</sup>	2,52 %	2,00 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2010)	0,59 %	0,19 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2011)	0,22 %	(0,75 %)
ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>5</sup>	0,79 %	(0,24 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2009)	1,77 %	1,57 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Dez. 2009)	1,93 %	1,21 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2011)	1,71 %	0,52 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	1,55 %	0,64 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2009)	1,37 %	0,30 %
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Dez. 2010)	1,38 %	0,00 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>6</sup>	1,98 %	0,35 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2009)	2,49 %	1,91 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	2,49 %	1,63 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 2010)	1,97 %	0,90 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>7</sup>	2,66 %	0,99 % <sup>2</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Apr. 2011)	2,12 %	2,00 %
1 Month NIBOR Rate Index	2,33 %	1,60 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2011)	1,51 %	0,68 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (SEK Hedged) <sup>3</sup>	1,94 %	0,59 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1 Month USD LIBOR Index; seit dem 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis zum 30. Juni 2022: 1 Month LIBOR Index (CAD Hedged); ab 01. Juli 2022: Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)

<sup>5</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month CHF LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index

<sup>6</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index

<sup>7</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Dynamic Bond Fund beabsichtigt, einen höchstmöglichen langfristigen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) unterschiedlicher Fälligkeiten anlegt. Der Fonds kann in sowohl festverzinsliche Wertpapiere mit Investment Grade-Rating als auch hochverzinsliche Titel investieren, wobei höchstens 40 % der Vermögenswerte in Wertpapiere angelegt werden können, die von Moody's niedriger als Baa bzw. von S&P niedriger als BBB bewertet werden bzw. die von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben (oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind). Der Fonds kann bis zu 50 % seiner Vermögenswerte in festverzinsliche Wertpapiere investieren, die wirtschaftlich mit Schwellenländern verbunden sind.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement im Bargeldzinssatz in den USA trug durch den Carry zur Wertentwicklung bei, da die Bargeldzinssätze in den USA positiv blieben.
- » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in hypothekenbesicherten Non-Agency-Wertpapieren trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement in der australischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die australischen Zinsen stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	1,77 %	2,31 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 25. Feb. 2016)	1,85 %	2,32 %
Investor, thesaurierend (Auflegung 14. Aug. 2020)	1,62 %	(1,58 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	1,28 %	1,27 %
Class E, ausschüttend (Auflegung 10. Sep. 2020)	1,37 %	(2,05 %)
Class T, thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2016)	1,09 %	0,24 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Aug. 2019)	2,22 %	2,03 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>3</sup>	1,98 %	0,32 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
BM Retail AUD (Hedged) Income II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	0,90 %	(3,69 %)
M Retail AUD (Hedged) Income II (Auflegung: 08. Apr. 2021)	1,38 %	(4,39 %)
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	2,18 %	2,27 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	0,30 %	0,11 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>4</sup>	0,79 %	(0,15 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	2,43 %	3,24 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	2,47 %	2,71 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>5</sup>	2,66 %	1,32 % <sup>2</sup>
<b>Auf ILS lautende Klassen</b>		
Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Sep. 2022)	1,81 %	0,74 %
SHIR Shekel Overnight Risk Free Rate	2,27 %	4,35 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	1,71 %	(3,80 %)
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 18. Dez. 2020)	1,25 %	(3,36 %)
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average	1,85 %	2,07 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	2,66 %	4,38 %
Institutional USD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021)	2,71 %	(2,26 %)
BM Retail USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	1,59 %	(2,17 %)
Class E USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	2,06 %	2,40 %
H Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 05. Aug. 2020)	2,57 %	(0,03 %)
M Retail USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 08. Jan. 2020)	2,05 %	1,13 %
T Class USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Sep. 2021)	1,87 %	(4,76 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>6</sup>	2,73 %	1,92 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index

<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month CHF LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index

<sup>5</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index

<sup>6</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1 Month USD LIBOR Index; seit dem 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Dynamic Multi-Asset Fund strebt bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung die maximal mögliche Gesamtrendite an, indem er sich an einem breiten Spektrum von Vermögensklassen beteiligt. Hierzu zählen beispielsweise Aktientitel (wie im Verkaufsprospekt definiert), Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) und Währungen sowie mit Rohstoffen und dem Immobiliensektor zusammenhängende Instrumente (wobei jedoch keine Direktanlagen in Rohstoffe und Immobilien vorgenommen werden), die die im Verkaufsprospekt dargestellte Anlagepolitik des Fonds vorsieht. Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in US-Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.
- » Das Long-Engagement in ausgewählten Währungen von Schwellenländern trug zur Rendite bei, da die Währungen gegenüber dem Euro an Wert zulegte.
- » Das Long-Engagement in der US-Duration trug zur Rendite bei, vor allem in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums, als die US-Renditen fielen.
- » Das Long-Engagement in der australischen Duration schmälerte die Rendite, da die australischen Renditen stiegen.
- » Das Long-Engagement in der britischen Duration schmälerte die Rendite, da die britischen Renditen stiegen.
- » Das Long-Engagement in der deutschen Duration schmälerte die Rendite, da die deutschen Renditen stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 11. Dez. 2007)	(3,01 %)	2,14 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	(3,00 %)	1,95 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2010)	(3,09 %)	0,46 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	(3,49 %)	2,77 %
Class E, ausschüttend (Auflegung 08. Jul. 2010)	(3,42 %)	0,13 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	(3,01 %)	(0,06 %)
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	(2,55 %)	4,64 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	(3,71 %)	1,78 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	(0,07 %)	2,70 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Jun. 2010)	0,08 %	2,20 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	(0,10 %)	0,72 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	(0,57 %)	3,03 %
Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(0,55 %)	2,94 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	(0,76 %)	3,62 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	(2,16 %)	5,11 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	(2,90 %)	4,69 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Local Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds legt grundsätzlich mindestens 80 % seiner Vermögenswerte in Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) an, die auf Währungen von Ländern mit Schwellenwertpapiermärkten lauten, die Terminkontrakte oder Derivate wie Optionen, Futures oder Swap-Vereinbarungen enthalten können.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das übergewichtete Engagement in der türkischen Lira trug aufgrund des positiven Carry der Währung zur Wertentwicklung bei.
- » Das übergewichtete Engagement im ägyptischen Pfund durch nicht-lieferbare Terminkontrakte (NDFs) trug zur Wertentwicklung bei, da die NDFs im Preis stiegen.
- » Das untergewichtete Engagement im kuwaitischen Dinar durch ein maßgeschneidertes NDF-Geschäft trug zur Wertentwicklung bei, da das Geschäft zu einem besseren Preis ausgeführt wurde, als der Markt zum Zeitpunkt der Ausführung implizierte.
- » Das übergewichtete Engagement in der lokalen brasilianischen Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die lokalen brasilianischen Renditen stiegen.
- » Das übergewichtete Engagement in der mexikanischen lokalen Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die mexikanischen lokalen Renditen stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(3,85 %)	8,73 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(3,86 %)	8,74 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(4,03 %)	8,35 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(4,04 %)	8,36 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(4,32 %)	7,67 %
E Class, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(4,27 %)	7,66 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(3,42 %)	11,60 %
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	(3,81 %)	7,95 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(0,89 %)	5,52 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(0,91 %)	5,52 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(1,08 %)	5,17 %
Investor EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(1,09 %)	5,15 %
E Class EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(1,45 %)	4,48 %
E Class EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	(1,40 %)	4,48 %
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	(0,85 %)	4,79 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jun. 2023)	(3,08 %)	1,32 %
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	(2,99 %)	0,73 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Emerging Local Bond ESG Fund ist es, die Erträge mit umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds investiert normalerweise mindestens 80 % des Vermögens in festverzinsliche Anlagen, die auf Währungen von Ländern mit Wertpapiermärkten in Schwellenländern lauten. Der Fonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen ökologische und soziale Merkmale zu bewerben (wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt) und einen Teil des Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das übergewichtete Engagement in der türkischen Lira trug aufgrund des positiven Carry der Währung zur Wertentwicklung bei.
- » Das übergewichtete Engagement im ägyptischen Pfund durch nicht-lieferbare Terminkontrakte (NDFs) trug zur Wertentwicklung bei, da die NDFs im Preis stiegen.
- » Das untergewichtete Engagement im kuwaitischen Dinar durch ein maßgeschneidertes NDF-Geschäft trug zur Wertentwicklung bei, da das Geschäft zu einem besseren Preis ausgeführt wurde, als der Markt zum Zeitpunkt der Ausführung implizierte.
- » Das übergewichtete Engagement in der brasilianischen Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die brasilianischen lokalen Renditen stiegen.
- » Das fehlende Engagement in der chinesischen lokalen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die chinesischen lokalen Renditen fielen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2001)	2,99 %	7,46 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 13. Dez. 2001)	2,99 %	6,87 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2002)	2,80 %	6,15 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 29. Mai 2003)	2,71 %	5,14 %
BM Retail Decumulation (Auflegung: 21. Dez. 2023)	2,01 %	2,33 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	2,07 %	2,41 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,53 %	3,93 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	2,48 %	4,07 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Okt. 2002)	2,89 %	7,01 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung 03. Sep. 2020)	2,78 %	(1,10 %)
M Retail Decumulation (Auflegung: 21. Dez. 2023)	2,52 %	2,85 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	2,49 %	2,78 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	2,54 %	2,21 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	3,36 %	7,13 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	1,84 %	6,66 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012)	1,75 %	1,43 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (AUD Hedged)	1,17 %	2,13 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2005)	0,89 %	2,75 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (CHF Hedged)	(0,20 %)	2,81 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2002)	2,17 %	5,43 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Dez. 2010)	2,25 %	2,33 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	2,03 %	(2,16 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,73 %	2,58 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Hedged)	1,02 %	5,22 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2018)	6,09 %	4,06 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Unhedged)	4,97 %	3,63 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	2,84 %	5,22 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	2,77 %	4,30 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (GBP Hedged)	1,69 %	5,32 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2018)	2,12 %	1,76 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	1,63 %	2,98 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (SGD Hedged)	0,94 %	4,11 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Bond Fund versucht, seine Gesamtrendite in Übereinstimmung mit einer umsichtigen Anlageverwaltung zu maximieren, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten anlegt, die wirtschaftlich an Länder mit aufstrebenden Wertpapiermärkten gebunden sind.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das übergewichtete Engagement in ecuadorianischen Staatsanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in ägyptischen Staatsanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in ukrainischen Unternehmens- und quasi-staatlichen Anleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Titelauswahl bei argentinischen Staatsanleihen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Das untergewichtete Engagement in sambischen Staatsanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	2,82 %	3,40 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	2,69 %	(0,29 %)
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 10. Jun. 2019)	2,56 %	(0,76 %)
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	2,56 %	(0,76 %)
E Class, thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2021)	2,36 %	(4,15 %)
E Class, ausschüttend (Auflegung: 05. Feb. 2021)	2,36 %	(4,18 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2023)	3,16 %	10,41 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified <sup>3</sup>	1,87 %	3,78 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Apr. 2021)	0,72 %	(5,47 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (CHF Hedged) <sup>3</sup>	(0,17 %)	(5,50 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2013)	2,00 %	0,65 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2017)	1,89 %	(1,41 %)
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Jan. 2024)	—	3,30 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2018)	1,54 %	(1,36 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (EUR Hedged) <sup>3</sup>	1,05 %	1,01 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2019)	2,63 %	(1,70 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Hedged) <sup>3</sup>	1,72 %	(2,12 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020)	3,68 %	(1,82 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Unhedged) <sup>3</sup>	2,74 %	(1,78 %)
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Mrz. 2014)	2,03 %	1,34 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (NOK Hedged) <sup>3</sup>	1,28 %	1,77 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Investor SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Feb. 2014)	1,74 %	0,40 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	1,65 %	(5,80 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (SEK Hedged) <sup>3</sup>	0,97 %	1,03 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Emerging Markets Bond ESG Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 01. August 2019: JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, bereinigt um den Filter Socially Responsible Investment (SRI); seit dem 02. August 2019: JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Bond ESG Fund ist bestrebt, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen (durch die ausdrückliche Einbeziehung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmungsführungsfaktoren in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt) die maximal mögliche Rendite zu erzielen. Dazu werden mindestens 80 % des Vermögens in ein aktiv verwaltetes, diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Anlagen (wie im Prospekt angegeben) angelegt, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind. Die Beteiligung an solchen Emittenten lässt sich über die direkte Anlage in Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder über den Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten (wie im Fondsnachtrag näher definiert) erreichen. Alle Wertpapiere werden gemäß dem internen nachhaltigkeitsbezogenen Auswahlverfahren der Anlageberatungsgesellschaft ausgewählt, das darauf ausgelegt ist, ESG-Faktoren (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) zu berücksichtigen, und das eine Ausschlussstrategie umfasst, die von der sozial verantwortlichen Anlageberatungsgesellschaft (wie im Prospekt angegeben) in regelmäßigen Abständen bereitgestellt wird.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das übergewichtete Engagement in ecuadorianischen Staatsanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in ukrainischen Unternehmensanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in ägyptischen Staatsanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das untergewichtete Engagement in sambischen Staatsanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Das untergewichtete Engagement in bahrainischen Staatsanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

## Emerging Markets Corporate Bond Fund

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Nov. 2009)	2,78 %	3,69 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	2,34 %	1,94 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	3,67 %	4,98 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	0,31 %	(0,14 %)
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged)	1,64 %	1,98 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Feb. 2010)	2,07 %	2,28 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2010)	1,53 %	1,26 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged)	2,89 %	3,49 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

### Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Corporate Bond Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den maximal möglichen Gesamtertrag erzielen, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Vermögens in einem aktiv verwalteten breit gefächerten Portfolio aus (im Verkaufsprospekt beschriebenen) Rentenwerten anlegt, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind, einschließlich Rentenwerten, die Emittenten von Industrieschuldverschreibungen begeben haben, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind.

### Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads für ein im Fonds gehaltenes Wertpapier, das nicht in der Benchmark enthalten war, verengten.
- » Das untergewichtete Engagement in einem multinationalen Unternehmensemittenten trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads weiteten.
- » Die Titelauswahl bei mexikanischen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads für ein im Vergleichsindex enthaltenes Wertpapier, das nicht im Fonds gehalten wurde, verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in kolumbianischen quasistaatlichen Anleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.
- » Das übergewichtete Engagement in jamaikanischen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	2,71 %	3,27 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 02. Okt. 2023)	2,23 %	10,20 %
E Class, ausschüttend (Auflegung: 02. Okt. 2023)	2,20 %	10,16 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2022)	3,10 %	7,65 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged	(0,97 %)	0,23 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	3,76 %	1,95 %
E Class EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2022)	3,26 %	2,02 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index (EUR Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	0,14 %	(0,31 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Mrz. 2022)	3,08 %	3,48 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index (GBP Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	(0,62 %)	1,69 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er in einen Mix aus festverzinslichen Wertpapieren (diese sind Darlehen ähnlich und zahlen feste oder variable Zinsen) von Unternehmen oder Regierungen, die wirtschaftlich mit Schwellenländern verbunden sind, verbundenen Derivaten auf diese festverzinslichen Wertpapiere sowie Schwellenmarktwährungen investiert.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das übergewichtete Engagement in der türkischen Lira trug aufgrund des positiven Carry der Währung zur Wertentwicklung bei.
- » Das übergewichtete Engagement in ecuadorianischen Spreads trug zur Wertentwicklung bei, da sich die ecuadorianischen Spreads verengten.
- » Das untergewichtete Engagement im thailändischen Baht trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung schwächer wurde.
- » Das Engagement in der Duration der entwickelten Märkte schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Das übergewichtete Engagement im brasilianischen Real schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung schwächer wurde.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	(0,85 %)	1,45 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	(1,38 %)	1,30 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2010)	2,67 %	3,03 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	2,20 %	2,46 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged)	1,64 %	2,95 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in Währungen von Schwellenländern oder Renteninstrumente (wie im Verkaufsprospekt definiert) investiert, die auf solche lauten. Bei der Auswahl von Ländern, die die Gesellschaft als Schwellenmärkte erachtet, verfügt die Anlageberatungsgesellschaft über einen breiten Spielraum. Die Anlageberatungsgesellschaft wählt die Zusammensetzung des Fonds nach Ländern und Währungen auf der Grundlage ihrer Bewertung von bestimmten Faktoren aus. Zu diesen Faktoren gehören Zinsprognosen, Inflationsraten, Devisenkurse, Geld- und Fiskalpolitik, Handels- und Leistungsbilanz, aktienmarktspezifische Faktoren und andere spezifische Faktoren, die der Anlageberatungsgesellschaft relevant erscheinen. Der Anlageschwerpunkt des Fonds wird wahrscheinlich auf Asien, Afrika, dem Nahen Osten, Lateinamerika und den aufstrebenden Ländern Europas liegen. Der Fonds kann in Instrumente investieren, deren Renditen auf den Renditen von Wertpapieren aus den Schwellenmärkten basieren, etwa derivative Instrumente, anstatt direkt in Wertpapiere oder Wertpapiere aus Schwellenmärkten zu investieren. Die durchschnittliche Duration des Portfolios dieses Fonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaft. Unter normalen Marktbedingungen wird davon ausgegangen, dass sie nicht länger als zwei Jahre ist. Der Fonds kann seine Vermögenswerte insgesamt in hochrentierliche Wertpapiere anlegen, wobei höchstens 15 % der Vermögenswerte in Wertpapiere angelegt werden können, die von Moody's oder S&P niedriger als B bewertet werden bzw. die von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben (oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind).

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das übergewichtete Engagement im ägyptischen Pfund durch nicht-lieferbare Terminkontrakte (NDFs) trug zur Wertentwicklung bei, da die NDFs im Preis stiegen.
- » Das untergewichtete Engagement im chinesischen Yuan schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung schwächer wurde.
- » Das übergewichtete Engagement in der nigerianischen Naira trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung stärker wurde.
- » Das übergewichtete Engagement im brasilianischen Real schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung schwächer wurde.
- » Das übergewichtete Engagement im mexikanischen Peso schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung schwächer wurde.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,50 %	0,41 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,50 %	0,41 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,13 %	(0,48 %)
E Class, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,17 %	(0,48 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	(0,71 %)	(2,52 %)
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Nov. 2021)	0,92 %	(1,08 %)
R Class AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	0,81 %	(0,90 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	(1,35 %)	(3,77 %) <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(0,43 %)	(2,60 %)
E Class CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(0,90 %)	(3,48 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(2,75 %)	(5,67 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	0,74 %	(1,38 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Mai 2021)	0,77 %	(1,44 %)
E Class EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jun. 2021)	0,33 %	(2,52 %)
E Class EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	0,32 %	(2,26 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	(1,50 %)	(4,44 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,50 %	(0,20 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	(0,87 %)	(3,29 %)
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2023)	0,97 %	3,50 %
Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index	(1,31 %)	1,96 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 29. Okt. 2021)	0,70 %	(1,63 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2022)	0,47 %	0,33 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SEK Hedged) Index	(1,60 %)	(5,40 %) <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	0,72 %	(0,35 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	(1,59 %)	(3,38 %)

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO ESG Income Fund strebt hohe laufende Erträge an, die mit einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen vereinbar sind (durch die explizite Einbindung von ESG-Faktoren (Umwelt-, Soziales und Unternehmensführung) in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt). Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement im Bargeldzinssatz in den USA trug durch den Carry zur Wertentwicklung bei, da die Bargeldzinssätze in den USA positiv blieben.
- » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in CMBS (commercial mortgage-backed securities) trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in US-amerikanischen hypotheckenbesicherten Wertpapieren trug durch den Carry zur Wertentwicklung bei, da die Spreads für diese Wertpapiere positiv blieben.
- » Das Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement im japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da dieser gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement im brasilianischen Real beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement in der australischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die brasilianischen Zinsen stiegen.

Gesamterrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	(0,86 %)	3,33 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Jan. 2003)	(0,86 %)	3,00 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2002)	(0,97 %)	2,93 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(1,26 %)	1,68 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	(1,25 %)	1,48 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	(1,20 %)	3,11 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2006)	(2,06 %)	1,71 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index	(2,45 %)	1,69 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus auf Euro lautenden Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das untergewichtete Engagement in der Duration des Euro-Blocks trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Schuldtiteln, einschließlich europäischer Collateralized Loan Obligations und britischer Residential Mortgage-Backed Securities, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Währungsstrategien, einschließlich Long-Positionen im US-Dollar, im südafrikanischem Rand und in der indischen Rupie, trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Währungen gegenüber dem Euro aufgewertet wurden.
- » Das taktische Engagement in der US-Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, insbesondere das übergewichtete Engagement im ersten Quartal des Jahres, da die Zinssätze in diesem Zeitraum stiegen.
- » Das untergewichtete Engagement in regierungsnahen europäischen Emittenten beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Überschussrendite des Sektors positiv war.
- » Ein moderates Long-Engagement in der australischen Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2008)	(0,13 %)	2,71 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	(0,18 %)	1,43 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2010)	(0,58 %)	1,32 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	(0,11 %)	(1,28 %)
H Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 07. Jun. 2019)	(0,09 %)	(1,27 %)
Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	0,00 %	2,54 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Credit Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds legt mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein breit gefächertes Portfolio von auf Euro lautenden Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten an. Diese enthalten direkte oder indirekte Beteiligungen an kreditnahen Rentenwerten oder derivativen Instrumenten, wie Optionen, Futures, Swaps oder Credit Default Swaps. Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl innerhalb der verbrieften Produkte trug zur Wertentwicklung bei, da das Engagement in ausgewählten US-Agency-Hypotheken eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erzielte.
- » Die Titelauswahl im Gesundheitssektor trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter übergewichteter Emittent eine überdurchschnittliche Wertentwicklung verzeichnete.
- » Die Titelauswahl im Nahrungsmittel- und Getränkektor trug zur Wertentwicklung bei, da Engagements in ausgewählten Emittenten eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erzielten.
- » Durationsstrategien und insbesondere das übergewichtete Engagement in der Euro-Duration schmälerten die Wertentwicklung, da die Zinssätze in der Eurozone stiegen.
- » Die Titelauswahl im Versorgersektor schmälerte die Wertentwicklung, da sich ein ausgewählter übergewichteter Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	1,06 %	3,22 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	1,14 %	3,23 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2019)	0,83 %	(0,56 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Mai 2012)	0,90 %	2,84 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 22. Jan. 2024)	—	1,10 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	0,67 %	2,30 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	0,56 %	2,29 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,48 %	0,36 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,50 %	0,37 %
Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	(0,41 %)	1,73 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Income Bond Fund beabsichtigt, seine laufenden Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Anleihen und anderen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von festverzinslichen Sektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft für gewöhnlich höhere Erträge einbringen. Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement im europäischen Bargeldzinssatz trug durch den Carry zur Wertentwicklung bei, da die Bargeldzinssätze in Europa positiv blieben.
- » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in auf Fremdwährungen lautenden Schwellenmarktanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere an Wert gewannen.
- » Das Long-Engagement in Hochzinsunternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in der europäischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die europäischen Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement im japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da dieser gegenüber dem Euro an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement in der australischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die brasilianischen Zinsen stiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Apr. 2006)	(7,59 %)	3,70 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 03. Nov. 2023)	(8,03 %)	4,20 %
Bloomberg Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) + 15 Jahre Index <sup>3</sup>	(7,53 %)	2,68 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Long Average Duration Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. März 2011: Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond > 15 Years Index; 31. März 2011 bis 30. Januar 2012: Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond AAA rated > 15 Years Index; seit dem 31. Januar 2012: Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) + 15 Years Index

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Long Average Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Fonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt. Unter normalen Marktbedingungen leiten sich mindestens zwei Drittel der Duration des Fonds von Engagements bei auf Euro lautenden staatlichen und/oder regierungsnahen Rentenwerten ab.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in verbrieften Schuldtiteln, einschließlich europäischer Collateralized Loan Obligations und britischer Residential Mortgage-Backed Securities, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das untergewichtete Engagement in der Duration des Euro-Blocks trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Währungsstrategien, einschließlich Long-Positionen im US-Dollar, im südafrikanischen Rand und in der indischen Rupie, trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Währungen gegenüber dem Euro aufgewertet wurden.
- » Das taktische Engagement in der US-Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, insbesondere das übergewichtete Engagement im ersten Quartal des Jahres, da die Zinssätze stiegen.
- » Die Länderallokation innerhalb der europäischen Zinssätze, einschließlich eines moderaten Engagements in Peripheriestaaten, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads gegenüber Bundesanleihen weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2006)	2,35 %	1,28 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Jun. 2024)	—	0,20 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,94 %	0,51 %
ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index <sup>3</sup>	1,81 %	0,91 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Short-Term Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; 01. Juli 2021 bis 31. August 2023: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index; seit dem 01. September 2023: ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Short-Term Fund ist bestrebt, bei Kapitalerhaltung und täglicher Liquidität höchstmögliche laufende Erträge zu erzielen. Der Fonds verfolgt sein Anlageziel, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Durationen anlegt, obwohl davon auszugehen ist, dass die durchschnittliche Portfolioduration anderthalb Jahre nicht überschreitet. Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in verbrieften Schuldtiteln, vor allem über europäische Collateralised Loan Obligations und britische und europäische Residential Mortgage Backed Securities, trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in Investment-Grade-Unternehmensanleihen trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Auswahl der Instrumente innerhalb der Zinsstrategien für den Euro-Block trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich die Swap-Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die absolute Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.
- » Es gab keine weiteren wesentlichen Verlustbringer für diesen Fonds.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	2,26 %	2,85 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 22. Dez. 2022)	1,77 %	9,50 %
E Class, ausschüttend (Auflegung: 17. Apr. 2023)	1,72 %	9,55 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	2,48 %	3,40 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	3,10 %	1,74 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO European High Yield Bond Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hochverzinslichen Rentenpapieren, die von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Moody's oder Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind. Unter normalen Marktbedingungen kann der Fonds bis zu 20 % seines Vermögens in hochverzinsliche Rentenpapiere investieren, die von S&P niedriger als CCC bewertet werden oder von Moody's oder Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind. Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl innerhalb des Technologiesektors trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter fehlender Emittent sich unterdurchschnittlich entwickelte, während ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Outperformance erzielten.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Chemiesektor trugen zur Wertentwicklung bei, da sowohl der Sektor als auch ein ausgewählter übergewichteter Emittent eine Outperformance erzielten.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanz- und Maklersektor beeinträchtigten die Wertentwicklung, da der Sektor sowie ausgewählte untergewichtete Emittenten eine bessere Wertentwicklung als der Gesamtmarkt erzielten.
- » Die Titelauswahl im drahtlosen Telekommunikationssektor schmälerte die Wertentwicklung, da sich ein ausgewählter übergewichteter Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Bankensektor beeinträchtigten die Wertentwicklung, da der Sektor sowie ausgewählte untergewichtete Emittenten eine Outperformance erzielten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2011)	2,62 %	1,26 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mrz. 2013)	2,35 %	0,00 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	2,52 %	0,40 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>3</sup>	1,97 %	1,27 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 29. September 2012: PIMCO European Advantage Government 1-3 Year Bond Index; 30. September 2012 bis 16. Januar 2020: Bloomberg Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index; seit dem 17. Januar 2020: Euro Short-Term Rate (ESTER) Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem 30. Juni 2011 berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein breit gefächertes Portfolio von auf paneuropäische Währungen (d.h. die verschiedenen Währungen Europas) lautenden Renteninstrumenten mit unterschiedlichen Laufzeiten. Die durchschnittliche Portfolioduration des Fonds bewegt sich normalerweise zwischen 0 und 5 Jahren, je nach der Prognose der Anlageverwaltungsgesellschaften für den Zinssatz.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in verbrieften Schuldtiteln, vor allem über europäische Collateralised Loan Obligations und britische und europäische Residential Mortgage Backed Securities, trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in Bankkapitalpapieren trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in vorrangigen Finanztiteln trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in der europäischen Duration schmälerte die absolute Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.
- » Das Long-Engagement in der Dollar-Block-Duration schmälerte die absolute Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.
- » Das Long-Engagement in der britischen Duration beeinträchtigte die absolute Wertentwicklung aufgrund von Carry.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 09. Jun. 2009)	(1,19 %)	2,31 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	(2,32 %)	1,72 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Aug. 2011)	1,25 %	1,22 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close)	0,09 %	0,60 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Mai 2010)	1,19 %	2,24 %
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mai 2010)	0,68 %	1,23 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close)	(0,01 %)	1,70 % <sup>2</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2012)	1,88 %	3,57 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close)	0,69 %	3,00 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Advantage Fund versucht, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung höchstmögliche langfristigen Erträge zu erzielen, indem er 80 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die wirtschaftlich mit mindestens drei Ländern verbunden sind (darunter dürfen sich die USA befinden).

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Die Positionierung innerhalb der Devisenmärkte der asiatischen Schwellenländer, einschließlich der Untergewichtung des chinesischen Yuan und des taiwanesischen Dollars, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Schuldtiteln, hauptsächlich über US-amerikanische Non-Agency Mortgage-Backed Securities und europäische Collateralized Loan Obligations, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in der britischen Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.
- » Die Untergewichtung des Engagements in der chinesischen Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen fielen.
- » Das übergewichtete Engagement in der Dollar-Block-Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 1998)	0,96 %	4,83 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2001)	0,93 %	4,50 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 1999)	0,76 %	4,32 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	0,80 %	4,15 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Jun. 2004)	0,69 %	3,82 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	0,48 %	3,30 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	0,50 %	3,27 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	0,88 %	4,18 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	0,84 %	0,00 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	0,48 %	1,13 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	0,35 %	1,34 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	0,33 %	1,35 %
Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,03 %	(0,52 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,94 %	(0,55 %)
W Class Income II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	1,01 %	5,59 %
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index <sup>3</sup>	0,13 %	4,07 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 13. Dez. 2002)	(2,03 %)	3,62 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 23. Mär. 2006)	(2,05 %)	3,19 %
Class E (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 19. Mai 2010)	(2,44 %)	1,28 %
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 19. Mai 2010)	(2,39 %)	1,28 %
H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 26. Feb. 2021)	(2,06 %)	(4,62 %)
Bloomberg Global Aggregate (USD Unhedged) Index <sup>3</sup>	(3,16 %)	2,73 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2024)	—	0,80 %
Bloomberg Global Aggregate (AUD Hedged) Index <sup>3</sup>	(0,48 %)	0,97 %
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	0,55 %	1,50 %
Bloomberg Global Aggregate (CAD Hedged) Index <sup>3</sup>	(0,20 %)	1,08 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2003)	(1,06 %)	2,21 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	(1,07 %)	2,25 %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Jun. 2011)	(1,26 %)	1,24 %
E Class CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2018)	(1,42 %)	(1,71 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(1,01 %)	(3,18 %)
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(1,08 %)	(3,19 %)
Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index <sup>3</sup>	(1,89 %)	1,38 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2003)	0,19 %	3,26 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Apr. 2005)	0,23 %	3,11 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Feb. 2005)	0,00 %	2,75 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(0,26 %)	2,29 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(0,22 %)	(0,39 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2012)	(0,22 %)	0,30 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,09 %	0,93 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(0,41 %)	(0,35 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,33 %	(2,12 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,20 %	(2,12 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index <sup>3</sup>	(0,64 %)	2,37 % <sup>2</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf führende Weltwährungen lauten.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Das untergewichtete Engagement in der japanischen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Schuldtiteln, hauptsächlich über US-amerikanische Non-Agency Mortgage-Backed Securities und europäische Collateralized Loan Obligations, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in der britischen Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.
- » Die Untergewichtung des Engagements in der chinesischen Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen fielen.
- » Das taktische Engagement in den Zinsen des Euro-Blocks, einschließlich der Übergewichtung im April, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen in diesem Zeitraum stiegen.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	0,98 %	2,62 %
Bloomberg Global Aggregate (EUR Unhedged) Index <sup>3</sup>	(0,19 %)	1,96 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2003)	0,86 %	4,27 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2004)	0,86 %	4,27 %
Investor GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Apr. 2005)	0,67 %	3,65 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,84 %	(1,02 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,93 %	(1,02 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index <sup>3</sup>	0,00 %	3,43 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 09. Mrz. 2018)	(1,21 %)	0,99 %
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index <sup>3</sup>	(2,35 %)	0,43 %
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	0,49 %	1,16 %
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index denominated in HKD <sup>3</sup>	0,12 %	1,57 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	0,41 %	4,20 %
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Jul. 2006)	0,24 %	4,14 %
W Class NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 13. Apr. 2021)	0,47 %	(1,86 %)
Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index <sup>3</sup>	(0,40 %)	3,30 % <sup>2</sup>
<b>Auf NZD lautende Klassen</b>		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Nov. 2004)	0,87 %	6,06 %
Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index <sup>3</sup>	0,06 %	5,13 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Nov. 2004)	0,14 %	3,40 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2021)	(0,11 %)	(3,31 %)
Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index <sup>3</sup>	(0,70 %)	2,44 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Aug. 2009)	0,11 %	4,13 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Feb. 2023)	0,08 %	3,83 %
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	(0,29 %)	2,92 %
W Class SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	0,11 %	3,94 %
Bloomberg Global Aggregate (SGD Hedged) Index <sup>3</sup>	(0,73 %)	2,66 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. November 2000: JPMorgan GBI Global Index Hedged in USD; seit dem 01. Dezember 2000: Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	0,79 %	1,85 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung 03. Apr. 2020)	0,68 %	0,39 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2018)	0,55 %	1,51 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	0,26 %	0,49 %
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	0,13 %	1,57 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	0,45 %	1,75 %
Bloomberg Global Aggregate Index (AUD Hedged)	(0,48 %)	0,95 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(1,27 %)	(0,92 %)
E Class CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sept. 2022)	(1,72 %)	(1,71 %)
Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index	(1,89 %)	(1,24 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	0,00 %	(0,16 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(0,05 %)	(0,17 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Feb. 2017)	(0,43 %)	(1,04 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index	(0,64 %)	(0,46 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2020)	0,62 %	(0,74 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	0,66 %	0,91 %
Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index	0,00 %	0,61 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 04. Aug. 2022)	(1,06 %)	(2,51 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	(2,35 %)	(3,58 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020)	1,71 %	(0,30 %)
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index denominated in GBP	0,98 %	(0,14 %)
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	0,28 %	0,90 %
Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index	(0,40 %)	0,67 %
<b>Auf NZD lautende Klassen</b>		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Apr. 2017)	0,62 %	1,58 %
Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index	0,06 %	1,38 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Mai 2021)	(0,04 %)	(2,84 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mai 2023)	(0,28 %)	2,55 %
Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index	(0,70 %)	(2,89 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond ESG ist bestrebt, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen (durch die explizite Einbindung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmungsführungsfaktoren in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt) die maximal mögliche Rendite zu erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf führende Weltwährungen lauten.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Das untergewichtete Engagement in der japanischen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Das untergewichtete Engagement in lokalen Zinssätzen der Schwellenländer, insbesondere Singapur, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze stiegen.
- » Das übergewichtete Engagement in der britischen Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.
- » Die Untergewichtung des Engagements in der chinesischen Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen fielen.
- » Das taktische Engagement in den Zinsen des Euro-Blocks, einschließlich der Übergewichtung im April, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen in diesem Zeitraum stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2003)	1,43 %	4,37 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 09. Nov. 2005)	1,45 %	4,43 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2006)	1,22 %	4,03 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Sep. 2004)	1,17 %	4,00 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	0,99 %	3,55 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	1,27 %	1,96 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Okt. 2019)	1,62 %	1,44 %
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index <sup>3</sup>	0,69 %	3,43 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 04. Okt. 2016)	(4,57 %)	(2,00 %)
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Unhedged) Index <sup>3</sup>	(5,26 %)	(1,93 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2006)	0,64 %	3,57 %
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index <sup>3</sup>	(0,07 %)	2,41 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Ex-US Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 19. Januar 2016: FTSE World Government Bond Ex-U.S. Index (USD Hedged); seit dem 20. Januar 2016: Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond Ex-US Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens 70 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten anlegt, die ihren eingetragenen Geschäftssitz oder ihre überwiegende Geschäftstätigkeit außerhalb der USA haben und mindestens drei Länder außerhalb der USA repräsentieren.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Das untergewichtete Engagement in der japanischen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Schuldtiteln, hauptsächlich über US-amerikanische Non-Agency Mortgage-Backed Securities und europäische Collateralized Loan Obligations, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in der britischen Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.
- » Das moderat übergewichtete Engagement in Zinsen des Euro-Blocks beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Die Untergewichtung des Engagements in der chinesischen Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen fielen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	2,73 %	5,97 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	2,74 %	5,99 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	2,55 %	4,36 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2023)	2,58 %	10,85 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	2,47 %	5,52 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2015)	2,49 %	4,68 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	1,93 %	3,88 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	2,27 %	4,96 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	2,29 %	5,03 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	2,63 %	5,98 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2013)	2,64 %	4,28 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	2,26 %	4,49 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	2,32 %	3,47 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,62 %	4,41 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,03 %	3,20 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,08 %	3,20 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD <sup>3</sup>	2,85 %	6,31 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Feb. 2010)	0,70 %	3,91 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	0,60 %	2,65 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF <sup>3</sup>	0,79 %	4,24 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2008)	1,95 %	4,58 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	1,97 %	4,79 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2011)	1,75 %	3,47 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,48 %	3,77 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2016)	1,55 %	1,70 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR <sup>3</sup>	2,06 %	4,94 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	2,54 %	4,45 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	2,54 %	5,55 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009)	2,11 %	5,38 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP <sup>3</sup>	2,72 %	5,73 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2016)	1,32 %	3,23 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into SGD <sup>3</sup>	1,96 %	4,54 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global High Yield Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 31. März 2014: ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield, BB-B Rated, Constrained Index; seit dem 01. April 2014: ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global High Yield Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hoch verzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf wichtige Währungen lauten, die von Moody's mit niedriger als Baa oder von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Fitch ein gleichwertiges Rating erhalten haben.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Kabel- und Satellitentelekommunikationssektor trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor sowie ein ausgewählter untergewichteter Emittent eine Underperformance erzielten.
- » Die Titelauswahl innerhalb des Technologisektors trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter fehlender Emittent sich unterdurchschnittlich entwickelte, während ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Outperformance erzielten.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Chemiesektor trugen zur Wertentwicklung bei, da sowohl der Sektor als auch ein ausgewählter übergewichteter Emittent eine Outperformance erzielten.
- » Die Titelauswahl im drahtlosen Telekommunikationssektor schmälerte die Wertentwicklung, da sich ein ausgewählter übergewichteter Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Gesundheitssektor beeinträchtigten die Wertentwicklung, da ausgewählte übergewichtete Emittenten unterdurchschnittlich abschnitten, während ein ausgewählter untergewichteter Emittent eine bessere Wertentwicklung erzielte.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2024)	—	0,30 %
E Class, ausschüttend (Auflegung: 17. Jun. 2024)	—	0,20 %
Z Class, thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2024)	—	0,30 %
ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (USD Hedged)	—	0,40 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2024)	—	0,20 %
E Class EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jun. 2024)	—	0,10 %
ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (EUR Hedged)	—	0,34 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2024)	—	0,30 %
E Class GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jun. 2024)	—	0,20 %
ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (GBP Hedged)	—	0,40 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global High Yield Bond ESG Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hochverzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert), die auf wichtige Währungen lauten und von Moody's niedriger als Baa oder von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Fitch ein gleichwertiges Rating erhalten haben. Der Fonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen ökologische und soziale Merkmale auf verschiedene Weise zu bewerben, wie in der Ergänzung des Fonds dargelegt, und einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 17. Juni 2024 auf.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	0,88 %	4,27 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jul. 2003)	0,95 %	4,45 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2005)	0,72 %	3,84 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	0,75 %	4,49 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	0,69 %	4,32 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	0,64 %	4,33 %
BM Retail Decumulation (Auflegung: 21. Dez. 2023)	(0,05 %)	0,12 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2008)	0,39 %	4,09 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	0,41 %	3,29 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	0,80 %	4,23 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	0,85 %	1,42 %
M Retail Decumulation (Auflegung: 21. Dez. 2023)	0,46 %	0,73 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	0,50 %	1,76 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	0,45 %	1,92 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,70 %	2,27 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,70 %	2,28 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	0,27 %	1,08 %
Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,96 %	(1,29 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,91 %	(1,27 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	0,23 %	3,75 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2013)	(0,40 %)	1,64 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 06. Sep. 2016)	(0,36 %)	0,76 %
H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 26. Feb. 2021)	(0,57 %)	(3,79 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged)	(1,07 %)	1,50 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Apr. 2020)	0,33 %	(0,09 %)
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	0,13 %	0,30 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (AUD Hedged)	(0,40 %)	0,97 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2009)	(1,10 %)	1,91 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Feb. 2015)	(1,27 %)	(0,43 %)
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2011)	(1,33 %)	0,82 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(1,38 %)	2,61 %
Administrative CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2013)	(1,41 %)	(0,19 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mrz. 2012)	(1,57 %)	0,04 %
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(1,04 %)	(3,95 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)	(1,80 %)	2,21 % <sup>2</sup>
<b>Auf CZK lautende Klassen</b>		
Institutional CZK (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2015)	1,02 %	1,80 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CZK Hedged)	0,36 %	1,87 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2003)	0,11 %	3,43 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2008)	0,07 %	3,36 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2006)	(0,06 %)	2,91 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(0,02 %)	3,32 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	(0,13 %)	3,06 %

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Investment Grade Credit Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Unternehmens-Rentenpapieren mit Investment Grade-Qualität (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl im Bereich der auf Fremdwährungen lautenden Schwellenmarktanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte übergewichtete mitteleuropäische Unternehmen und eine ausgewählte Schwellenmarkt-Anlagegruppe eine Outperformance erzielten.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Sektor der Immobilieninvestmentgesellschaften (REIT) trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor und ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Outperformance aufwiesen.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Banken- und Maklersektor trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor und ausgewählte übergewichtete US-amerikanische sowie europäische Emittenten eine Outperformance erzielten.
- » Makrostrategien und insbesondere die Kurvenpositionierung in der EUR-Duration schmälerten die Wertentwicklung.
- » Die Titelauswahl im Sektor der Finanzunternehmen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich das Engagement in einem ausgewählten Emittenten angesichts der Besorgnis über die sich abschwächenden operativen Fundamentaldaten unterdurchschnittlich entwickelte.

## Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	(0,16 %)	3,06 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(0,33 %)	2,31 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Sep. 2010)	(0,32 %)	1,19 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,00 %	0,70 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(0,53 %)	(0,68 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,11 %	(2,96 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,09 %	(2,96 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)	(0,56 %)	2,70 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2012)	2,67 %	2,78 %
Class E EUR (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	2,26 %	1,04 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Unhedged)	1,96 %	2,82 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Sep. 2005)	0,74 %	3,87 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Jul. 2008)	0,84 %	4,02 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	0,59 %	4,01 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jan. 2009)	0,51 %	3,83 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mrz. 2009)	0,27 %	3,51 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,61 %	1,61 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,87 %	(1,85 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,76 %	(1,85 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)	0,08 %	3,29 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Mär. 2024)	—	0,18 %
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	0,54 %	0,92 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	0,49 %	0,54 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) Index, lautend auf HKD	0,21 %	1,76 % <sup>2</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jan. 2012)	0,32 %	2,96 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (NOK Hedged)	(0,33 %)	2,71 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Dez. 2009)	0,07 %	2,98 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2012)	(0,19 %)	0,64 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)	(0,63 %)	2,53 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	0,05 %	1,94 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	(0,18 %)	0,61 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Sept. 2017)	(0,20 %)	0,16 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jul. 2012)	(0,40 %)	1,55 %
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 13. Okt. 2020)	0,16 %	(2,16 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SGD Hedged)	(0,65 %)	2,33 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	0,71 %	2,27 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 19. Jul. 2019)	0,68 %	0,73 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mai 2021)	0,54 %	(2,21 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	0,21 %	(1,51 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	0,29 %	(1,50 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Jun. 2019)	0,94 %	1,41 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	0,23 %	1,98 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	(1,33 %)	(0,65 %)
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,25 %)	(3,27 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,77 %)	(4,15 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,70 %)	(4,16 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)	(1,80 %)	(0,96 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	(0,10 %)	0,22 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(0,06 %)	(2,29 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2023)	(0,19 %)	3,21 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Jan. 2023)	(0,28 %)	3,21 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(0,46 %)	(3,19 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(0,51 %)	(3,21 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)	(0,56 %)	(0,09 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	0,56 %	1,28 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 1. Mai 2019)	0,55 %	0,49 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	0,11 %	(2,20 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)	0,08 %	0,98 % <sup>2</sup>
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Nov. 2022)	(0,14 %)	5,89 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Nov. 2019)	(0,39 %)	(1,90 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)	(0,63 %)	(1,63 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Investment Grade Credit ESG Fund ist bestrebt, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen (durch die explizite Einbindung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungsfaktoren in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt) die maximal mögliche Rendite zu erzielen. Der Fonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Unternehmensanleihen mit Investment Grade (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Banken- und Maklersektor trugen zur Wertentwicklung bei, da sowohl der Sektor als auch ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Outperformance erzielten.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Sektor der Immobilieninvestmentgesellschaften (REIT) trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor sowie die ESG-Anleihen ausgewählter übergewichteter Emittenten eine Outperformance gegenüber dem Gesamtmarkt erzielten.
- » Die Titelauswahl in Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da sich das Engagement in den ESG-Anleihen ausgewählter staatlicher und privater Emittenten überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Devisenpositionierung in den Industrieländern und insbesondere ein geringes Long-Engagement im japanischen Yen schmälerten die Wertentwicklung, da der Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das übergewichtete Engagement im Versorgungssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor während des Berichtszeitraums schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	2,42 %	2,35 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 05. Okt. 2016)	2,25 %	2,66 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,94 %	1,43 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	1,67 %	2,25 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,40 %	0,02 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged)	(0,38 %)	(0,15 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,51 %	0,69 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jan. 2017)	1,56 %	0,98 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,14 %	(0,21 %)
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged)	0,89 %	0,59 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	2,28 %	2,07 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	2,22 %	1,67 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged)	1,55 %	1,57 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Sep. 2022)	1,53 %	3,35 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (SGD Hedged)	0,80 %	2,47 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Low Duration Real Return Fund versucht, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung eine höchstmögliche reale Rendite zu erzielen, indem er mindestens 70 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus inflationsgekoppelten Rentenpapieren unterschiedlicher Laufzeiten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, welche von Regierungen, ihren Vertretungen oder Behörden und Unternehmen ausgegeben wurden. Inflationsindexierte Anleihen sind festverzinsliche Wertpapiere, die so strukturiert sind, dass sie Schutz vor Inflation bieten. Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das untergewichtete Engagement in deutschen nominalen Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die deutschen nominalen Renditen stiegen.
- » Das Engagement in verbrieften Vermögenswerten, einschließlich Collateralised Loan Obligations („CLO“) und Non-Agency Residential Mortgage Backed Securities („RMBS“), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads in diesen Sektoren auf breiter Basis verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in der Breakeven-Inflation in den USA und Japan trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Breakeven-Inflation in den USA und Japan stieg.
- » Die Titelauswahl in inflationsgebundenen Anleihen der Eurozone und insbesondere ein Engagement in italienischen BTP-Anleihen beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Kurse dieser Wertpapiere fielen.
- » Das übergewichtete Engagement in britischen und australischen nominalen Staatsanleihen, insbesondere in den letzten drei Monaten des Berichtszeitraums, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen im Vereinigten Königreich und in Australien stiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	(0,09 %)	4,01 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(0,11 %)	3,66 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2004)	(0,28 %)	3,49 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	(0,24 %)	3,87 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2004)	(0,34 %)	3,23 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(0,52 %)	2,87 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(0,60 %)	2,78 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2004)	(0,23 %)	3,81 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,24 %)	1,85 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	(0,74 %)	3,76 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017)	(1,55 %)	0,25 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Unhedged Index	(2,22 %)	(0,11 %)
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2008)	(2,20 %)	1,60 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(2,05 %)	(0,11 %)
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	(2,29 %)	1,97 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index	(2,81 %)	1,24 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	(0,86 %)	2,98 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(0,84 %)	2,54 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2004)	(1,10 %)	2,51 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(1,33 %)	1,78 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond EUR Hedged Index	(1,55 %)	2,68 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	(0,16 %)	3,95 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Apr. 2005)	(0,15 %)	3,52 %
Class R GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,35 %)	1,19 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index	(0,89 %)	3,72 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Feb. 2008)	(0,98 %)	2,99 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index	(1,64 %)	2,78 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Real Return Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Realrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus inflationsgekoppelten Rentenpapieren unterschiedlicher Laufzeiten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, welche von Regierungen, ihren Vertretungen oder Behörden und Unternehmen ausgegeben wurden. Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das untergewichtete Engagement in deutschen nominalen Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die deutschen nominalen Renditen stiegen.
- » Das Engagement in verbrieften Vermögenswerten, einschließlich Collateralised Loan Obligations („CLO“) und Non-Agency Residential Mortgage Backed Securities („RMBS“), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads in diesen Sektoren auf breiter Basis verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in der Breakeven-Inflation in den USA und Japan trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Breakeven-Inflation in den USA und Japan stieg.
- » Die Titelauswahl in inflationsgebundenen Anleihen der Eurozone und insbesondere ein Engagement in italienischen BTP-Anleihen beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Kurse dieser Wertpapiere fielen.
- » Das übergewichtete Engagement in britischen und australischen nominalen Staatsanleihen, insbesondere in den letzten drei Monaten des Berichtszeitraums, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen im Vereinigten Königreich und in Australien stiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,92 %	4,95 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,88 %	4,95 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2015)	1,73 %	3,74 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2013)	1,73 %	3,84 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 13. Feb. 2017)	1,63 %	3,07 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,63 %	4,43 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,48 %	4,01 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,46 %	4,01 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2018)	1,83 %	3,33 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	1,81 %	3,33 %
Class R, thesaurierend (Auflegung 07. Nov. 2019)	1,81 %	2,55 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2015)	1,82 %	3,67 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	1,26 %	2,63 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	1,24 %	2,64 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,20 %	5,51 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index	(0,71 %)	1,31 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jan. 2018)	1,33 %	2,11 %
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2023)	1,27 %	5,26 %
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	1,09 %	2,04 %
Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	1,04 %	2,76 %
Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Feb. 2017)	0,90 %	1,82 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Okt. 2015)	1,63 %	4,08 %
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	(1,35 %)	0,74 % <sup>2</sup>
<b>Auf BRL lautende Klassen</b>		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Feb. 2016)	(9,45 %)	5,38 %
Bloomberg Global Aggregate (BRL Hedged) Index	1,69 %	7,39 %
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Apr. 2016)	1,59 %	3,61 %
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2018)	1,60 %	3,09 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index (CAD Hedged)	(1,07 %)	0,48 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Dez. 2014)	(0,17 %)	1,49 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(0,12 %)	1,27 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(0,55 %)	0,84 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(0,58 %)	0,85 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(2,75 %)	(0,97 %) <sup>2</sup>
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Institutional RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2023)	0,84 %	2,80 %
Investor RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2018)	0,67 %	3,16 %
Class E RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung 22. Mai 2013)	0,39 %	4,52 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CNH Hedged) Index	(1,75 %)	2,96 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,11 %	3,33 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,17 %	3,32 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	1,19 %	2,13 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2015)	0,96 %	1,57 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Income Fund ist bestrebt, unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung hohe laufende Erträge zu erzielen, wobei das sekundäre Ziel der langfristige Kapitalzuwachs ist. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement im Bargeldzinssatz in den USA trug durch den Carry zur Wertentwicklung bei, da die Bargeldzinssätze in den USA positiv blieben.
- » Das Long-Engagement in Investment-Grade-Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in Hochzinsunternehmensanleihen trug durch Carry zur Wertentwicklung bei, da die Spreads auf diese Wertpapiere positiv blieben.
- » Das Long-Engagement in Non-Agency Mortgage-Backed Securities trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads für diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement im brasilianischen Real beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement in der australischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die brasilianischen Zinsen stiegen.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2015)	1,01 %	1,63 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend A (Auflegung: 16. Dez. 2015)	0,88 %	1,76 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2015)	0,88 %	1,53 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	0,91 %	1,35 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,69 %	2,40 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,70 %	2,40 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 31. Aug. 2018)	0,65 %	0,60 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)	0,74 %	0,10 %
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Aug. 2017)	0,65 %	0,10 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,00 %	1,89 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,47 %	0,79 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,52 %	0,80 %
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	(1,50 %)	(0,24 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2019)	1,80 %	2,36 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	1,83 %	3,53 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	1,53 %	1,23 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Sept. 2016)	1,47 %	2,14 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	1,30 %	1,47 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,67 %	3,94 %
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	(0,87 %)	0,69 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	1,89 %	4,13 %
Investor HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2023)	1,78 %	8,54 %
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Apr. 2017)	1,68 %	2,96 %
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Feb. 2013)	1,48 %	3,43 %
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	(0,73 %)	1,46 % <sup>2</sup>
<b>Auf JPY lautende Klassen</b>		
Institutional JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mär. 2023)	(0,88 %)	1,37 %
Institutional JPY (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2024)	—	(1,20 %)
Investor JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jun. 2023)	(1,08 %)	0,93 %
Class E JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017)	(1,44 %)	(0,58 %)
Class E JPY (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Dez. 2022)	(1,39 %)	(0,45 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index	(3,58 %)	(2,21 %) <sup>2</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2017)	1,36 %	2,16 %
Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index	(1,31 %)	(0,11 %)
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Jul. 2020)	1,10 %	2,39 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2015)	1,15 %	3,68 %
Investor SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 07. Feb. 2020)	0,86 %	1,29 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	0,90 %	2,46 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,80 %	4,08 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Feb. 2013)	0,62 %	3,01 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	(1,59 %)	1,02 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	0,98 %	0,81 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Mrz. 2023)	1,01 %	6,45 %
E Class Income (Auflegung: 29. Jan. 2021)	0,58 %	(0,06 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	(0,71 %)	(2,91 %)²
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
E Class AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	(0,08 %)	(1,19 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	(1,35 %)	(4,08 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
E Class EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	(0,27 %)	(1,93 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	(1,50 %)	(4,61 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
E Class GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	0,42 %	(0,70 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	(0,87 %)	(3,47 %)
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
E Class HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	0,60 %	0,11 %
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	(0,73 %)	(2,71 %)
<b>Auf JPY lautende Klassen</b>		
E Class JPY (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Nov. 2023)	(2,34 %)	1,28 %
Bloomberg U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index	(3,58 %)	0,93 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Income Fund II ist bestrebt, durch eine umsichtige Anlageverwaltung hohe laufende Erträge zu erzielen, wobei das sekundäre Ziel der langfristige Kapitalzuwachs ist. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Teilfonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement im US-Bargeldzinssatz trug durch den Carry zur Wertentwicklung bei, da die US-Bargeldzinssätze positiv blieben.
- » Das Long-Engagement in europäischen RMBS (residential mortgage-backed securities) trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in Hochzinsunternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement im japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement im brasilianischen Real beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement in der australischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die brasilianischen Zinsen stiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	2,20 %	1,66 %
Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 22. Mrz. 2022)	1,93 %	(1,02 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	1,83 %	0,51 %
E Class, ausschüttend II (Auflegung: 02. Aug. 2022)	1,73 %	0,45 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	2,10 %	1,13 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 02. Aug. 2022)	1,82 %	0,46 %
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (USD Hedged) <sup>3</sup>	1,44 %	1,47 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
E Class AUD (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2022)	1,76 %	(0,81 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (AUD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (AUD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (AUD Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (AUD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (AUD Hedged) <sup>3</sup>	1,51 %	(0,62 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2021)	2,46 %	(0,04 %)
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	2,00 %	(0,28 %)
Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	1,87 %	(0,29 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (EUR Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (EUR Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (EUR Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (EUR Hedged) <sup>3</sup>	1,61 %	0,88 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Mai 2014)	2,34 %	2,02 %
E Class GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2022)	1,75 %	(0,68 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (GBP Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (GBP Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (GBP Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (GBP Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (GBP Hedged) <sup>3</sup>	1,55 %	1,72 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 22. Feb. 2022)	1,98 %	(0,55 %)
E Class SGD (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2022)	1,76 %	(0,79 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (SGD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (SGD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (SGD Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (SGD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (SGD Hedged) <sup>3</sup>	1,52 %	(1,61 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Inflation Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 31. März 2017: 45 % Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Partial Hedged), 30 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD), 15 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % Bloomberg Gold Total Return Index; 01. April 2017 bis 12. April 2022: 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return; seit dem 13. April 2022: 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (USD Hedged)

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Inflation Multi-Asset Fund beabsichtigt, den realen Kapitalwert mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu erhalten. Der Fonds wird aktiv verwaltet und legt primär in ein diversifiziertes Portfolio an, das aus inflationsgekoppelten Anlagen besteht. Der Fonds ist bestrebt, sein Anlageziel durch eine Kombination aus globalen inflationsgekoppelten Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert), Schwellenmarktanleihen und -währungen, Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren sowie mit Rohstoffen und dem Immobiliensektor zusammenhängenden Instrumenten zu erreichen. Engagements in solchen Anlagen können durch direkte Anlagen oder die Verwendung von Finanzderivaten erreicht werden, wie im Verkaufsprospekt näher erläutert. Der Fonds verfolgt in Übereinstimmung mit seinen Anlagerichtlinien eine Multi-Asset-Anlagestrategie. Das Ziel der Strategie besteht darin, im Laufe der Zeit den Erhalt des Realkapitals zu erreichen, indem die Allokation zu verschiedenen inflationsgekoppelten Anlageklassen durchgeführt wird. Im Rahmen dieser Anlagestrategie wird die Anlageberatungsgesellschaft eine globale Prognose für Zinsen und Inflationsraten für die verschiedensten Volkswirtschaften sowie einen integrierten Anlageprozess, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, verwenden.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Aktive Rohstoffstrategien, einschließlich einer Übergewichtung des Engagements im Teilssektor Erdöl und einer Untergewichtung des Engagements in den Teilssektoren Erdgas und Getreide, waren der relativen Wertentwicklung zuträglich, da der Teilssektor Erdöl positive Renditen erzielte, während Erdgas und Getreide negative Renditen verbuchten.
- » Das untergewichtete Engagement in deutschen nominalen Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die deutschen nominalen Renditen stiegen.
- » Das übergewichtete Engagement in der Breakeven-Inflation in den USA und Japan trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Breakeven-Inflation in den USA und Japan stieg.
- » Das Engagement in Non-Agency und U.S. Agency Mortgage-Backed Securities (MBS) war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads von Non-Agency MBS verengten, während Agency MBS durch Carry einen positiven Beitrag leisteten.
- » Die Untergewichtung des Engagements in den Chinesischen Yuan (CNY), den Südkoreanischen Won (KRW) und den Neuen Taiwan-Dollar (TWD) sowie anderer asiatischer Währungen und die Übergewichtung des US-Dollars (USD) trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da der USD an Wert zulegte.
- » Die taktische untergewichtete Allokation von Gold schmälerte die relative Wertentwicklung, da Gold positive Renditen verzeichnete.
- » Das übergewichtete Engagement in US-, japanischen und australischen Zinssätzen beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Die Titelauswahl bei Immobilienwerten aus Industrieländern schmälerte die relative Wertentwicklung.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	1,59 %	2,39 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	1,64 %	2,39 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2004)	1,44 %	2,08 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 03. Jul. 2003)	1,46 %	1,97 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2004)	1,28 %	1,89 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	1,12 %	1,30 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	1,19 %	1,56 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Nov. 2009)	1,47 %	1,51 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	1,44 %	1,35 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,46 %	0,91 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index	1,24 %	1,86 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2012)	0,90 %	0,06 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	0,85 %	1,43 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jul. 2009)	0,37 %	(0,18 %)
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (EUR Hedged)	0,47 %	0,83 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	1,47 %	0,42 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2010)	1,52 %	1,20 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (GBP Hedged)	1,11 %	0,70 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Average Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das übergewichtete Engagement in ausgewählten verbrieften Schuldtiteln, insbesondere besicherten Darlehensobligationen („CLOs“), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Auswahl bei Agency Mortgage-Backed Securities („MBS“) war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da die positiven Beiträge aus den Erträgen die negativen Beiträge durch die Ausweitung der Spreads ausglich.
- » Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating, insbesondere Finanztitel, begünstigten die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement im japanischen Yen gegenüber dem US-Dollar schmälerte die relative Wertentwicklung insbesondere im 1. Quartal 2024, da der japanische Yen an Wert verlor.
- » Die Auswahl bei kurzfristigen brasilianischen Staatsanleihen schmälerte die relative Wertentwicklung.
- » Ein Long-Engagement im brasilianischen Real gegenüber dem US-Dollar schmälerte die relative Wertentwicklung, da der brasilianische Real an Wert verlor.

## Gesamterrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	1,63 %	2,16 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2021)	1,72 %	0,61 %
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	1,65 %	2,16 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	0,96 %	0,53 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)	0,96 %	(1,17 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	0,42 %	(0,38 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged)	0,89 %	0,50 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	1,57 %	1,49 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)	1,54 %	0,05 %
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged)	1,52 %	1,47 % <sup>2</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2017)	1,20 %	1,02 %
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (NOK Hedged)	1,15 %	1,20 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Aug. 2023)	0,89 %	4,70 %
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (SEK Hedged)	0,84 %	4,32 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Unternehmens-Rentenpapieren mit Investment Grade-Qualität (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein untergewichtetes Engagement im regierungsnahen Sektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor auf Basis der Überschussrendite schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Die Titelauswahl im Banken- und Maklersektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Outperformance verzeichnete.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Sektor der Immobilieninvestmentgesellschaften (REIT) trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor und ein ausgewählter übergewichteter Emittent eine Outperformance aufwiesen.
- » Durationsstrategien und insbesondere das übergewichtete Engagement in der Euro-Duration schmälerten die Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.
- » Die Titelauswahl im Versorgersektor schmälerte die Wertentwicklung, da sich ausgewählte übergewichtete Emittenten unterdurchschnittlich entwickelten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,14 %	3,27 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,10 %	3,26 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	2,67 %	2,38 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Sep. 2018)	2,71 %	2,40 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung 03. Sep. 2020)	3,11 %	3,15 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Jan. 2022)	3,01 %	2,94 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index	1,41 %	1,69 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2023)	1,15 %	5,20 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (CHF Hedged)	(0,61 %)	1,03 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	2,38 %	1,23 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2021)	2,31 %	1,04 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Jan. 2024)	—	1,90 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,90 %	0,34 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,96 %	0,34 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (EUR Hedged)	0,65 %	(0,26 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	2,96 %	2,30 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,05 %	2,29 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (GBP Hedged)	1,29 %	0,87 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Okt. 2020)	2,32 %	2,70 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2024)	—	(0,10 %)
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (SGD Hedged)	0,55 %	(0,10 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Income Fund strebt unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung attraktive Erträge an. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement im US-Bargeldzinssatz trug durch den Carry zur Wertentwicklung bei, da die US-Bargeldzinssätze positiv blieben.
- » Das Long-Engagement in Hochzinsunternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in Hochzinsunternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in CMBS (Commercial Mortgage-Backed Securities) trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement im japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement in der mexikanischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die mexikanischen Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement im brasilianischen Real schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	3,41 %	2,32 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)	3,40 %	1,82 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021)	3,62 %	1,07 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>	2,73 %	1,91 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	2,59 %	0,36 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Apr. 2018)	2,58 %	0,01 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2018)	2,53 %	(0,43 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017)	2,28 %	(0,87 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>4</sup>	1,98 %	0,32 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	3,30 %	1,43 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	3,32 %	1,16 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>5</sup>	2,66 %	1,31 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1 Month USD LIBOR Index; seit dem 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; seit dem 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index

<sup>5</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; seit dem 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Opportunities Fund ist bestrebt, einen höchstmöglichen langfristigen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) unterschiedlicher Fälligkeiten anlegt. Der Fonds strebt Renditen an, die mittel- bis langfristig den ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (ein Maß der Rendite von Geldmarktpapieren) übersteigen. Hierfür investiert er auf Basis der Beurteilung globaler festverzinslicher Anlagen durch die Anlageberatungsgesellschaft flexibel in eine Vielzahl festverzinslicher Anlagen.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement im Bargeldzinssatz in den USA trug durch den Carry zur Wertentwicklung bei, da die Bargeldzinssätze in den USA positiv blieben.
- » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in Non-Agency Mortgage-Backed Securities trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads für diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement in der australischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die australischen Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement im japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da dieser gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	2,01 %	3,37 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	2,05 %	3,37 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	2,73 %	4,83 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,29 %	1,24 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,34 %	1,23 %
Euro Short-Term Rate (ESTER)	1,97 %	2,91 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,84 %	2,67 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,90 %	2,70 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	2,66 %	4,40 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Opportunities ESG Fund ist bestrebt, die maximal mögliche langfristige Rendite bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erzielen. Der Fonds verfolgt dieses Anlageziel, indem er unter normalen Bedingungen mindestens zwei Drittel des Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Anlagen mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Die durchschnittliche Portfolioduration dieses Fonds bewegt sich normalerweise zwischen 1 negativen bis 5 positiven Jahren, je nach der Prognose der Anlageverwaltungsgesellschaften für den Zinssatz. Der Fonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen ökologische und soziale Merkmale zu bewerben (wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt) und einen Teil des Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement im Bargeldzinssatz in den USA trug durch den Carry zur Wertentwicklung bei, da die Bargeldzinssätze in den USA positiv blieben.
- » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in US Treasury Inflation-Protected Securities trug zur Wertentwicklung bei, da die Breakeven-Inflationsraten stiegen.
- » Das Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement in der australischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die australischen Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement im japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da dieser gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	18,67 %	3,41 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	18,57 %	3,40 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	18,12 %	2,23 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	19,23 %	11,98 %
Alerian MLP Index	17,71 %	2,13 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	17,79 %	1,37 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	17,65 %	1,38 %
Alerian MLP Index EUR (Hedged)	17,00 %	0,37 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	18,41 %	1,71 %
Alerian MLP Index GBP (Hedged)	17,66 %	0,62 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Die vom Fonds angestrebte „Gesamtrendite“ Besteht aus Ertrag und Kapitalzuwachs. Der Fonds ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er unter normalen Umständen zwei Drittel seines Nettovermögens entweder direkt oder indirekt in ein Portfolio aus Aktien anlegt, die verbunden sind mit (i) börsengehandelten Partnerships, die auch als Master Limited Partnerships („MLPs“) bezeichnet werden, (ii) den General Partners, die Eigentümer oder Manager von MLPs sind, (iii) Spin-Offs (Unternehmen, die nach Beteiligungsverkäufen oder Umstrukturierungen von den MLPs oder General Partner ausgegliedert werden) von MLPs, (iv) Unternehmen, die aufgrund dessen, dass sie in derselben Industrie tätig sind oder mit MLPs konkurrieren, MLPs ähnlich sind, (v) andere juristische Person, die ggf. nicht als börsengehandelte Partnership strukturiert sind, jedoch im Midstream-Energiesektor tätig sind (die Transportkomponente des Energieinfrastruktursektors wie Pipelines, Bahn und Öl sowie Öltanker) und (vi) Zweckgesellschaften (d. h. juristische Personen, die für einen bestimmten Zweck errichtet wurden, die ggf. als Anlagevehikel verwendet werden, um Zugang zu hier beschriebenen Anlagen zu erlangen). Der Fonds kann in diese Instrumente entweder auf dem Sekundärmarkt oder während einer Neuemission anlegen.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung von Midstream-Energiewerten, gemessen am Alerian MLP Total Return Index, schmälerte die relativen Renditen, da der Index positive Renditen verzeichnete.
- » Die Untergewichtung von Marketing- und Vertriebsunternehmen trug zu den relativen Renditen bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der breite Index.
- » Die Titelauswahl im Erfassungs- und Verarbeitungssektor trug zu den relativen Renditen bei, da die Positionen des Fonds in diesem Sektor besser abschnitten als die Positionen des breiten Index.
- » Die Untergewichtung von Unternehmen im Bereich Komprimierung trug zu den relativen Renditen bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der breite Index.
- » Die Übergewichtung des Sektors Erdgasbeförderung in Pipelines trug zu den relativen Renditen bei, da der Sektor den breiten Index übertraf. Die Titelauswahl im Sektor schmälerte jedoch die Wertentwicklung, da die Positionen des Fonds in diesem Sektor hinter den Positionen im breiten Index zurückblieben.
- » Die Untergewichtung des Sektors Erdölförderung in Pipelines belastete die relativen Renditen, da der Sektor den breiten Index übertraf.
- » Das Engagement in anderen Aktien schmälerte die relativen Renditen, da die anderen Aktien schlechter abschnitten als der breite Index.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,87 %	2,28 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,86 %	2,29 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2017)	2,73 %	1,70 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,71 %	1,93 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,41 %	1,37 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,51 %	1,38 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mai 2020)	2,75 %	2,00 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 02. Okt. 2023)	2,80 %	6,91 %
Z Class, thesaurierend (Auflegung: 14. Jul. 2022)	3,23 %	4,66 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>	2,73 %	2,24 % <sup>2</sup>
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Jun. 2021)	2,54 %	0,32 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CAD Hedged) <sup>3</sup>	2,45 %	2,78 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,83 %	(0,45 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CHF Hedged) <sup>3</sup>	0,70 %	(0,50 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,10 %	0,29 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,03 %	0,28 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,70 %	(0,60 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	1,96 %	0,27 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,79 %	1,37 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,63 %	1,36 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	2,61 %	1,36 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Mortgage Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR Index; seit dem 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Mortgage Opportunities Fund beabsichtigt, einen höchstmöglichen langfristigen Ertrag bei gleichzeitiger umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Nettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus mit Hypotheken verbundenen festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) investiert, zu denen unter anderem Agency- und Non-Agency-RMBS und CMBS sowie Wertpapiere zur Übertragung von Kreditrisiken zählen können.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement in vorrangigen Non-Agency Residential Mortgage-Backed Securities (RMBS) kam der Wertentwicklung zugute, da sich die Spreads verengten.
- » Das Engagement in strukturierten Agency-Mortgage-Backed-Securities (MBS) trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor positive Renditen verzeichnete.
- » Die Relative-Value-Strategien für Agency-MBS trugen zur Wertentwicklung bei, da höhere Kupons besser abschnitten als niedrigere Kupons.
- » Ein positives Durationsengagement, insbesondere in der Mitte der US-Renditekurve, beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Das Engagement in einer ausgewählten Collateralised Loan Obligation (CLO) beeinträchtigte die Wertentwicklung, da ein ausgewählter Titel sich unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Es gab keine weiteren wesentlichen Verlustbringer für diesen Fonds.

**Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>**

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	15,41 %	7,82 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2001)	15,41 %	9,08 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Jan. 1999)	15,21 %	7,33 %
BE Retail, thesaurierend (Auflegung: 28. Apr. 2022)	15,02 %	10,12 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	14,88 %	9,38 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	15,33 %	12,58 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	15,05 %	7,40 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	14,53 %	11,90 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2017)	14,02 %	9,49 %
S&P (EUR Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	14,19 %	11,52 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Mai 2024)	—	5,20 %
S&P (EUR Unhedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	18,58 %	5,27 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

**Anlageziel und Überblick über die Strategie**

Der StocksPLUS™ Fund ist bestrebt, eine bessere Rendite als die Entwicklung der Gesamtrendite von Standard & Poor's 500 Composite Stock Price Index („S&P 500“) zu erzielen. Dazu wendet der Fonds eine gesellschaftseigene Portfolioverwaltungsstrategie an, die ein aktiv verwaltetes Portfolio festverzinslicher Wertpapiere (wie im Verkaufsprospekt angegeben) mit einem Engagement in den S&P 500 verbindet. Der Fonds darf unbeschränkt in Aktien und Wertpapiere anlegen, die sich in Aktien wandeln lassen.

**Kommentare zum Fonds**

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement des Fonds in mit dem S&P 500 Index verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 Net Total Return Index eine Rendite in Höhe von 15,05 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihestrategie des Fonds trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
  - » Bestände an nicht hypothekenbesicherten Wertpapieren trugen zur Rendite bei, da sich die Spreads verengten.
  - » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Rendite bei, da sich die Spreads verengten.
  - » Das Long-Engagement in US-Zinssätzen schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinssätze anstiegen.
  - » Keine weiteren nennenswerten Verlustbringer.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019)	15,44 %	14,79 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	15,05 %	14,61 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er die unternehmenseigene Portfoliomanagementstrategie der Anlageberatungsgesellschaft verfolgt, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (sie kombiniert ein aktiv verwaltetes, aus Renteninstrumenten bestehendes Portfolio mit Engagements in Aktienwerten). Renteninstrumente sind Darlehen ähnlich und zahlen feste oder variable Zinsen.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement des Fonds in mit dem S&P 500 Index verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 Net Total Return Index eine Rendite in Höhe von 15,05 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihestrategie des Fonds trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
  - » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Rendite bei, da sich die Spreads verengten.
  - » Bestände an nicht hypothekenbesicherten Wertpapieren trugen zur Rendite bei, da sich die Spreads verengten.
  - » Das Long-Engagement in US-Zinssätzen schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinssätze anstiegen.
  - » Das Long-Engagement in australischen Zinssätzen schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	3,57 %	3,97 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	3,11 %	3,87 %
Class E, ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	3,08 %	3,87 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index <sup>3</sup>	0,47 %	3,63 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	3,57 %	3,40 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	3,11 %	2,46 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	3,09 %	2,46 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	2,87 %	1,41 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	2,88 %	1,42 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (EUR Hedged)/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	0,39 %	2,27 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jul. 2022)	4,15 %	6,19 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (GBP Hedged)/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	1,03 %	0,89 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Strategic Income Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 26. Juli 2016: 75 % Bloomberg Global Aggregate Index Hedged USD/25 % MSCI All Country World Index; 27. Juli 2016 bis 28. Juli 2022: 75 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index; seit dem 29. Juli 2022: 75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Strategic Income Fund strebt unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung attraktive laufende Erträge an. Das sekundäre Anlageziel besteht im langfristigen Kapitalzuwachs. Der Fonds verwendet eine globale Multi-Sektor-Strategie, mit der der Gesamtrendite-Anlageprozess und die Philosophie der Anlageverwaltungsgesellschaften mit der Ertragsmaximierung kombiniert werden sollen. Die Portfoliokonstruktion beruht auf dem Prinzip der Diversifizierung in die verschiedensten internationalen Renten- und Aktienwerte.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in US-Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.
- » Das Long-Engagement in europäischen Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.
- » Das Long-Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen trug zur Rendite bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in der US-Duration schmälerte die Rendite, da die US-Renditen stiegen.
- » Das Long-Engagement im japanischen Yen (JPY) schmälerte die Wertentwicklung, da der JPY gegenüber dem US-Dollar (USD) an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement in US-Agency-MBS schmälerte die Rendite, da die US-Renditen stiegen.

## Total Return Bond Fund

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 1998)	0,42 %	4,35 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2000)	0,42 %	4,33 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Jan. 1999)	0,25 %	3,80 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2000)	0,20 %	3,76 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2003)	0,18 %	2,93 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2022)	0,23 %	0,88 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(0,04 %)	2,66 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	(0,03 %)	2,57 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	0,34 %	3,55 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	0,32 %	1,01 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(0,10 %)	0,26 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index	(0,71 %)	3,89 % <sup>2</sup>
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Mai 2013)	0,09 %	1,08 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CAD Hedged) Index	(1,07 %)	1,09 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	(1,71 %)	(0,16 %)
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	(1,78 %)	(0,51 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Sept. 2012)	(2,14 %)	(1,64 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(2,75 %)	(0,28 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2003)	(0,35 %)	2,48 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(0,31 %)	2,39 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2004)	(0,58 %)	2,00 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2009)	(0,63 %)	0,73 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(0,82 %)	1,57 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	(0,80 %)	(0,62 %)
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,42 %)	(0,44 %)
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(1,03 %)	(1,45 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	(1,50 %)	2,00 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2002)	3,53 %	3,13 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index (EUR Unhedged) Index	2,34 %	2,74 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Mrz. 2010)	0,23 %	1,82 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	0,34 %	3,25 %
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	(0,87 %)	2,78 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	(0,03 %)	0,56 %
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	(0,73 %)	1,47 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jan. 2011)	(0,47 %)	1,77 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Feb. 2023)	(0,72 %)	1,77 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	(0,88 %)	2,06 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	(1,59 %)	2,50 % <sup>2</sup>

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Total Return Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die taktische Positionierung in der US-Kurve, einschließlich des untergewichteten Engagements im langen Ende der Kurve, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen.
- » Das übergewichtete Engagement in vorrangigen Finanztiteln innerhalb der Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Schuldtiteln trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in der Dollarblock-Duration, vor allem in Kanada in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Das Long-Engagement in Mexiko schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Das Long-Engagement in ausgewählten lateinamerikanischen Schwellenmarktwährungen, namentlich dem brasilianischen Real und dem mexikanischen Peso, schmälerte die relative Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurden.

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(1,38 %)	2,20 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(1,55 %)	(6,26 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(1,96 %)	1,09 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	(1,54 %)	(2,13 %)
Z Class, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2021)	(0,73 %)	3,30 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>	2,73 %	1,95 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(2,15 %)	0,52 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(2,25 %)	(7,76 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Jun. 2015)	(2,67 %)	(0,58 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	1,96 %	0,26 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2022)	(1,47 %)	(3,95 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(1,46 %)	(6,18 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	2,61 %	4,48 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund repräsentiert Folgendes Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR Index; seit dem 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO TRENDS Managed Future Strategy Fund strebt positive risikobereinigte Renditen unter umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er unter normalen Umständen in Derivate auf Zinsen, Währungen, hypothekarisch besicherte Wertpapiere (wie im Verkaufsprospekt des Fonds dargestellt), Schuldtitel, Aktienindizes, volatilitätsbezogene Instrumente (einschließlich u.a. Futures auf volatilitätsbezogene Indizes) und rohstoffbezogene Instrumente (wie im Verkaufsprospekt des Fonds dargestellt) investiert.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Positionierung in einem breiten Spektrum globaler Zinsmärkte führte im Berichtszeitraum aufgrund mehrerer starker Umkehrungen zu Verlusten. Bemerkenswerte Verlustbringer waren Short-Positionen in britischen und kanadischen sowie Long-Positionen in ungarischen Zinssätzen.
- » Die Positionierung im Pfund Sterling, kolumbianischen Peso und israelischen Schekel gegenüber dem USD war aufgrund von Kursumkehrungen abträglich.
- » Long-Positionen in globalen Aktienindizes trugen in diesem Zeitraum zur Wertentwicklung bei, da die Kurse stiegen. Zu den bemerkenswerten Treibern der Wertentwicklung gehörten Long-Engagements in japanischen, taiwanesischen und europäischen Aktienindizes.
- » Long-Positionen in Kakao und Kaffee trugen zur Wertentwicklung bei, da die Preise stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2007)	(0,10 %)	4,18 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2016)	(0,03 %)	0,74 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2019)	0,11 %	(1,52 %)
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	(0,08 %)	3,95 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der UK Corporate Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds legt mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf GBP lautenden festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten an. Dabei handelt es sich um direkte Beteiligungen an festverzinslichen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder derivativen Instrumenten, wie insbesondere Optionen, Futures, Swaps oder Credit Default Swaps.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das übergewichtete Engagement in Immobilieninvestmentgesellschaften (REITs) trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor eine Outperformance erzielte.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Banken- und Maklersektor trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor und ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Outperformance erzielten.
- » Das untergewichtete Engagement in staatlichen Sektoren, insbesondere in supranationalen Körperschaften, trug zur Wertentwicklung bei, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Durationsstrategien und insbesondere das übergewichtete Engagement in der GBP-Duration schmälerten die Wertentwicklung, da die Zinssätze im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Die Titelauswahl im Versicherungssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da ein ausgewählter untergewichteter Emittent eine Outperformance erzielte.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	(3,07 %)	3,95 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Aug. 2008)	(3,07 %)	4,84 %
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index <sup>3</sup>	(2,74 %)	3,60 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den UK Long Term Corporate Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis zum 30. März 2013: Markt iBoxx Sterling Non-Gilts 10+ Index; seit dem 31. März 2013: ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der UK Long Term Corporate Bond Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Pfund Sterling lautenden Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Banken- und Maklersektor trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor und das Engagement in ausgewählten Emittenten eine Outperformance erzielten.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Restaurantsektor trugen zur Wertentwicklung bei, da sowohl der Sektor als auch das Engagement in einem ausgewählten britischen Pub-Unternehmen eine Outperformance erzielten.
- » Das fehlende Engagement im Tabaksektor schmälerte die Wertentwicklung, da dieser Sektor eine Outperformance erzielte.
- » Das untergewichtete Engagement in staatlichen Sektoren, insbesondere in ausländischen Staatsanleihen, beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor eine Outperformance erzielte.
- » Die Titelauswahl im Transportsektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da ein ausgewählter untergewichteter Emittent eine Outperformance erzielte.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Mai 1998)	2,82 %	5,61 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	2,84 %	5,93 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 1999)	2,64 %	5,26 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 14. Jan. 1999)	2,58 %	5,24 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,35 %	4,43 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	2,30 %	4,50 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	2,74 %	6,61 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	2,75 %	2,24 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 11. Jan. 2012)	2,26 %	4,25 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,70 %	4,35 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 29. Jun. 2016)	3,07 %	5,28 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index <sup>3</sup>	2,62 %	5,82 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	2,03 %	4,93 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	1,97 %	4,22 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Feb. 2003)	1,85 %	4,84 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,56 %	3,24 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	1,83 %	5,58 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	2,72 %	5,58 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	2,70 %	3,45 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	2,49 %	6,05 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den US High Yield Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 31. März 2015: ICE BofA Merrill Lynch US High Yield, BB-B Rated, Constrained Index; seit dem 01. April 2015: ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US High Yield Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtnettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hoch verzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die von Moody's mit Baa oder von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl innerhalb des Papier- und Verpackungsektors trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter untergewichteter Emittent sich unterdurchschnittlich entwickelte, während ausgewählte übergewichtete Emittenten besser abschnitten als der Gesamtmarkt.
- » Die Titelauswahl innerhalb des Kabel- und Satellitentelekommunikationssektors trug zur Wertentwicklung bei, da sich ein ausgewählter untergewichteter Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl innerhalb des drahtgebundenen Telekommunikationssektors trug zur Wertentwicklung bei, da sich ein ausgewählter untergewichteter Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im drahtlosen Telekommunikationssektor schmälerte die Wertentwicklung, da sich ein ausgewählter übergewichteter Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Einzelhandelssektor beeinträchtigten die Wertentwicklung, da der Sektor sowie ein ausgewählter untergewichteter Emittent eine bessere Wertentwicklung als der Gesamtmarkt erzielten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	0,44 %	1,84 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	0,56 %	1,86 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	0,00 %	(1,32 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	0,03 %	0,41 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	0,38 %	3,20 %
Bloomberg U.S. Credit Index	(0,46 %)	1,74 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	(0,31 %)	(0,30 %)
Bloomberg U.S. Credit Index (EUR Hedged)	(1,25 %)	(0,44 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 15. Sep. 2016)	0,32 %	0,70 %
Bloomberg U.S. Credit Index (GBP Hedged)	(0,62 %)	0,61 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US Investment Grade Corporate Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein breit gefächertes Portfolio von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit Investment Grade (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Diese enthalten Beteiligungen an kreditnahen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder derivativen Instrumenten, wie Optionen, Terminkontrakte oder Credit Default Swaps, wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Banken- und Maklersektor trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor und ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Outperformance erzielten.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl innerhalb des Sektors für sonstige Finanzwerte trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor überdurchschnittlich abschnitt, während ein ausgewählter untergewichteter Emittent eine Unterperformance erzielte.
- » Die Titelauswahl im Transportsektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Outperformance verzeichneten.
- » Ein untergewichtetes Engagement im regierungsnahen Sektor schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor auf Basis der Überschussrendite besser abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Durationsstrategien beeinträchtigten die Wertentwicklung, insbesondere taktische Engagements in lokalen Schwellenmarkt-Zinssätzen, die sich unterdurchschnittlich entwickelten, da die Zinsen stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	3,24 %	2,18 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 11. Mrz. 2020)	3,20 %	2,62 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	3,10 %	1,83 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	3,02 %	1,79 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	3,18 %	2,33 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 07. Aug. 2014)	3,42 %	2,66 %
FTSE 3-Month Treasury Bill Index	2,76 %	1,53 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	2,43 %	0,63 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Jun. 2016)	2,23 %	0,12 %
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)	1,86 %	(0,10 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2023)	3,10 %	6,16 %
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (GBP Hedged)	2,52 %	5,12 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US Short-Term Fund ist bestrebt, bei Kapitalerhaltung und täglicher Liquidität höchstmögliche laufende Erträge zu erzielen. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten, die von Organisationen des öffentlichen und privaten Sektors in den USA und außerhalb der USA ausgegeben werden. Die durchschnittliche Duration des Portfolios dieses Fonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaften. Es wird nicht davon ausgegangen, dass sie länger als ein Jahr ist. Der Fonds wird seine Wertentwicklung auf einen Vergleichszinssatz des FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index beziehen. Bei dem FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Untergewichtung der US-Duration, insbesondere im 3-Jahres-Teil der Kurve, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze stiegen.
- » Das übergewichtete Engagement in Investment-Grade-Unternehmensanleihen, insbesondere in Finanz- und Industrierwerten, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads für Unternehmensanleihen verengten.
- » Das übergewichtete Engagement in Collateralized Loan Obligations war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Es gab keine wesentlichen Nachzügler in diesem Fonds.

## Beschreibungen der Vergleichsindizes

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
1 Month NIBOR Rate Index	Der 1 Month NIBOR (Norwegian Interbank Offered Rate) Index ist ein durchschnittlicher Zinssatz, der von der Norges Bank bestimmt wird. Er leitet sich vom Zinssatz eines vergleichbaren Darlehens am US-Dollarmarkt zuzüglich des Zinssatzdifferentials zwischen der norwegischen Krone und dem US-Dollar am Devisenterminmarkt ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index, JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified; alle abgesichert in USD	Der Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Rentenmärkte von Industrieländern. Der ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einem Rating unter Investment Grade nach, die in Industrieländern ansässig sind und ein Rating von BB1 bis B3 aufweisen, basierend auf einem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch. Der Index passt die Wertpapiergewichtungen an, um die Gesamtrisikoscores für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) des Index aufzuwerten. Der JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified bildet die Gesamtrenditen von auf US-Dollar lautenden Schuldsinstrumenten nach, die von staatlichen und quasi-staatlichen Emittenten aus Schwellenländern begeben werden und die Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungsfaktoren in den Indexaufbau einbeziehen.
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged)	Der Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (USD Hedged) bietet ein weites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Rentenmärkte von Industrieländern. ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieländern nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Verbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index beinhaltet auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautenden Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P, sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2%-Deckelung entsprechend proportional. Vor dem 25. September 2009 waren die ICE BofA Merrill Lynch-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt. Der JPMorgan EMBI Global (USD Hedged) bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldsinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbrieft Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
3 Month HIBOR Index	Der 3 Month HIBOR (Hong Kong Interbank Offered Rate) Index ist ein Referenzzinssatz, der den durchschnittlichen Zinssatz abbildet, zu dem eine Reihe von Banken, die von der Hong Kong Association of Banks bestimmt wurden, bereit sind, sich untereinander unbesicherte Kredite zu verschiedenen Laufzeiten zu gewähren.
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (USD Hedged)	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (USD Hedged). Mit dem Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index wird die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen aus Industrieländern gemessen. Er ist nach Marktkapitalisierung gewichtet und umfasst Laufzeiten bis zu 30 Jahren. Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 24 Schwellenmarktländern nach. Der Bloomberg Commodity Total Return Index spiegelt die Rendite vollständig besicherter Positionen in den zugrundeliegenden Rohstoffterminkontrakten einiger physischer Rohstoffe wider. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. Der FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der darauf ausgelegt ist, die Wertentwicklung börsennotierter Immobilienunternehmen weltweit abzubilden. Der Bloomberg Gold Subindex Total Return Index spiegelt die Rendite vollständig besicherter Positionen in den zugrundeliegenden Rohstoffterminkontrakten wider. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht anlegen.
50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged)	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 50 % JPMorgan EMBI Global Index/50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged). Der JPMorgan EMBI Global Index bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldsinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbrieft Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen und Eurobonds. Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (USD Hedged)	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 60 % MSCI All Country World Index (ACWI) und 40 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond (USD Hedged) Index. Der MSCI All Country World Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der zur Messung Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrie- und Schwellenländern gedacht ist. Der Index besteht aus 47 Länderindizes, von denen 23 Indizes von Industrieländern und 23 Indizes von Schwellenländern sind. Der Bloomberg U.S. Aggregate Bond (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

## Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index	Der Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf US-Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. Der MSCI ACWI High Dividend Yield Index basiert auf dem MSCI ACWI (EUR Hedged), dessen Hauptindex, und beinhaltet Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung aus 23 Industrie- und 24 Schwellenländern. Der Index soll die Wertentwicklung von Aktien im Hauptindex (mit Ausnahme von REIT) mit höheren Dividendenrenditen und Qualitätsmerkmalen als durchschnittliche Dividendenrenditen widerspiegeln, die sowohl nachhaltig als auch beständig sind. Im Index gibt es auch Qualitätsprüfungen; er prüft die Wertentwicklung der letzten 12 Monate, um Aktien mit sich möglicherweise verschlechternden Fundamentaldaten auszulassen, die ihn zwingen könnten, Dividenden zu kürzen oder zu senken.
Alerian MLP Index	Der Alerian MLP Index ist der führende Maßstab für Master Limited Partnership (MLPs) aus dem Energiesektor mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung. Es handelt sich um einen um Streubesitz bereinigten, marktkapitalisierungsgewichteten Index, der 50 führende Unternehmen umfasst.
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	Der Bloomberg AusBond Bank Bills Index ist ein nicht verwalteter Index, der die Gesamtertragsleistung australischer Geldmarktpapiere abbildet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Commodity Index Total Return	Der Bloomberg Commodity Index Total Return ist ein nicht verwalteter Index aus Terminkontrakten auf eine Reihe physischer Rohstoffe. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. Die Futures-Engagements der Benchmark sind durch US-Schatzwechsel besichert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Euro-Aggregate 1-10 Year Bond Index	Der Bloomberg Euro-Aggregate 1-10 Year Bond Index repräsentiert die Komponente Euro-Aggregate 1-10 Year des Bloomberg Pan-European Aggregate Index. Der Bloomberg Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	Der Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index ist die Anleihekomponekte des Bloomberg Euro-Aggregate Index. Der Bloomberg Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) + 15 Jahre Index	Der Bloomberg Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) + 15 Jahre Index repräsentiert Staatsanleihen aus Deutschland, Frankreich und den Niederlanden mit einer Laufzeit von über 15 Jahren und ist Komponente des Bloomberg Euro-Aggregate Index. Dieser besteht wiederum aus Anleihen, die in Euro oder Altwährungen von 17 Mitgliedstaaten der Europäischen Währungsunion (EWU) begeben wurden. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen.
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	Der Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	Beim Bloomberg Global Aggregate Credit Index 1-5 Years Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht verwalteten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade mit einer Laufzeit von mindestens einem Jahr und weniger als 5 Jahren bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbrieft Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade.

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
<b>Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)</b>	Beim Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit-Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht verwalteten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatsstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- und Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index</b>	Der Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Der Index enthält auch Eurodollar- und Euro-Yen-Unternehmensanleihen, kanadische Staats-, Agency- und Unternehmenswertpapiere sowie auf USD lautende 144A-Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating.
<b>Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)</b>	Der Bloomberg MSCI Green Bond (USD Hedged) Index bietet Anlegern ein objektives und robustes Maß für den globalen Markt für festverzinsliche Wertpapiere, die zur Finanzierung von Projekten mit direktem Umweltnutzen ausgegeben werden. Es wird eine unabhängige, analysegestützte Methodik verwendet, um indexfähige grüne Anleihen zu bewerten und sicherzustellen, dass sie die etablierten Green-Bond-Prinzipien einhalten, und um die Anleihen nach der umweltfreundlichen Verwendung ihrer Erlöse zu klassifizieren. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg U.S. Aggregate Index</b>	Der Bloomberg U.S. Aggregate Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf US-Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatsstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index</b>	Der Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind, auf US-Dollar lauten und eine Laufzeit zwischen ein und drei Jahren haben. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatsstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg U.S. Credit Index</b>	Bei dem Bloomberg U.S. Credit Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der aus öffentlich begebenen Schuldverschreibungen von Unternehmen und bestimmten nicht US-amerikanischen Emittenten sowie besicherten Anleihen besteht, die bestimmten Anforderungen in Bezug auf Laufzeit, Liquidität und Qualität entsprechen. Um für den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen bei der SEC registriert sein. Dieser Index wurde zuvor als Bloomberg Credit Investment Grade Index bezeichnet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index</b>	Mit dem Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index wird die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen gemessen. Der Index umfasst von den folgenden Ländern emittierte, inflationsgekoppelte Schuldtitel: Australien, Kanada, Frankreich, Schweden, das Vereinigte Königreich und die USA. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)</b>	Bei dem Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) handelt es sich um einen Index, der die Wertentwicklung der weltweiten Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen mit einer Laufzeit von mindestens 1 Jahr und weniger als 5 Jahren misst. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)</b>	Mit dem Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) werden die Finanzierungskosten von allgemeinen Übernacht-Sicherheiten in kanadischen Dollar gemessen, wobei Staatsanleihen und Anleihen der kanadischen Regierung als Sicherheit für Pensionsgeschäfte eingesetzt werden.
<b>FTSE 3-Month Treasury Bill Index</b>	Bei dem FTSE 3-Month Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der US-Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>FTSE Euro Broad Investment- Grade Index</b>	Bei dem FTSE Euro Broad Investment Grade Index handelt es sich um einen Index des auf Euro basierenden Rentenmarkts der Kategorie Investment Grade, der institutionellen Anlegern (in Euro) zugänglich ist. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (USD Hedged)</b>	Der ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (USD Hedged) enthält alle Wertpapiere des ICE BofA Global High Yield Index (der „Hauptindex“), sofern alle Wertpapiere: 1) auf der Grundlage des Durchschnitts von Moody's, S&P und Fitch mit BB1 bis B3 bewertet sind; 2) ein Länderrisiko in entwickelten Märkten aufweisen. Industrieländer sind definiert als ein Mitglied der FX-G10, ein westeuropäisches Land oder ein Gebiet der USA oder eines westeuropäischen Landes. Zu den FX-G10 gehören alle Euro-Mitglieder, die USA, Japan, das Vereinigte Königreich, Kanada, Australien, Neuseeland, die Schweiz, Norwegen und Schweden. Die Wertpapiergewichtungen des resultierenden übergeordneten Index werden angepasst, um die Gesamtrisikobewertung des Index in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung zu verbessern.
<b>ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index</b>	Der ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index besteht aus einer einzigen Emission, die zu Beginn jedes Monats erworben und einen ganzen Monat lang gehalten wird. Am Monatsende wird diese Emission verkauft und in eine neu ausgewählte Emission angelegt. Die bei der Neugewichtung am Monatsende jeweils gewählte Emission ist der ausstehende deutsche Schatzwechsel, dessen Fälligkeitstermin am nächsten am Datum von drei Monaten nach der Neugewichtung liegt, jedoch nicht weniger als einen Monat. Um für die Auswahl berücksichtigt zu werden, muss der Schatzwechsel am oder vor dem Neugewichtungsdatum am Monatsende abgewickelt worden sein.
<b>ICE BofA 1-3 Year U.S. Treasury Index</b>	Bei dem ICE BofA 1-3 Year U.S. Treasury Index handelt es sich um einen nicht verwalteten Index, der US Treasuries (ausgenommen inflationsbesicherte Wertpapiere und STRIPS) mit mindestens 1 Milliarde USD umlaufendem Nennwert und einer Restlaufzeit bis zur endgültigen Fälligkeit von mindestens einem und weniger als drei Jahren enthält. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>ICE BofA 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)</b>	Der ICE BofA 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged) besteht aus einer einzigen Emission, die zu Beginn jedes Monats erworben und einen ganzen Monat lang gehalten wird. Am Monatsende wird diese Emission verkauft und in eine neu ausgewählte Emission angelegt. Die bei der Neugewichtung am Monatsende jeweils gewählte Emission ist der ausstehende Schatzwechsel, dessen Fälligkeitstermin am nächsten am Datum der Neugewichtung liegt, wobei er jedoch nicht mehr als drei Monate nach diesem Datum liegen darf. Um für die Wahl berücksichtigt zu werden, muss eine Emission am oder vor dem Neugewichtungsdatum am Monatsende abgewickelt worden sein. Der Index hält zwar oft den im Rahmen der jüngsten 3-Monats-Auktion ausgegebenen Schatzwechsel, es kann jedoch auch ein älterer 6-Monats-Schatzwechsel gewählt werden.

## Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
ICE BofA BB-B European Currency High Yield Constrained Index	Der ICE BofA BB-B European Currency High Yield Constrained Index ist so konzipiert, dass er die Wertentwicklung von auf EUR und GBP lautenden Unternehmensanleihen mit einem Rating unterhalb von Investment Grade abbildet, die auf den Eurobond-, GBP- oder EUR-Inlandsmärkten öffentlich begeben wurden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einem Durchschnitt aus Moody's, S&P sowie Fitch verfügen. Das Engagement gegenüber einzelnen Emittenten im Index ist auf 3 % beschränkt.
ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Währungsverbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index enthält auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautenden Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P, sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2%-Deckelung entsprechend proportional. Vor dem 25. September 2009 waren die ICE BofA Merrill Lynch-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt.
ICE BofA Sterling Non-Gilts 10+ Index	Der ICE BofA Sterling Non-Gilts 10+ Index besteht aus auf Pfund Sterling lautenden Anleihen der Kategorie Investment Grade; ausgenommen sind auf Sterling lautende, von der britischen Regierung begebene Anleihen. Alle im Index vertretenen Anleihen müssen von mindestens einer der großen Ratingagenturen als Anlagen von Investment-Grade eingestuft werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Sterling Non-Gilts Index	Der ICE BofA Sterling Non-Gilts Index bildet die Wertentwicklung von auf Pfund Sterling lautenden erstklassigen öffentlichen Schuldtiteln von Unternehmens- und quasistaatlichen Emittenten sowie Emittenten außerhalb des Vereinigten Königreichs ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA U.S. High Yield Constrained Index	Der ICE BofA U.S. High Yield Constrained Index bildet die Wertentwicklung von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade ab, die am US-Inlandsmarkt öffentlich emittiert werden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen Wertpapiere über ein Rating unterhalb von Investment Grade (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch) und ein Risikoland mit Investment Grade-Rating (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch für auf Fremdwährung lautende Staatsanleihen mit langer Laufzeit) verfügen.
ICE BofA SARON Overnight Rate Index	Der ICE BofA SARON Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SARON bis zu einer angegebenen Laufzeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert mit genau der angegebenen Laufzeit und einem Kupon in Höhe des Fixing-Kurses dieses Tages. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird.
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	Der ICE BofA SOFR Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SOFR bis zu einer angegebenen Laufzeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert mit genau der angegebenen Laufzeit und einem Kupon in Höhe des Fixing-Kurses dieses Tages. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	Der ICE BofA SONIA Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SONIA bis zu einer angegebenen Laufzeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert mit genau der angegebenen Laufzeit und einem Kupon in Höhe des Fixing-Kurses dieses Tages. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird.
JPMorgan Asia Credit Index	Mit dem JPMorgan Asia Credit Index wird die Wertentwicklung des asiatischen Marktes ohne Japan für auf US-Dollar lautende Anleihen gemessen. Der Index bietet eine Vergleichsindex für Anlagemöglichkeiten in auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Anlagen, die von staatlichen, quasi-staatlichen und halbstaatlichen Emittenten aus Asien (ohne Japan) begeben werden.
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	Bei dem JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) handelt es sich um eine besondere, gewichtete Version des CEMBI-Index. Er beschränkt den Anteil der Indexländer mit umfangreicheren Industrieschuldverschreibungen, indem er nur einen bestimmten Anteil des aktuell bankfähigen Nennwerts der Schulden dieser Länder einbezieht. Der CEMBI Diversified führt zu gut verteilten, ausgeglicheneren Gewichtungen für die im Index enthaltenen Länder. Die vom CEMBI Diversified abgedeckten Länder sind mit den vom CEMBI abgedeckten identisch. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 22 Schwellenmarktländern mit mindestens 10 Milliarden USD Außenhandel nach. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden.
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	Der JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified bildet die Gesamterträge von auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumenten nach, die von staatlichen und quasi-staatlichen Emittenten aus Schwellenländern begeben werden und die Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungsfaktoren in den Indexaufbau einbeziehen.

<b>Offizieller Name des Vergleichsindex</b>	<b>Beschreibung des Index</b>
<b>JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index</b>	Der JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified (JESG GBI-EM) bildet die Wertentwicklung von Anleihen ab, die von staatlichen Emittenten aus Schwellenländern begeben werden und auf die Landeswährung des Emittenten lauten. Der Index wendet eine Scoring- und Screening-Methode in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) an, um Emittenten, die in Bezug auf ESG-Kriterien höher eingestuft sind, sowie grüne Anleihen zu bevorzugen und Emittenten, die niedriger eingestuft sind, unterzugewichten oder aus dem Portfolio zu entfernen.
<b>JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)</b>	Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>JPMorgan Asia Credit Index Composite Total Return (EUR Hedged)</b>	Der JPMorgan Asia Credit Index (EUR Hedged) misst die Wertentwicklung von auf USD lautenden asiatischen Anleihen, ausgenommen japanischen Anleihen. Der Index dient als Referenzwert für Anlagemöglichkeiten in auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten, die von Staaten, quasi-staatlichen Stellen und Unternehmen in Asien, außer Japan, begeben werden.
<b>JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade</b>	Der JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade umfasst festverzinsliche, auf US-Dollar lautende hochverzinsliche Anleihen, die von Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen in Asien begeben wurden. Der bestehende JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade enthält sowohl fest- als auch variabel verzinsliche Anleihen, die von in Asien ansässigen Körperschaften begeben wurden und einen ausstehenden Nennbetrag von mindestens 150 Mio. USD sowie eine Restlaufzeit von mehr als einem Jahr aufweisen.
<b>PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)</b>	Der PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) ist ein diversifizierter globaler Index, der ein breites Spektrum von Gelegenheiten bei internationalen Rentenpapieren und Sektoren, von Industrieländern zu Schwellenmärkten, nominalem zu realem Vermögen, sowie von Barmitteln zu derivativen Instrumenten abdeckt. Abweichend von den herkömmlichen Indizes, die häufig aus Anleihen bestehen, die entsprechend ihrer Marktkapitalisierung gewertet werden, verwendet der GLADI eine BIP-Gewichtung, die sich auf schneller wachsende Gebiete der Welt konzentriert und so dem Index einen auf die Zukunft ausgerichteten Charakter verleiht. PIMCOs GLADI-Methode ist geistiges Eigentum, das durch das US-Patent Nr. 8.306.892 geschützt ist. GLOBAL ADVANTAGE und GLADI sind Markenzeichen von Pacific Investment Management Company LLC.
<b>S&amp;P 500 Index</b>	Der S&P 500 Index ist ein nicht gemanagter Marktindex, der allgemein als repräsentativ für den Aktienmarkt insgesamt gilt. Der Index konzentriert sich auf das Large Cap-Segment des US-Aktienmarkts. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>SHIR Shekel Overnight Risk Free Rate</b>	Dieser Index enthält den Tagesgeldsatz für den Shekel und entspricht dem Zinssatz der Bank of Israel. An Tagen, an denen der SHIR nicht veröffentlicht wird, entspricht sein Wert dem des letzten Tages, an dem er veröffentlicht wurde. Der Zinssatz der Bank of Israel wird achtmal im Jahr vom Währungsausschuss der Bank of Israel festgelegt, in der Regel montags um 16:00 Uhr. Die Termine für die Veröffentlichung und Anwendung des Zinssatzes der Bank of Israel werden jedes Jahr auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht. Der SHIR wird täglich um 11:00 Uhr auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht, ausgenommen an Samstagen, Sonntagen und weiteren Tagen, die jedes Jahr auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht und regelmäßig aktualisiert werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average</b>	Der Singapore Overnight Rate Average (SORA) ist der volumengewichtete Durchschnittssatz für Kreditgeschäfte auf dem unbesicherten Interbanken-Tagesgeldmarkt für Singapur-Dollar in Singapur.

## Finanzstatus

(Angaben in Tausend)

	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.345.204	\$ 2.167.937	\$ 203.811	\$ 160.430
Investmentfonds	145.505	212.144	11.616	11.571
Pensionsgeschäfte	0	3.856	527	252
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	9.905	22.105	626	1.399
Zahlungsmittel	2.030	1.043	531	432
Einlagen bei Kontrahenten	28.373	29.911	1.805	1.742
Forderungen aus Einkünften	35.442	37.487	2.847	2.427
Forderungen aus verkauften Anlagen	60.325	59.339	4.336	4.588
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	1.516	505	145	851
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	30.894	31.996	521	422
Sonstige Aktiva	0	150	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>2.659.194</b>	<b>2.566.473</b>	<b>226.765</b>	<b>184.114</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(13.628)	(13.307)	(712)	(756)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(103.471)	(60.920)	(10.274)	(4.588)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(2.582)	(1.920)	(201)	(173)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.363)	(1.379)	(111)	(100)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(19.393)	(12.951)	(516)	(505)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(19)	(94)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(217)	(141)	(2)	(1)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(33.732)	(37.183)	(639)	(783)
Einlagen von Kontrahenten	(60)	(3.850)	(60)	0
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(174.465)</b>	<b>(131.745)</b>	<b>(12.515)</b>	<b>(6.906)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 2.484.729</b>	<b>\$ 2.434.728</b>	<b>\$ 214.250</b>	<b>\$ 177.208</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

PIMCO Balanced Income and Growth Fund		PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund	
Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
\$ 1.088.778	\$ 767.569	\$ 4.894.314	\$ 5.268.327	\$ 281.859	\$ 249.832	\$ 1.155.786	\$ 1.293.427
39.825	881	51	147	0	0	29	127
7.168	12.604	1.324	7.572	6.894	5.800	20.333	83.018
0	0	0	0	0	0	0	0
7.448	13.769	55.452	64.207	3.424	4.659	12.790	25.732
6.745	592	4.207	0	572	1.074	6.802	2.517
14.766	6.088	50.931	55.029	4.428	3.188	14.105	15.924
3.469	1.876	60.057	55.730	2.765	2.454	2.785	3.578
2.166	2.752	3.127	2.691	0	0	378	679
175.754	290.704	0	0	0	0	108.231	106.892
727	8.328	2.117	6.536	88	169	2.863	1.490
12.484	14.527	4.816	46.739	1.873	3.546	16.495	11.129
0	0	0	0	0	0	0	0
1.359.330	1.119.690	5.076.396	5.506.978	301.903	270.722	1.340.597	1.544.513
(14.330)	(16.776)	(43.409)	(62.651)	(3.953)	(4.527)	(16.195)	(40.086)
0	(2.036)	0	0	0	0	0	0
(2.707)	(2.585)	(57.838)	(540)	0	0	(3.336)	(40.534)
(336.882)	(408.618)	0	0	0	0	(213.411)	(190.314)
(691)	(212)	(2.121)	(5.504)	(169)	(72)	(1.117)	(3.763)
(1.078)	(800)	(3.910)	(4.248)	(136)	(128)	(676)	(768)
0	0	(230.980)	(232.205)	0	(803)	(286.141)	(396.058)
0	0	0	0	0	0	0	0
(3)	(45)	(198)	(206)	(1)	0	(6)	(7)
0	0	0	(609)	0	0	0	0
(6)	(6)	(983)	(1.070)	(486)	(276)	(506)	(93)
(9.712)	(11.712)	(11.344)	(32.876)	(896)	(2.060)	(14.343)	(5.728)
(1.192)	(6.784)	(20.675)	(29.183)	(770)	(540)	(6.301)	(8.260)
0	0	0	0	0	0	0	0
(366.601)	(449.574)	(371.458)	(369.092)	(6.411)	(8.406)	(542.032)	(685.611)
\$ 992.729	\$ 670.116	\$ 4.704.938	\$ 5.137.886	\$ 295.492	\$ 262.316	\$ 798.565	\$ 858.902

## Finanzstatus (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Diversified Income Fund	
	Zum	Zum	Zum	Zum
	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 135.260	\$ 120.305	\$ 7.034.936	\$ 6.280.493
Investmentfonds	3.588	3.607	766.224	739.526
Pensionsgeschäfte	103	737	907.070	1.221.471
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	1.200	1.941	68.638	157.414
Zahlungsmittel	148	196	6.886	0
Einlagen bei Kontrahenten	2.470	1.630	180.397	211.549
Forderungen aus Einkünften	1.402	1.062	85.092	77.767
Forderungen aus verkauften Anlagen	1.609	1	35.576	9.984
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	18.656	39.677	910.677	1.262.381
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	91	66	20.131	11.388
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	1.270	1.083	66.072	46.900
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>165.797</b>	<b>170.305</b>	<b>10.081.699</b>	<b>10.018.873</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(1.059)	(1.789)	(81.031)	(67.651)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(2.523)	(3.608)	(77.873)	(86.708)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(37.422)	(59.979)	(2.005.632)	(2.159.820)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	0	(6)	(5.905)	(11.377)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(85)	(91)	(6.711)	(6.585)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(2.775)	(2.942)	(72.565)	(49.676)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(324)	(155)
Überziehungskredit	0	0	0	(531)
Zu zahlende Dividende	0	0	(3.742)	(3.455)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(1.492)	(793)	(74.504)	(123.820)
Einlagen von Kontrahenten	0	(1.034)	(6.594)	(69.297)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(45.356)</b>	<b>(70.242)</b>	<b>(2.334.881)</b>	<b>(2.579.075)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 120.441</b>	<b>\$ 100.063</b>	<b>\$ 7.746.818</b>	<b>\$ 7.439.798</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Diversified Income Duration Hedged Fund		Diversified Income ESG Fund		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund	
Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
\$ 360.586	\$ 363.886	\$ 51.239	\$ 51.106	\$ 3.808.846	\$ 4.176.007	€ 3.074.791	€ 3.381.141
37.846	40.652	5.023	5.470	349.941	337.503	241.753	312.665
18.550	69.552	402	3.000	968.483	734.416	76.499	358.849
0	0	0	0	0	0	0	0
12.441	21.706	310	517	72.831	70.864	50.870	130.271
561	856	49	419	21.985	9.665	8.245	29.609
18.608	20.514	598	367	89.555	90.899	83.840	319.479
4.231	4.588	612	649	21.039	19.762	15.212	18.511
617	2.756	0	0	73	116	2.059	3.973
56.772	88.965	4.715	8.774	2.329.733	1.853.086	591.506	965.122
824	58	16	0	2.876	5.110	904	1.770
13.255	21.368	217	268	53.751	83.836	34.676	47.148
0	0	0	0	0	0	0	0
524.291	634.901	63.181	70.570	7.719.113	7.381.264	4.180.355	5.568.538
(5.397)	(5.107)	(718)	(402)	(91.921)	(112.104)	(31.206)	(53.086)
0	0	0	(970)	(78.994)	(82.577)	0	0
(1.910)	(32.509)	0	(161)	(84.150)	(162.221)	(4.623)	(36.114)
(113.353)	(143.391)	(9.413)	(11.118)	(3.895.639)	(3.458.082)	(1.570.373)	(2.003.102)
(118)	(345)	(37)	(189)	(1.053)	(1.357)	(5.849)	(7.846)
(303)	(330)	(32)	(34)	(2.684)	(2.660)	(2.558)	(3.382)
(775)	(529)	0	0	(683)	(1.354)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(2)	(1)	(1)	0	(370)	(681)	(23)	(27)
0	0	0	0	0	0	0	0
(72)	(1.027)	0	0	(1.217)	(1.043)	(69)	(65)
(20.840)	(35.680)	(111)	(133)	(32.723)	(33.384)	(53.664)	(141.264)
(1.161)	(3.143)	(7)	0	(30.726)	(80.228)	(14.251)	(61.607)
0	0	0	0	0	0	0	0
(143.931)	(222.062)	(10.319)	(13.007)	(4.220.160)	(3.935.691)	(1.682.616)	(2.306.493)
\$ 380.360	\$ 412.839	\$ 52.862	\$ 57.563	\$ 3.498.953	\$ 3.445.573	€ 2.497.739	€ 3.262.045

## Finanzstatus (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund	
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.730.718	\$ 2.843.626	\$ 112.555	\$ 83.869
Investmentfonds	263.385	233.751	0	0
Pensionsgeschäfte	24.763	0	5.444	15.600
Einlagen bei Kreditinstituten	0	48.155	0	134
Finanzderivate	99.854	135.418	2.545	1.505
Zahlungsmittel	112	16.830	772	961
Einlagen bei Kontrahenten	71.731	68.149	1.545	1.388
Forderungen aus Einkünften	58.935	49.909	2.246	1.604
Forderungen aus verkauften Anlagen	188.431	222.222	3.881	10.117
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	344
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	4.296	1.423	0	0
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	65.885	70.465	1.981	1.372
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>3.508.110</b>	<b>3.689.948</b>	<b>130.969</b>	<b>116.894</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(133.248)	(134.807)	(3.291)	(1.041)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(404.577)	(296.249)	(9.530)	(10.705)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	(343)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(322)	(610)	0	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(2.045)	(2.257)	(84)	(60)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(237.131)	(281.349)	(3.414)	(722)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(60)	(835)	(5)	(22)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(45.261)	(61.675)	(1.258)	(1.523)
Einlagen von Kontrahenten	(12.994)	(31.163)	0	(70)
Sonstige Verbindlichkeiten	(242)	(62)	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(835.880)</b>	<b>(809.007)</b>	<b>(17.582)</b>	<b>(14.486)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 2.672.230</b>	<b>\$ 2.880.941</b>	<b>\$ 113.387</b>	<b>\$ 102.408</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	
Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
\$ 4.416.127	\$ 3.933.972	\$ 3.191.625	\$ 2.833.512	\$ 159.877	\$ 148.275	\$ 311.163	\$ 264.943
84.642	192.346	0	0	4.703	6.863	17.221	836
0	2.599	11.797	13.694	540	993	3.392	6.274
0	60.900	0	45.181	0	2.753	0	5.043
44.770	71.306	30.532	55.089	1.032	2.340	23.540	30.376
8.295	11.960	2.636	7.900	691	805	3.212	2.267
44.270	32.680	42.711	23.558	1.987	1.732	12.197	13.141
71.041	65.470	47.273	46.301	2.247	2.052	4.650	3.143
734	3.198	795	12.207	244	259	18.274	20.374
56.517	162.903	0	128.924	3.380	5.331	0	22.390
2.431	32.733	1.442	7.335	0	6	100	357
14.635	19.143	9.354	11.359	993	707	8.700	6.457
0	0	0	14	0	0	0	0
4.743.462	4.589.210	3.338.165	3.185.074	175.694	172.116	402.449	375.601
(48.844)	(43.533)	(39.464)	(30.895)	(2.168)	(1.329)	(19.942)	(29.047)
0	0	0	0	0	0	0	0
(100.418)	(16.221)	(68.293)	(6.098)	(6.418)	(1.746)	(50.668)	(21.839)
(112.689)	(217.275)	0	(128.520)	(6.727)	(8.675)	0	(22.311)
(1.355)	(1.778)	(939)	(2.002)	(135)	(80)	(161)	(24)
(3.013)	(2.776)	(2.001)	(2.046)	(149)	(159)	(123)	(99)
(310.446)	(402.727)	(323.694)	(214.833)	(7.942)	(166)	0	(5.271)
0	0	0	(56.665)	0	0	0	0
(18)	(83)	(2)	(53)	0	(3)	0	(2)
0	0	0	0	0	0	0	0
(383)	(317)	(2.165)	(2.039)	0	0	(1)	(1)
(15.335)	(33.004)	(11.821)	(19.603)	(1.010)	(974)	(11.135)	(13.257)
(16.844)	(25.211)	(6.161)	(28.399)	(321)	(1.271)	(1.470)	(960)
0	0	0	0	0	0	0	0
(609.345)	(742.925)	(454.540)	(491.153)	(24.870)	(14.403)	(83.500)	(92.811)
\$ 4.134.117	\$ 3.846.285	\$ 2.883.625	\$ 2.693.921	\$ 150.824	\$ 157.713	\$ 318.949	\$ 282.790

## Finanzstatus (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund	
	Zum	Zum	Zum	Zum
	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 15.313	\$ 17.763	\$ 312.324	\$ 274.526
Investmentfonds	1.745	1.837	0	0
Pensionsgeschäfte	130	158	11.988	8.200
Einlagen bei Kreditinstituten	0	363	0	0
Finanzderivate	840	1.223	3.851	7.131
Zahlungsmittel	93	153	767	1.059
Einlagen bei Kontrahenten	332	305	6.789	2.915
Forderungen aus Einkünften	169	112	2.404	1.980
Forderungen aus verkauften Anlagen	448	233	9	20
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	976	17.447	28.121
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	0	7	213	459
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	220	233	4.034	5.731
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>19.290</b>	<b>23.363</b>	<b>359.826</b>	<b>330.142</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(563)	(803)	(4.079)	(5.389)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	(426)	(443)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(1.025)	(1.028)	(137)	(138)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	(970)	(33.497)	(45.457)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(1)	(1)	(1.047)	(52)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(21)	(24)	(149)	(146)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(7.983)	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	(19.027)	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(2)	(2)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(6)	(1)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(284)	(320)	(4.820)	(2.491)
Einlagen von Kontrahenten	0	(271)	(31)	(4.815)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(1.894)</b>	<b>(3.417)</b>	<b>(71.204)</b>	<b>(58.934)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 17.396</b>	<b>\$ 19.946</b>	<b>\$ 288.622</b>	<b>\$ 271.208</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Euro Bond Fund		Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund	
Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum
30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023
€ 1.610.890	€ 1.547.627	€ 532.751	€ 536.515	€ 2.138.183	€ 1.698.144	€ 1.343.825	€ 890.605
149.626	164.208	0	9.501	144.529	135.514	0	38.073
2.754	97.581	361	14.437	5.275	137.975	838	52.334
0	0	0	0	0	0	0	0
26.544	52.302	1.589	5.984	46.172	45.840	8.354	18.572
3.912	3.541	1.178	3.470	7.706	17.714	3.411	1.236
34.184	37.643	8.381	8.072	60.304	49.751	24.565	20.472
11.343	10.531	5.569	6.584	12.082	10.060	9.721	12.456
1.241	200	1	0	1.300	228	10.511	554
141.760	319.172	30.858	46.380	639.479	615.833	50.276	91.778
965	1.039	0	721	1.901	5.934	105	3.473
11.417	12.883	10.711	10.537	26.329	33.918	9.652	4.174
0	0	0	0	0	0	0	0
1.994.636	2.246.727	591.399	642.201	3.083.260	2.750.911	1.461.258	1.133.727
(19.089)	(32.678)	(3.083)	(5.319)	(46.219)	(23.982)	(9.083)	(8.349)
0	0	0	0	0	0	0	0
(4.985)	0	0	0	(12.772)	(190)	0	(3.877)
(376.121)	(488.304)	(64.568)	(79.001)	(1.448.709)	(1.248.173)	(193.286)	(159.831)
(2.250)	(1.343)	(114)	(443)	(2.234)	(1.212)	(13)	(70)
(664)	(702)	(210)	(228)	(1.307)	(1.266)	(441)	(324)
(2.371)	(1.041)	0	(8.176)	(59.590)	(4.268)	(90.375)	(10.485)
0	0	0	0	0	0	0	0
(6)	(6)	0	0	(23)	(21)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(9.475)	(34.354)	(8.663)	(10.718)	(32.566)	(56.332)	(9.287)	(23.159)
(11.831)	(16.586)	0	(1.130)	(4.227)	(28.240)	(1.465)	(3.663)
0	0	0	0	0	0	0	0
(426.792)	(575.014)	(76.638)	(105.015)	(1.607.647)	(1.363.684)	(303.950)	(209.758)
€ 1.567.844	€ 1.671.713	€ 514.761	€ 537.186	€ 1.475.613	€ 1.387.227	€ 1.157.308	€ 923.969

## Finanzstatus (Fortsetzung)

	Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
(Angaben in Tausend)				
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	€ 198.017	€ 174.163	€ 316.693	€ 306.261
Investmentfonds	0	0	21.862	18.291
Pensionsgeschäfte	5.100	12.400	14.220	30.300
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	852	208	1.636	4.615
Zahlungsmittel	385	448	839	2.070
Einlagen bei Kontrahenten	1.440	1.628	3.147	9.203
Forderungen aus Einkünften	1.220	1.173	4.703	4.039
Forderungen aus verkauften Anlagen	46	1.971	357	1
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	1.414	2.058	121	981
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	530	702	1.004	2.730
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>209.004</b>	<b>194.751</b>	<b>364.582</b>	<b>378.491</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(729)	(1.031)	(1.226)	(924)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	0	(17.069)	(1.470)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(232)	(143)	(85)	(158)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(84)	(63)	(87)	(99)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(2.471)	(1.858)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	(1.661)	(5.955)
Einlagen von Kontrahenten	(251)	0	0	(260)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(1.296)</b>	<b>(1.237)</b>	<b>(22.599)</b>	<b>(10.724)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>€ 207.708</b>	<b>€ 193.514</b>	<b>€ 341.983</b>	<b>€ 367.767</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund		Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund									
Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum								
30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023								
€	979.959	€	132.036	\$	559.493	\$	558.153	\$	16.181.473	\$	14.935.571	\$	4.285.953	\$	3.995.935
	78.140		7.680		6.848		18.210		1.536.131		1.311.189		0		0
	3.449		1.000		617		534		582.002		371.917		144.076		165.958
	0		0		0		0		0		0		0		0
	4.965		2.387		19.760		29.981		584.931		701.868		138.602		194.051
	1.453		383		3.442		3.823		995		51.511		4.221		13.203
	14.402		1.906		11.895		15.196		534.321		497.830		99.180		110.870
	7.360		955		3.716		3.128		104.925		59.192		27.856		18.670
	5.049		698		46.125		8.712		1.718.721		277.948		378.387		26.215
	114.673		16.715		226.450		271.238		6.673.695		6.650.551		1.792.587		1.499.812
	925		635		13		1		5.139		24.912		2.384		4.091
	8.063		2.956		8.009		18.679		383.712		406.567		65.797		102.970
	0		0		0		0		0		0		0		0
	1.218.438		167.351		886.368		927.655		28.306.045		25.289.056		6.939.043		6.131.775
	(8.033)		(5.140)		(13.881)		(22.347)		(463.515)		(696.202)		(106.129)		(119.746)
	0		0		(43.346)		(42.127)		(1.766.226)		(930.028)		(614.263)		(277.758)
	(15.168)		0		(51.051)		(8.490)		(1.672.638)		(346.698)		(375.436)		(116.439)
	(246.647)		(30.198)		(345.930)		(391.325)		(8.583.526)		(9.559.374)		(1.863.945)		(1.839.724)
	(226)		(68)		0		(49)		(8.022)		(57.022)		(1.589)		(4.171)
	(242)		(45)		(247)		(256)		(7.124)		(6.410)		(1.547)		(1.426)
	0		0		0		0		(3.508)		(617)		(781)		0
	0		0		0		0		0		0		0		0
	0		0		(14)		(21)		(165)		(173)		(8)		(7)
	0		0		0		0		0		0		0		0
	0		0		0		0		(1.617)		(642)		(1.453)		(485)
	(4.712)		(663)		(6.866)		(20.035)		(310.856)		(451.767)		(46.796)		(131.420)
	(1.303)		(627)		(3.888)		(10.715)		(145.789)		(162.861)		(34.272)		(79.419)
	0		0		0		0		0		0		0		0
	(276.331)		(36.741)		(465.223)		(495.365)		(12.962.986)		(12.211.794)		(3.046.219)		(2.570.595)
€	942.107	€	130.610	\$	421.145	\$	432.290	\$	15.343.059	\$	13.077.262	\$	3.892.824	\$	3.561.180

## Finanzstatus (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	Global Bond Ex-US Fund		Global High Yield Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 976.516	\$ 962.952	\$ 2.881.155	\$ 2.863.479
Investmentfonds	41.951	10.172	182.808	76.320
Pensionsgeschäfte	510	1.005	404	0
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	35.533	48.425	14.880	17.367
Zahlungsmittel	5.171	8.288	1.716	1.951
Einlagen bei Kontrahenten	26.706	41.103	18.790	34.091
Forderungen aus Einkünften	6.009	4.201	44.825	41.913
Forderungen aus verkauften Anlagen	98.044	16.167	1.752	2.737
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	416.446	509.310	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	5.679	3.753	8.191	7.590
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	25.717	32.367	5.591	11.285
Sonstige Aktiva	0	0	11	95
<b>Summe Aktiva</b>	<b>1.638.282</b>	<b>1.637.743</b>	<b>3.160.123</b>	<b>3.056.828</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(24.022)	(48.860)	(26.085)	(7.830)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(144.686)	(97.971)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(93.263)	(15.657)	(81.396)	(17.070)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(458.755)	(627.293)	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(2.943)	(1.908)	(3.759)	(3.108)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(399)	(370)	(1.797)	(1.825)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(29.136)	(20.553)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(6)	(6)	(24)	(23)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(3.698)	(3.511)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(19.387)	(42.188)	(1.268)	(9.588)
Einlagen von Kontrahenten	(10.525)	(3.364)	(6.991)	(13.070)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(753.986)</b>	<b>(837.617)</b>	<b>(154.154)</b>	<b>(76.578)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 884.296</b>	<b>\$ 800.126</b>	<b>\$ 3.005.969</b>	<b>\$ 2.980.250</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

<sup>(1)</sup> Der Global High Yield Bond ESG Fund wurde am 17. Juni 2024 aufgelegt.

Global High Yield Bond ESG Fund <sup>(1)</sup>	Global Investment Grade Credit Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund	Global Low Duration Real Return Fund	Global Low Duration Real Return Fund
Zum 30. Jun. 2024	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
\$ 8.846	\$ 9.398.574	\$ 10.091.319	\$ 2.134.247	\$ 2.410.642	\$ 1.744.857	\$ 1.923.658
0	530.469	1.045.218	0	0	2.201	506
0	1.689	177.113	54.087	1.300	565	2.889
0	0	0	0	0	0	0
10	108.465	179.275	19.556	34.989	23.619	28.421
773	10.895	18.362	2.835	1.598	6.196	4.962
12	168.816	189.977	35.785	25.954	21.368	24.578
141	101.453	100.050	24.575	24.605	5.774	4.830
0	3.736	213	2.180	1.105	647	1.088
0	918.700	1.178.395	98.414	251.937	74.753	160.441
0	7.902	21.980	2.381	4.337	161	777
3	67.254	68.902	9.493	24.763	15.480	21.747
0	0	0	0	0	0	0
9.785	11.317.953	13.070.804	2.383.553	2.781.230	1.895.621	2.173.897
(5)	(132.653)	(120.283)	(23.674)	(22.233)	(26.153)	(39.941)
0	0	0	0	0	0	0
0	(78.569)	(192)	(15.619)	0	(16.470)	(2.856)
0	(1.877.202)	(2.021.670)	(98.508)	(394.267)	(227.803)	(287.563)
0	(5.550)	(8.457)	(1.596)	(3.826)	(1.161)	(778)
(2)	(4.974)	(5.770)	(977)	(948)	(495)	(606)
0	(9.254)	(7.828)	(9.235)	(108.032)	(597.645)	(618.014)
0	0	0	0	(36.861)	0	(24.686)
0	(218)	(262)	(212)	(188)	(1)	(1)
0	0	0	0	0	0	0
0	(7.126)	(7.188)	(2.967)	(2.767)	(1.136)	(527)
0	(46.987)	(85.679)	(8.293)	(10.054)	(7.954)	(9.704)
0	(26.107)	(99.753)	(5.011)	(31.847)	(8.816)	(12.169)
0	0	0	0	0	0	0
(7)	(2.188.640)	(2.357.082)	(166.092)	(611.023)	(887.634)	(996.845)
\$ 9.778	\$ 9.129.313	\$ 10.713.722	\$ 2.217.461	\$ 2.170.207	\$ 1.007.987	\$ 1.177.052

## Finanzstatus (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	Global Real Return Fund		Income Fund	
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 3.653.403	\$ 3.700.069	\$ 108.870.993	\$ 96.949.829
Investmentfonds	415	23.397	2.970.999	1.805.212
Pensionsgeschäfte	0	2.878	6.002.467	274.468
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	48.099	53.168	5.150.575	4.452.969
Zahlungsmittel	10.580	9.826	61.114	65.968
Einlagen bei Kontrahenten	41.499	53.688	2.053.002	1.594.328
Forderungen aus Einkünften	13.017	10.809	609.330	463.626
Forderungen aus verkauften Anlagen	1.535	437.235	644.696	26.720
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	268.462	319.813	45.137.933	24.623.052
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	1.274	921	175.510	217.821
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	29.965	30.224	2.013.445	1.889.968
Sonstige Aktiva	0	0	0	92
<b>Summe Aktiva</b>	<b>4.068.249</b>	<b>4.642.028</b>	<b>173.690.064</b>	<b>132.364.053</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(59.103)	(76.489)	(3.777.843)	(3.184.989)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	(936.158)	(937.631)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	(5.696)	(367.508)	(228.964)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(588.010)	(576.267)	(85.750.904)	(53.120.749)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(9.899)	(6.207)	(56.622)	(91.455)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.140)	(1.299)	(60.791)	(55.002)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(1.208.653)	(1.556.968)	(3.836)	(495)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(8.448)	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(29)	(36)	(5.135)	(4.542)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(4.904)	(1.105)	(4.134)	(3.824)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(10.329)	(16.758)	(3.671.610)	(2.987.747)
Einlagen von Kontrahenten	(13.948)	(20.110)	(222.369)	(1.205.538)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(1.904.463)</b>	<b>(2.260.935)</b>	<b>(94.856.910)</b>	<b>(61.820.936)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 2.163.786</b>	<b>\$ 2.381.093</b>	<b>\$ 78.833.154</b>	<b>\$ 70.543.117</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Income Fund II		Inflation Multi-Asset Fund		Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	
Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
\$ 279.719	\$ 135.928	\$ 262.191	\$ 289.304	\$ 771.353	\$ 1.099.774	\$ 982.424	\$ 1.024.085
229	123	22.645	28.256	72.868	82.593	5.751	16.247
2.903	0	543	364	20.380	100.744	527	678
0	0	0	0	0	0	0	0
2.405	857	6.865	9.713	6.011	3.586	6.731	8.563
419	2.627	1.084	1.667	446	2.008	341	892
3.637	1.493	5.500	6.470	7.293	9.047	12.848	11.190
1.999	900	445	462	4.631	7.935	10.618	10.372
101	5	136	1.236	34	257.005	0	0
43.462	18.950	56.684	67.319	129.734	239.895	29.913	102.013
708	14.089	19	59	117	647	855	834
3.815	1.853	3.841	7.218	5.010	8.585	4.574	3.456
0	0	0	0	0	0	0	0
339.397	176.825	359.953	412.068	1.017.877	1.811.819	1.054.582	1.178.330
(3.952)	(360)	(6.194)	(14.826)	(4.225)	(7.795)	(11.077)	(5.543)
(566)	(582)	0	0	(48.308)	(50.185)	0	0
(2.466)	(823)	0	(80)	0	(41.000)	(3.396)	0
(85.645)	(43.381)	(110.942)	(117.222)	(214.172)	(323.595)	(88.690)	(174.185)
(1.139)	(741)	(397)	(988)	(276)	(627)	(883)	(1.818)
(291)	(123)	(200)	(267)	(322)	(380)	(389)	(417)
(2.517)	0	(28.036)	(15.063)	0	(525.595)	(27.694)	(6.973)
0	(3.572)	0	(1.229)	0	(44.279)	0	(4.817)
0	0	(2)	(3)	(99)	(187)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	(77)	(16)	(15)	(44)
(3.453)	(1.793)	(4.386)	(4.899)	(3.377)	(4.015)	(1.744)	(4.533)
(624)	(290)	(1.443)	(4.243)	(2.613)	(4.300)	(1.653)	(7.157)
0	0	0	0	0	0	0	0
(100.653)	(51.665)	(151.600)	(158.820)	(273.469)	(1.001.974)	(135.541)	(205.487)
\$ 238.744	\$ 125.160	\$ 208.353	\$ 253.248	\$ 744.408	\$ 809.845	\$ 919.041	\$ 972.843

## Finanzstatus (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Income Fund		Low Duration Opportunities Fund	
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 3.358.746	\$ 2.692.081	\$ 896.259	\$ 1.047.330
Investmentfonds	229.495	199.001	72.941	70.798
Pensionsgeschäfte	105.754	345.484	59.376	2.805
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	100.503	77.338	24.423	21.493
Zahlungsmittel	33.586	7.667	2.175	3.584
Einlagen bei Kontrahenten	59.629	47.017	18.944	27.622
Forderungen aus Einkünften	19.670	11.731	4.676	5.531
Forderungen aus verkauften Anlagen	5.543	426	199	22
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	1.067.380	988.905	170.724	494.771
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	3.635	14.906	11	28
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	30.873	31.081	20.335	32.067
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>5.014.814</b>	<b>4.415.637</b>	<b>1.270.063</b>	<b>1.706.051</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(64.630)	(48.681)	(27.386)	(33.847)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	(5.624)	(36.723)	(41.577)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(30.672)	(99.442)	(4.112)	(9)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(2.543.140)	(2.128.585)	(448.277)	(796.267)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(309)	(2.117)	0	(185)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.199)	(976)	(281)	(311)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	(15.085)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(31)	(24)	(85)	(166)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(716)	(600)	(2.853)	(313)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(69.812)	(54.022)	(14.529)	(15.582)
Einlagen von Kontrahenten	(7.867)	(45.261)	(5.749)	(15.085)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(2.718.376)</b>	<b>(2.385.332)</b>	<b>(539.995)</b>	<b>(918.427)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 2.296.438</b>	<b>\$ 2.030.305</b>	<b>\$ 730.068</b>	<b>\$ 787.624</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Low Duration Opportunities ESG Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund	
Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
\$ 4.837	\$ 5.199	\$ 99.505	\$ 88.045	\$ 2.237.560	\$ 1.902.209	\$ 1.892.926	\$ 1.318.561
0	0	10.901	9.668	4	4	330.950	179.118
911	0	1.122	631	14.185	68.968	1.333.842	544.588
0	0	0	0	0	0	0	0
37	27	2.394	264	22.422	16.817	65.382	25.961
8	163	108	98	211	300	3.504	4.397
98	69	0	970	20.982	13.878	113.320	57.022
40	37	288	36	6.110	5.108	10.697	6.425
0	0	0	351	183	0	2.090	61.217
461	466	0	0	1.376.649	2.175.726	62.030	162.621
0	0	519	36	3.559	866	149.167	2.442
26	61	0	0	5.165	12.095	27.048	10.848
0	0	0	0	0	0	0	0
6.418	6.022	114.837	100.099	3.687.030	4.195.971	3.990.956	2.373.200
(27)	(57)	(749)	(296)	(16.441)	(13.734)	(6.970)	(17.262)
(99)	(100)	0	0	(304.072)	(432.300)	0	0
0	0	0	(963)	(10.839)	(39.100)	(46.383)	(52.179)
(555)	(624)	0	0	(2.116.135)	(2.702.052)	(188.940)	(243.902)
0	0	(64)	(119)	(134)	(669)	(930)	(2.282)
(2)	(2)	(95)	(90)	(746)	(585)	(1.670)	(1.153)
(405)	0	0	0	(8.328)	(55.855)	0	0
0	0	0	0	0	(823)	0	0
0	0	0	0	(8)	(8)	(25)	(13)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	(75)	(48)	0	0
(18)	(18)	0	0	(7.553)	(5.796)	(42.169)	(31.885)
0	0	(1.451)	(138)	(6.392)	(19.745)	(63.338)	(61.536)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.106)	(801)	(2.359)	(1.606)	(2.470.723)	(3.270.715)	(350.425)	(410.212)
\$ 5.312	\$ 5.221	\$ 112.478	\$ 98.493	\$ 1.216.307	\$ 925.256	\$ 3.640.531	\$ 1.962.988

## Finanzstatus (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund	
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 7.743	\$ 9.254	\$ 654.332	\$ 654.744
Investmentfonds	1.158	1.042	534	179
Pensionsgeschäfte	3.532	1.095	1.165	605
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	454	295	40.892	38.858
Zahlungsmittel	25	22	5.566	2.419
Einlagen bei Kontrahenten	526	389	13.348	8.906
Forderungen aus Einkünften	26	23	3.223	3.085
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	433	2.882	65
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	1.002	3.816	205.994	154.850
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	5	0	690	315
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	599	559	15.334	17.307
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>15.070</b>	<b>16.928</b>	<b>943.960</b>	<b>881.333</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(61)	(323)	(35.986)	(33.040)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	(8.994)	(13.890)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	0	(153)	(8)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(2.193)	(4.496)	(396.537)	(319.259)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	0	0	(339)	(579)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(7)	(7)	(497)	(501)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(23.381)	(33.125)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	(1.037)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(114)	(131)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(606)	(637)	(23.564)	(21.991)
Einlagen von Kontrahenten	(80)	(290)	(1.521)	(7.823)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(2.947)</b>	<b>(5.753)</b>	<b>(491.086)</b>	<b>(431.384)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 12.123</b>	<b>\$ 11.175</b>	<b>\$ 452.874</b>	<b>\$ 449.949</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
\$ 5.606.401	\$ 5.908.989	\$ 191.386	\$ 203.304	£ 236.612	£ 365.325	£ 338.305	£ 330.293
126.791	151.381	22.445	23.640	19.189	18.137	0	0
417	732	18.533	18.466	347	5.455	0	6.500
0	0	0	0	0	0	0	0
69.732	60.519	40.642	63.061	564	2.225	4.449	6.669
11.202	12.041	2.503	4.102	4.930	1.280	595	1.177
82.728	63.287	14.386	26.538	3.522	3.382	5.150	3.694
36.139	33.067	1.294	1.340	3.024	5.404	5.887	5.519
70	80	0	208	382	57	0	0
2.552.539	2.343.513	22.134	12.700	17.819	19.621	13.360	25.877
1.468	6.409	8	97	251	137	0	0
37.012	58.602	16.136	19.620	3.812	6.788	1.353	1.024
0	0	0	0	0	0	0	0
8.524.499	8.638.620	329.467	373.076	290.452	427.811	369.099	380.753
(64.921)	(81.227)	(49.890)	(66.665)	(1.029)	(2.583)	(891)	(841)
(1.175)	(34.262)	(5.353)	0	0	0	0	0
(248)	(81)	0	(203)	(496)	(1.403)	0	(67)
(4.242.599)	(3.960.404)	(42.056)	(42.429)	(32.996)	(33.437)	(30.896)	(43.049)
(2.842)	(6.899)	(19)	(81)	(118)	(524)	(6)	(4)
(2.496)	(2.720)	(201)	(242)	(67)	(106)	(125)	(123)
(17.827)	(3.246)	0	0	(7.229)	(20.592)	(421)	(3.946)
(7.759)	0	0	0	0	0	0	0
(186)	(206)	(1)	(1)	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(171)	(143)	(372)	(528)	(1.914)	(1.838)	(426)	(393)
(33.606)	(25.978)	(7.146)	(16.727)	(2.944)	(5.857)	(4.747)	(6.722)
(23.966)	(103.403)	(630)	(5.854)	0	(410)	0	(840)
0	0	0	0	0	0	0	0
(4.397.796)	(4.218.569)	(105.668)	(132.730)	(46.793)	(66.750)	(37.512)	(55.985)
\$ 4.126.703	\$ 4.420.051	\$ 223.799	\$ 240.346	£ 243.659	£ 361.061	£ 331.587	£ 324.768

## Finanzstatus (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.682.421	\$ 1.770.912	\$ 550.835	\$ 487.346
Investmentfonds	52.568	74.138	6.578	18.239
Pensionsgeschäfte	10.073	912	2.068	259
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	2.428	10.460	4.061	7.317
Zahlungsmittel	4.681	1.581	405	680
Einlagen bei Kontrahenten	13.062	18.827	10.456	8.358
Forderungen aus Einkünften	28.826	29.726	5.999	5.209
Forderungen aus verkauften Anlagen	1.288	111	8	8
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	50.667	62.254
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	1.726	1.577	245	759
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	4.444	3.338	3.310	2.128
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>1.801.517</b>	<b>1.911.582</b>	<b>634.632</b>	<b>592.557</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(5.472)	(4.499)	(2.874)	(1.161)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(29.212)	(13.824)	(6.629)	(8)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	(104.635)	(100.772)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(7.837)	(3.060)	(395)	(128)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(995)	(1.080)	(250)	(235)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(8.588)	(8.200)	(19.605)	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(62)	(17)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(51)	(42)	(465)	(394)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(1.625)	(4.851)	(5.492)	(7.154)
Einlagen von Kontrahenten	(371)	(3.122)	(399)	(1.844)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(54.213)</b>	<b>(38.695)</b>	<b>(140.744)</b>	<b>(111.696)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 1.747.304</b>	<b>\$ 1.872.887</b>	<b>\$ 493.888</b>	<b>\$ 480.861</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

\* Die Summe der Gesellschaft zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*	
Zum	Zum	Zum	Zum
30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023
\$ 2.345.757	\$ 1.683.085	\$ 216.783.587	\$ 200.471.776
198.207	184.482	7.269.194	6.375.691
62.771	4.561	10.530.146	5.072.632
0	0	0	162.529
3.329	716	7.152.204	7.073.805
588	1.292	277.944	363.899
4.727	12.558	4.238.203	3.986.039
13.556	13.665	1.581.862	1.328.589
7.277	314	3.259.179	1.479.653
0	0	66.779.204	48.619.873
429	6.660	418.778	416.969
2.050	7.819	3.227.745	3.338.437
0	0	11	351
2.638.691	1.915.152	321.518.057	278.690.243
(2.215)	(8.435)	(5.609.695)	(5.397.203)
0	0	(3.989.389)	(2.950.061)
(636.984)	0	(4.567.355)	(1.786.064)
0	0	(121.404.038)	(91.155.892)
(567)	(5.085)	(137.175)	(246.185)
(591)	(583)	(120.636)	(115.314)
0	0	(3.678.452)	(4.637.552)
0	(43.894)	(35.234)	(217.863)
(2)	(2)	(7.494)	(8.387)
0	0	0	(1.140)
0	0	(44.648)	(31.351)
0	(2.187)	(4.779.048)	(4.700.999)
(2.113)	(760)	(739.012)	(2.339.615)
0	0	(242)	(62)
(642.472)	(60.946)	(145.112.418)	(113.587.688)
\$ 1.996.219	\$ 1.854.206	\$ 176.405.639	\$ 165.102.555

## Betriebsergebnisrechnung

(Angaben in Tausend)

	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 99.957	\$ 127.322	\$ 5.940	\$ 10.414
Sonstige Erträge	0	0	0	65
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(133.689)	(127.920)	(4.440)	(11.781)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	940	16.031	(273)	2.220
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(3.198)	22	(318)	21
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	252.688	(6.170)	7.431	5.133
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(10.173)	(10.526)	(681)	(765)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	48	(54)	2	(10)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	206.573	(1.295)	7.661	5.297
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(8.154)	(9.601)	(620)	(1.035)
Servicegebühr	(101)	(145)	0	0
Bestandspflegegebühr	(63)	(68)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	(2)	0	0
Gesamtaufwendungen	(8.319)	(9.816)	(620)	(1.035)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	8	8	2	2
Betriebskosten, netto	(8.311)	(9.808)	(618)	(1.033)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	198.262	(11.103)	7.043	4.264
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(499)	(61)	(13)	(30)
Aufwand für Kreditfazilitäten	(204)	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(13.008)	(17.012)	(2.744)	(5.596)
Nettoausgleichskredite und (-gebühren)	79	(545)	66	2
Summe Finanzierungskosten	(13.632)	(17.618)	(2.691)	(5.624)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	184.630	(28.721)	4.352	(1.360)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(38)	0	(3)	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	184.592	(28.721)	4.349	(1.360)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 184.592	\$ (28.721)	\$ 4.349	\$ (1.360)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge resultieren ausschließlich aus fortlaufenden Geschäftstätigkeiten.

PIMCO Balanced Income and Growth Fund		PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023						
\$ 15.092	\$ 12.416	\$ 154.480	\$ 170.864	\$ 4.748	\$ 5.112	\$ 14.189	\$ 20.182
0	729	0	14	0	0	0	68
14.691	(2.455)	(62.282)	(550.340)	(2.826)	(10.449)	(19.469)	(45.548)
(3.151)	20.337	(20.268)	(4.548)	351	(2.927)	23.914	(118.831)
(614)	(2.083)	(1.283)	(7.044)	129	(394)	(38)	25
25.783	(15.061)	58.889	393.969	(5.746)	17.685	4.552	60.903
(3.753)	39.440	10.487	(35.289)	(661)	1.801	10.366	(14.337)
171	(409)	(173)	692	(51)	(19)	(54)	(685)
48.219	52.914	139.850	(31.682)	(4.056)	10.809	33.460	(98.223)
(5.011)	(4.774)	(23.880)	(27.395)	(778)	(887)	(4.118)	(6.190)
(20)	(18)	(496)	(551)	0	0	(36)	(67)
0	0	(573)	(603)	(3)	0	0	0
0	0	(149)	(167)	0	(8)	0	(1)
(5.031)	(4.792)	(25.098)	(28.716)	(781)	(895)	(4.154)	(6.258)
0	166	0	0	0	0	0	0
(5.031)	(4.626)	(25.098)	(28.716)	(781)	(895)	(4.154)	(6.258)
43.188	48.288	114.752	(60.398)	(4.837)	9.914	29.306	(104.481)
(179)	(260)	(7.480)	(9.931)	(10)	(4)	(8.222)	(9.408)
0	0	0	0	0	0	0	0
(3.690)	(1.398)	(40.678)	(39.969)	(2.053)	(1.972)	(639)	(566)
380	(29)	3.123	(1.417)	0	34	429	(34)
(3.489)	(1.687)	(45.035)	(51.317)	(2.063)	(1.942)	(8.432)	(10.008)
39.699	46.601	69.717	(111.715)	(6.900)	7.972	20.874	(114.489)
(952)	(295)	0	(26)	6	2	1	1
29	0	0	0	0	0	0	0
38.776	46.306	69.717	(111.741)	(6.894)	7.974	20.875	(114.488)
\$ 38.776	\$ 46.306	\$ 69.717	\$ (111.741)	\$ (6.894)	\$ 7.974	\$ 20.875	\$ (114.488)

## Betriebsergebnisrechnung (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Diversified Income Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 3.565	\$ 2.759	\$ 212.212	\$ 209.219
Sonstige Erträge	0	65	0	1.911
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(705)	(173)	(121.826)	(184.578)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(755)	6	23.201	65.169
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(12)	(28)	8.860	(10.292)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(901)	1.051	28.219	276.276
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(3)	478	(98.959)	25.065
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	0	7	(337)	171
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	1.189	4.165	51.370	382.941
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(448)	(528)	(40.099)	(45.117)
Servicegebühr	0	0	(244)	(312)
Bestandspflegegebühr	0	0	(340)	(365)
Sonstige Aufwendungen	0	0	(771)	(217)
Gesamtaufwendungen	(448)	(528)	(41.454)	(46.011)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	1	1	470	464
Betriebskosten, netto	(447)	(527)	(40.984)	(45.547)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>742</b>	<b>3.638</b>	<b>10.386</b>	<b>337.394</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(54)	(6)	(2.215)	(1.699)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	(63.969)	(63.554)
Nettoausgleichskredite und (-gebühren)	0	0	(6.983)	(2.594)
Summe Finanzierungskosten	(54)	(6)	(73.167)	(67.847)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>688</b>	<b>3.632</b>	<b>(62.781)</b>	<b>269.547</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	2	(1)	(41)	(16)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>690</b>	<b>3.631</b>	<b>(62.822)</b>	<b>269.531</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ 690</b>	<b>\$ 3.631</b>	<b>\$ (62.822)</b>	<b>\$ 269.531</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge resultieren ausschließlich aus fortlaufenden Geschäftstätigkeiten.

Diversified Income Duration Hedged Fund		Diversified Income ESG Fund		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 12.445	\$ 13.553	\$ 1.446	\$ 701	\$ 93.510	\$ 83.905	€ 45.340	€ 60.266
0	197	0	0	11	2.045	0	0
(7.769)	(12.205)	55	(2)	(32.303)	(3.875)	(62.329)	(123.631)
17.179	12.129	(696)	(265)	49.686	50.224	85.055	(171.519)
26	203	24	(307)	1.840	(22.506)	1.562	7.680
4.475	16.730	(1.043)	(201)	(58.223)	14.326	99.680	162.189
(9.626)	8.649	(542)	(205)	20.638	106.698	(57.084)	12.190
(45)	29	(6)	0	(1.056)	586	(31.278)	22.296
16.685	39.285	(762)	(279)	74.103	231.403	80.946	(30.529)
(1.903)	(2.456)	(195)	(98)	(16.261)	(16.606)	(17.394)	(30.207)
(9)	(9)	0	0	(78)	(84)	(15)	(19)
0	0	0	0	(50)	(64)	0	0
0	0	(1)	(1)	(2)	(3)	(128)	(175)
(1.912)	(2.465)	(196)	(99)	(16.391)	(16.757)	(17.537)	(30.401)
1	1	0	0	217	228	124	565
(1.911)	(2.464)	(196)	(99)	(16.174)	(16.529)	(17.413)	(29.836)
14.774	36.821	(958)	(378)	57.929	214.874	63.533	(60.365)
(46)	(119)	0	0	(729)	(797)	(404)	(636)
0	0	0	0	0	0	0	0
(3.177)	(4.882)	0	0	(5.667)	(4.869)	(937)	(3.405)
(521)	94	0	0	(250)	(47)	1.823	479
(3.744)	(4.907)	0	0	(6.646)	(5.713)	482	(3.562)
11.030	31.914	(958)	(378)	51.283	209.161	64.015	(63.927)
(3)	0	3	(2)	(172)	(49)	(1.683)	(2.177)
0	0	0	0	(364)	0	(2)	0
11.027	31.914	(955)	(380)	50.747	209.112	62.330	(66.104)
\$ 11.027	\$ 31.914	\$ (955)	\$ (380)	\$ 50.747	\$ 209.112	€ 62.330	€ (66.104)

## Betriebsergebnisrechnung (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)

	Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 104.888	\$ 84.704	\$ 3.754	\$ 243
Sonstige Erträge	0	498	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(4.009)	(8.824)	(1.200)	97
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	23.718	41.594	490	47
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(9.430)	3.626	(592)	10
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(151.362)	97.627	(5.152)	327
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(42.531)	7.059	(1.040)	(47)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	13.128	(4.724)	27	0
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(65.598)	221.560	(3.713)	677
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(12.880)	(11.305)	(490)	(26)
Servicegebühr	(12)	(36)	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	(3)	0
Gesamtaufwendungen	(12.893)	(11.342)	(493)	(26)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(12.893)	(11.342)	(493)	(26)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>(78.491)</b>	<b>210.218</b>	<b>(4.206)</b>	<b>651</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(7.472)	(5.964)	(108)	(3)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(10.117)	(8.029)	(2)	(2)
Nettoausgleichskredite und (-gebühren)	856	261	0	0
Summe Finanzierungskosten	(16.733)	(13.732)	(110)	(5)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>(95.224)</b>	<b>196.486</b>	<b>(4.316)</b>	<b>646</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(1.220)	(739)	(28)	(2)
Kapitalertragsteuer	598	(673)	17	(9)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>(95.846)</b>	<b>195.074</b>	<b>(4.327)</b>	<b>635</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ (95.846)</b>	<b>\$ 195.074</b>	<b>\$ (4.327)</b>	<b>\$ 635</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge resultieren ausschließlich aus fortlaufenden Geschäftstätigkeiten.

Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 136.881	\$ 108.490	\$ 98.131	\$ 69.582	\$ 4.560	\$ 4.269	\$ 11.812	\$ 5.081
0	1.298	0	0	0	274	0	0
(24.743)	(34.567)	(64.425)	(75.552)	(2.493)	(8.005)	2.629	(3.419)
(15.303)	9.227	(44.918)	20.332	(2.336)	2.942	(530)	4.580
1.974	2.144	2.085	944	(27)	1	388	(1.229)
2.482	81.031	51.929	107.494	2.195	7.136	(7.892)	4.216
(28.787)	2.443	(31.573)	(2.752)	(2.250)	(1.517)	1.261	2.929
243	858	3.029	122	(29)	6	(95)	17
72.747	170.924	14.258	120.170	(380)	5.106	7.573	12.175
(17.024)	(14.672)	(12.116)	(10.963)	(914)	(996)	(698)	(388)
(14)	(13)	(5)	(5)	0	0	0	0
(75)	(56)	(5)	(3)	0	0	0	0
(14)	(3)	(1)	(2)	0	0	0	0
(17.127)	(14.744)	(12.127)	(10.973)	(914)	(996)	(698)	(388)
0	0	0	0	0	0	1	1
(17.127)	(14.744)	(12.127)	(10.973)	(914)	(996)	(697)	(387)
55.620	156.180	2.131	109.197	(1.294)	4.110	6.876	11.788
(8.142)	(2.991)	(7.307)	(1.483)	(107)	(29)	(142)	(14)
0	0	0	0	0	0	0	0
(27.460)	(19.646)	(18.230)	(13.396)	0	0	(45)	(23)
2.669	156	1.022	(838)	0	0	0	0
(32.933)	(22.481)	(24.515)	(15.717)	(107)	(29)	(187)	(37)
22.687	133.699	(22.384)	93.480	(1.401)	4.081	6.689	11.751
(675)	(119)	(238)	5	(21)	(5)	(137)	(40)
274	(5)	198	0	9	0	32	8
22.286	133.575	(22.424)	93.485	(1.413)	4.076	6.584	11.719
\$ 22.286	\$ 133.575	\$ (22.424)	\$ 93.485	\$ (1.413)	\$ 4.076	\$ 6.584	\$ 11.719

## Betriebsergebnisrechnung (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)

	Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 515	\$ 558	\$ 7.234	\$ 5.673
Sonstige Erträge	0	144	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(281)	168	361	(2.034)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	443	670	(5.091)	(3.062)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(16)	122	(35)	251
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(484)	103	(3.280)	3.258
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(195)	(607)	(1.982)	(984)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	13	14	(6)	81
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(5)	1.172	(2.799)	3.183
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(133)	(152)	(856)	(806)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	(12)	(21)
Sonstige Aufwendungen	0	0	(5)	(6)
Gesamtaufwendungen	(133)	(152)	(873)	(833)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	3	3	0	0
Betriebskosten, netto	(130)	(149)	(873)	(833)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	(135)	1.023	(3.672)	2.350
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(6)	(7)	(676)	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	(2.633)	(1.248)
Nettoausgleichskredite und (-gebühren)	0	0	0	4
Summe Finanzierungskosten	(6)	(7)	(3.309)	(1.244)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	(141)	1.016	(6.981)	1.106
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(12)	(1)	70	0
Kapitalertragsteuer	3	1	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	(150)	1.016	(6.911)	1.106
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ (150)	\$ 1.016	\$ (6.911)	\$ 1.106

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge resultieren ausschließlich aus fortlaufenden Geschäftstätigkeiten.

Euro Bond Fund		Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
€ 26.993	€ 22.648	€ 9.338	€ 7.837	€ 32.271	€ 20.803	€ 19.474	€ 1.471
0	359	0	17	0	6	0	63
(16.732)	(82.934)	469	(24.398)	(4.721)	(48.614)	(2.578)	(20.288)
(16.525)	(31.337)	205	(961)	(4.153)	9.453	(15.712)	(13.811)
(1.405)	4.011	(67)	371	6.871	5.817	(1.287)	243
(318)	67.301	(6.356)	28.907	38.078	49.623	(66.318)	21.727
(12.907)	68.666	(2.138)	8.150	(21.537)	4.948	(10.875)	15.292
(4.925)	(603)	(1.078)	(594)	(27.846)	251	(2.322)	(57)
(25.819)	48.111	373	19.329	18.963	42.287	(79.618)	4.640
(4.304)	(4.987)	(1.327)	(1.453)	(7.956)	(7.214)	(2.604)	(259)
(35)	(30)	0	0	(37)	(33)	0	0
0	0	0	0	(2)	0	0	0
(1)	(1)	0	0	(92)	(68)	0	0
(4.340)	(5.018)	(1.327)	(1.453)	(8.087)	(7.315)	(2.604)	(259)
278	329	6	89	215	195	27	12
(4.062)	(4.689)	(1.321)	(1.364)	(7.872)	(7.120)	(2.577)	(247)
(29.881)	43.422	(948)	17.965	11.091	35.167	(82.195)	4.393
(205)	(131)	(186)	(59)	(413)	(243)	(284)	(13)
0	0	0	0	0	0	0	0
(594)	(537)	(84)	(202)	(9.485)	(6.848)	0	0
(44)	(35)	(2)	(9)	128	(31)	0	0
(843)	(703)	(272)	(270)	(9.770)	(7.122)	(284)	(13)
(30.724)	42.719	(1.220)	17.695	1.321	28.045	(82.479)	4.380
(5)	(51)	(2)	0	1	(1)	2	(7)
0	0	0	0	0	0	0	0
(30.729)	42.668	(1.222)	17.695	1.322	28.044	(82.477)	4.373
€ (30.729)	€ 42.668	€ (1.222)	€ 17.695	€ 1.322	€ 28.044	€ (82.477)	€ 4.373

## Betriebsergebnisrechnung (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	€ 3.873	€ 3.681	€ 10.217	€ 5.210
Sonstige Erträge	0	12	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(236)	(3.351)	1.822	(6.228)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.146	1.343	899	678
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	101	(170)	23	117
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(827)	4.196	(1.050)	8.574
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	959	(977)	(3.293)	60
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	19	134	11	(35)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	5.035	4.868	8.629	8.376
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(450)	(448)	(593)	(219)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(450)	(448)	(593)	(219)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	43	19
Betriebskosten, netto	(450)	(448)	(550)	(200)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>4.585</b>	<b>4.420</b>	<b>8.079</b>	<b>8.176</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(2)	(8)	(45)	(3)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	(1)	0
Nettoausgleichskredite und (-gebühren)	0	0	0	0
Summe Finanzierungskosten	(2)	(8)	(46)	(3)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>4.583</b>	<b>4.412</b>	<b>8.033</b>	<b>8.173</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(19)	2	0	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>4.564</b>	<b>4.414</b>	<b>8.033</b>	<b>8.173</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	<b>€ 4.564</b>	<b>€ 4.414</b>	<b>€ 8.033</b>	<b>€ 8.173</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge resultieren ausschließlich aus fortlaufenden Geschäftstätigkeiten.

PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund		Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
€ 6.762	€ 2.654	\$ 8.057	\$ 7.573	\$ 300.835	\$ 172.649	\$ 77.461	\$ 50.235
0	2	0	166	0	3.707	0	0
(1.890)	(8.500)	(13.568)	(8.671)	(206.112)	(144.975)	(42.628)	(6.283)
(437)	1.303	930	3.498	183.528	(60.657)	16.520	(74.830)
1.247	155	(131)	316	(28.841)	(21.493)	(1.656)	(201)
2.505	9.649	(192)	14.032	(296.362)	1.883	(85.193)	(49.756)
(269)	(3.786)	(2.652)	(6.890)	87.697	428.444	(48.291)	148.590
(1.521)	14	(3.248)	(299)	(99.736)	(7.263)	(27.239)	(1.859)
6.397	1.491	(10.804)	9.725	(58.991)	372.295	(111.026)	65.896
(601)	(355)	(1.492)	(1.465)	(43.204)	(36.839)	(8.849)	(8.138)
0	0	0	0	(875)	(766)	(14)	(17)
0	0	0	0	(58)	(58)	(28)	0
0	0	0	0	(79)	(63)	(2)	(2)
(601)	(355)	(1.492)	(1.465)	(44.216)	(37.726)	(8.893)	(8.157)
33	25	0	0	1.399	1.396	0	0
(568)	(330)	(1.492)	(1.465)	(42.817)	(36.330)	(8.893)	(8.157)
5.829	1.161	(12.296)	8.260	(101.808)	335.965	(119.919)	57.739
(22)	(17)	(424)	(81)	(3.336)	(2.651)	(1.538)	(746)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(2.201)	(2.225)	(26.300)	(16.775)	(10.784)	(7.316)
0	0	(4)	0	(3.336)	714	213	(378)
(22)	(17)	(2.629)	(2.306)	(32.972)	(18.712)	(12.109)	(8.440)
5.807	1.144	(14.925)	5.954	(134.780)	317.253	(132.028)	49.299
(110)	(5)	(15)	(6)	(6.810)	4	(807)	(658)
0	0	7	(8)	0	0	0	0
5.697	1.139	(14.933)	5.940	(141.590)	317.257	(132.835)	48.641
€ 5.697	€ 1.139	\$ (14.933)	\$ 5.940	\$ (141.590)	\$ 317.257	\$ (132.835)	\$ 48.641

## Betriebsergebnisrechnung (Fortsetzung)

	Global Bond Ex-US Fund		Global High Yield Bond Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
(Angaben in Tausend)				
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 16.567	\$ 10.248	\$ 92.243	\$ 82.477
Sonstige Erträge	0	285	0	996
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(18.077)	(4.851)	(66.492)	(64.412)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	25.675	(9.960)	5.030	32.096
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(737)	(1.230)	1.585	(3.581)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(16.220)	(6.532)	27.632	136.901
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	10.377	39.158	(20.712)	351
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(5.860)	(839)	513	(613)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	11.725	26.279	39.799	184.215
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(2.299)	(1.949)	(10.829)	(11.191)
Servicegebühr	(11)	(12)	(13)	(17)
Bestandspflegegebühr	(26)	(26)	(97)	(121)
Sonstige Aufwendungen	0	0	(41)	(19)
Gesamtaufwendungen	(2.336)	(1.987)	(10.980)	(11.348)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	1	0	0
Betriebskosten, netto	(2.336)	(1.986)	(10.980)	(11.348)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	9.389	24.293	28.819	172.867
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(350)	(173)	(611)	(394)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	(228)	(350)
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(1.917)	(1.208)	(27.766)	(26.056)
Nettoausgleichskredite und (-gebühren)	(48)	44	1.046	65
Summe Finanzierungskosten	(2.315)	(1.337)	(27.559)	(26.735)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	7.074	22.956	1.260	146.132
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(153)	(3)	(69)	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	6.921	22.953	1.191	146.132
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 6.921	\$ 22.953	\$ 1.191	\$ 146.132

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge resultieren ausschließlich aus fortlaufenden Geschäftstätigkeiten.

Global High Yield Bond ESG Fund		Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund	
Berichtszeitraum vom 17. Jun. 2024 bis 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	
\$ 21	\$ 222.052	\$ 213.040	\$ 48.929	\$ 32.154	\$ 24.639	\$ 26.758	
0	0	3.970	0	0	0	0	
0	(234.761)	(320.703)	(65.200)	(38.347)	(18.854)	(22.734)	
2	(51.169)	31.909	(17.057)	(11.095)	1.795	19.436	
(5)	1.191	(10.330)	155	(293)	(968)	72	
5	69.362	483.163	(6.215)	55.391	(7.646)	35.544	
5	(80.499)	69.898	(16.874)	1.426	8.091	(20.176)	
0	(1.902)	(1.441)	(356)	(179)	169	338	
28	(75.726)	469.506	(56.618)	39.057	7.226	39.238	
(2)	(32.337)	(35.438)	(5.679)	(4.209)	(3.238)	(4.389)	
0	(838)	(1.200)	0	0	(8)	(12)	
0	(541)	(591)	(1.174)	(798)	0	0	
0	(68)	(70)	(1)	(1)	(1)	(1)	
(2)	(33.784)	(37.299)	(6.854)	(5.008)	(3.247)	(4.402)	
0	451	445	0	0	0	0	
(2)	(33.333)	(36.854)	(6.854)	(5.008)	(3.247)	(4.402)	
26	(109.059)	432.652	(63.472)	34.049	3.979	34.836	
0	(640)	(989)	(3.571)	(3.342)	(16.981)	(8.678)	
0	0	0	0	0	0	0	
0	(52.555)	(49.362)	(13.489)	(7.612)	(2.657)	(3.796)	
0	(7.393)	482	483	(440)	1.172	(29)	
0	(60.588)	(49.869)	(16.577)	(11.394)	(18.466)	(12.503)	
26	(169.647)	382.783	(80.049)	22.655	(14.487)	22.333	
0	(103)	(188)	30	(56)	16	(46)	
0	0	0	0	0	0	0	
26	(169.750)	382.595	(80.019)	22.599	(14.471)	22.287	
\$ 26	\$ (169.750)	\$ 382.595	\$ (80.019)	\$ 22.599	\$ (14.471)	\$ 22.287	

## Betriebsergebnisrechnung (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	Global Real Return Fund		Income Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum vom 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 25.003	\$ 29.916	\$ 2.031.317	\$ 1.539.543
Sonstige Erträge	0	1.734	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(31.534)	(65.319)	(823.916)	(890.181)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	25.222	15.092	(203.745)	866.814
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(1.065)	(3.548)	11.180	(34.847)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(54.610)	129.216	(704.341)	977.376
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	10.118	(11.965)	102.408	(257.063)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	2.683	736	13.949	36.810
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(24.183)	95.862	426.852	2.238.452
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(7.184)	(8.243)	(352.531)	(287.322)
Servicegebühr	(104)	(152)	(7.247)	(6.709)
Bestandspflegegebühr	(88)	(103)	(20.611)	(15.644)
Sonstige Aufwendungen	(1)	(2)	(1.845)	(1.729)
Gesamtaufwendungen	(7.377)	(8.500)	(382.234)	(311.404)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	506	499
Betriebskosten, netto	(7.377)	(8.500)	(381.728)	(310.905)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	(31.560)	87.362	45.124	1.927.547
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(29.278)	(19.567)	(6.148)	(8.155)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(10.651)	(16.743)	(1.232.307)	(968.561)
Nettoausgleichskredite und (-gebühren)	4.361	46	15.660	(2.574)
Summe Finanzierungskosten	(35.568)	(36.264)	(1.222.795)	(979.290)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	(67.128)	51.098	(1.177.671)	948.257
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	16	(1)	(2.091)	(8.186)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	(443)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	(67.112)	51.097	(1.179.762)	939.628
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ (67.112)	\$ 51.097	\$ (1.179.762)	\$ 939.628

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge resultieren ausschließlich aus fortlaufenden Geschäftstätigkeiten.

Income Fund II		Inflation Multi-Asset Fund		Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 5.754	\$ 2.160	\$ 2.709	\$ 4.991	\$ 20.688	\$ 21.660	\$ 22.082	\$ 14.194
0	0	0	2	0	447	0	0
(394)	(190)	(4.397)	(2.963)	(8.813)	(18.982)	(7.127)	(5.391)
(2.638)	(405)	(134)	616	(2.558)	(7.707)	(4.127)	127
(161)	122	738	1.000	(172)	9	(159)	(334)
(1.765)	886	(704)	7.057	440	19.793	(9.854)	10.639
(2.044)	(69)	5.396	(4.752)	5.944	1.302	(7.366)	2.379
2	24	(24)	72	(130)	(417)	(128)	(66)
(1.246)	2.528	3.584	6.023	15.399	16.105	(6.679)	21.548
(1.466)	(531)	(1.332)	(2.281)	(2.113)	(2.723)	(2.383)	(1.994)
0	0	0	0	(20)	(32)	0	0
0	0	(14)	(21)	(15)	(25)	0	0
(1)	(2)	0	0	0	(1)	0	0
(1.467)	(533)	(1.346)	(2.302)	(2.148)	(2.781)	(2.383)	(1.994)
0	0	0	0	64	83	0	0
(1.467)	(533)	(1.346)	(2.302)	(2.084)	(2.698)	(2.383)	(1.994)
(2.713)	1.995	2.238	3.721	13.315	13.407	(9.062)	19.554
(77)	(71)	(660)	(64)	(3.254)	(3.162)	(609)	(532)
0	0	0	0	0	0	0	0
(6.018)	(1.680)	(245)	(323)	(867)	(879)	(462)	(248)
202	58	66	(4)	82	(99)	0	(2)
(5.893)	(1.693)	(839)	(391)	(4.039)	(4.140)	(1.071)	(782)
(8.606)	302	1.399	3.330	9.276	9.267	(10.133)	18.772
10	(28)	(109)	(181)	(52)	(20)	(29)	(40)
0	0	0	0	(92)	0	0	0
(8.596)	274	1.290	3.149	9.132	9.247	(10.162)	18.732
\$ (8.596)	\$ 274	\$ 1.290	\$ 3.149	\$ 9.132	\$ 9.247	\$ (10.162)	\$ 18.732

## Betriebsergebnisrechnung (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Income Fund		Low Duration Opportunities Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 60.538	\$ 31.699	\$ 17.912	\$ 23.132
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(6.159)	(17.630)	(12.954)	(20.610)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	2.051	10.780	7.850	(1.233)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	1.007	(423)	421	8.451
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(38.535)	23.985	(1.040)	34.966
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	7.383	23.185	9.013	40.725
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	841	558	(334)	76
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	27.126	72.154	20.868	85.507
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(6.786)	(4.028)	(1.827)	(2.886)
Servicegebühr	0	0	(5)	(8)
Bestandspflegegebühr	(19)	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	0	(1)
Gesamtaufwendungen	(6.806)	(4.029)	(1.832)	(2.895)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	95	106
Betriebskosten, netto	(6.806)	(4.029)	(1.737)	(2.789)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	20.320	68.125	19.131	82.718
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(202)	(275)	(146)	(269)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(13.140)	(2.284)	(8.663)	(4.241)
Nettoausgleichskredite und (-gebühren)	357	224	(395)	(255)
Summe Finanzierungskosten	(12.985)	(2.335)	(9.204)	(4.765)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	7.335	65.790	9.927	77.953
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	11	(3)	(42)	89
Kapitalertragsteuer	0	0	(80)	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	7.346	65.787	9.805	78.042
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 7.346	\$ 65.787	\$ 9.805	\$ 78.042

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge resultieren ausschließlich aus fortlaufenden Geschäftstätigkeiten.

Low Duration Opportunities ESG Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 131	\$ 103	\$ 2.634	\$ 2.443	\$ 31.637	\$ 23.325	\$ 58.602	\$ 31.119
0	0	0	0	0	6	0	36
3	20	2.921	1.586	(3.576)	(58.626)	(5.065)	(16.459)
34	(47)	6.895	3.968	(5.459)	10.480	246.538	109.846
1	(4)	(1)	22	683	(1.185)	(307)	(370)
(101)	(6)	3.173	(3.390)	(5.551)	66.020	(24.634)	24.785
41	37	1.678	771	3.981	(11.895)	49.713	85.329
(3)	(1)	(3)	6	43	1.457	(106)	8
106	102	17.297	5.406	21.758	29.582	324.741	234.294
(14)	(13)	(552)	(565)	(4.090)	(2.614)	(8.070)	(4.906)
0	0	0	0	(46)	(44)	(49)	(37)
0	0	0	0	0	(4)	0	0
0	0	0	0	0	0	(73)	(5)
(14)	(13)	(552)	(565)	(4.136)	(2.662)	(8.192)	(4.948)
0	0	0	0	0	0	0	0
(14)	(13)	(552)	(565)	(4.136)	(2.662)	(8.192)	(4.948)
92	89	16.745	4.841	17.622	26.920	316.549	229.346
(3)	0	(23)	(20)	(566)	(7.636)	(877)	(184)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	(1)	(710)	(658)	(2.362)	(1.407)	(802)	(434)
0	0	(10)	(35)	(630)	(450)	(1)	7
(4)	(1)	(743)	(713)	(3.558)	(9.493)	(1.680)	(611)
88	88	16.002	4.128	14.064	17.427	314.869	228.735
2	0	(187)	(333)	0	0	(41)	1
0	0	0	0	0	0	0	0
90	88	15.815	3.795	14.064	17.427	314.828	228.736
\$ 90	\$ 88	\$ 15.815	\$ 3.795	\$ 14.064	\$ 17.427	\$ 314.828	\$ 228.736

## Betriebsergebnisrechnung (Fortsetzung)

	PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 254	\$ 207	\$ 12.427	\$ 12.823
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(86)	(46)	(1.857)	(6.895)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.185	686	(4.117)	10.817
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	3	(22)	(99)	(522)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(135)	13	2.336	11.162
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	419	886	(1.034)	(3.915)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(1)	0	53	264
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	1.639	1.724	7.709	23.734
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(39)	(36)	(2.965)	(3.208)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	(46)	(46)
Gesamtaufwendungen	(39)	(36)	(3.011)	(3.254)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	1	1	0	0
Betriebskosten, netto	(38)	(35)	(3.011)	(3.254)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>1.601</b>	<b>1.689</b>	<b>4.698</b>	<b>20.480</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	0	0	(729)	(117)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	(3.049)	(2.691)
Nettoausgleichskredite und (-gebühren)	0	0	(671)	(62)
Summe Finanzierungskosten	0	0	(4.449)	(2.870)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>1.601</b>	<b>1.689</b>	<b>249</b>	<b>17.610</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	1	0	(585)	(704)
Kapitalertragsteuer	0	0	(27)	(5)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>1.602</b>	<b>1.689</b>	<b>(363)</b>	<b>16.901</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ 1.602</b>	<b>\$ 1.689</b>	<b>\$ (363)</b>	<b>\$ 16.901</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge resultieren ausschließlich aus fortlaufenden Geschäftstätigkeiten.

Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 93.009	\$ 84.744	\$ 5.848	\$ 9.305	£ 7.167	£ 7.122	£ 7.860	£ 6.796
0	4.080	0	0	0	30	0	83
(79.254)	(54.618)	(587)	2.055	(17.962)	(8.084)	(3.555)	(13.392)
(2.726)	(7.773)	1.834	(28.724)	975	4.123	1.414	2.534
(374)	(2.910)	(394)	(1.749)	332	(10)	439	27
(56.223)	117.352	(3.478)	(6.449)	10.128	(3.359)	(12.271)	(2.332)
25.638	(29.541)	(5.980)	15.082	(82)	(2.489)	(2.270)	(1.462)
(306)	219	(26)	95	(549)	(65)	(658)	(31)
(20.236)	111.553	(2.783)	(10.385)	9	(2.732)	(9.041)	(7.777)
(15.406)	(16.143)	(1.334)	(2.635)	(547)	(671)	(747)	(721)
(705)	(873)	(8)	(5)	0	0	0	0
(429)	(446)	0	0	0	0	0	0
(18)	(20)	0	0	0	0	0	0
(16.558)	(17.482)	(1.342)	(2.640)	(547)	(671)	(747)	(721)
0	0	38	44	33	5	0	0
(16.558)	(17.482)	(1.304)	(2.596)	(514)	(666)	(747)	(721)
(36.794)	94.071	(4.087)	(12.981)	(505)	(3.398)	(9.788)	(8.498)
(3.031)	(500)	(40)	(216)	(430)	(317)	(122)	(141)
0	0	0	0	0	0	0	0
(11.560)	(10.113)	(744)	(1.312)	(4.768)	(3.656)	(808)	(797)
437	(16)	(129)	12	409	(161)	6	(7)
(14.154)	(10.629)	(913)	(1.516)	(4.789)	(4.134)	(924)	(945)
(50.948)	83.442	(5.000)	(14.497)	(5.294)	(7.532)	(10.712)	(9.443)
274	(192)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(50.674)	83.250	(5.000)	(14.497)	(5.294)	(7.532)	(10.712)	(9.443)
\$ (50.674)	\$ 83.250	\$ (5.000)	\$ (14.497)	£ (5.294)	£ (7.532)	£ (10.712)	£ (9.443)

## Betriebsergebnisrechnung (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 60.475	\$ 61.723	\$ 11.857	\$ 9.367
Sonstige Erträge	0	365	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(43.133)	(62.031)	(3.702)	(4.417)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	2.346	12.692	976	1.316
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	4	42	(21)	210
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	30.308	107.278	(4.490)	8.433
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(8.836)	(2.449)	(4.965)	3.982
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(9)	(33)	15	(65)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	41.155	117.587	(330)	18.826
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(6.133)	(6.895)	(1.481)	(1.212)
Servicegebühr	(431)	(471)	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	0	0
Gesamtaufwendungen	(6.565)	(7.367)	(1.481)	(1.212)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(6.565)	(7.367)	(1.481)	(1.212)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	34.590	110.220	(1.811)	17.614
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(206)	(151)	(282)	(36)
Aufwand für Kreditfazilitäten	(144)	(254)	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(9.626)	(10.534)	(2.217)	(1.917)
Nettoausgleichskredite und (-gebühren)	(292)	115	(90)	89
Summe Finanzierungskosten	(10.268)	(10.824)	(2.589)	(1.864)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	24.322	99.396	(4.400)	15.750
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	0	(27)	(39)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	24.322	99.396	(4.427)	15.711
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 24.322	\$ 99.396	\$ (4.427)	\$ 15.711

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge resultieren ausschließlich aus fortlaufenden Geschäftstätigkeiten.

\* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2024 und zum 30. Juni 2023 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 51.490	\$ 47.173	\$ 4.462.387	\$ 3.621.191
0	0	11	23.737
(3.887)	(28.034)	(2.286.659)	(3.311.905)
(1.192)	2.688	337.677	833.179
61	(876)	(9.708)	(90.477)
6.047	44.606	(940.773)	3.658.223
8.679	(3.479)	(171.471)	744.967
(42)	(18)	(182.425)	47.262
61.156	62.060	1.209.039	5.526.177
(3.773)	(4.354)	(713.705)	(660.693)
(14)	(24)	(11.497)	(11.708)
0	0	(24.223)	(19.017)
(1)	(1)	(3.366)	(2.639)
(3.788)	(4.379)	(752.791)	(694.057)
330	371	4.414	5.159
(3.458)	(4.008)	(748.377)	(688.898)
57.698	58.052	460.662	4.837.279
(59)	(231)	(119.434)	(92.810)
0	0	(576)	(604)
(20.022)	(15.308)	(1.660.370)	(1.342.840)
9	(44)	14.543	(7.256)
(20.072)	(15.583)	(1.765.837)	(1.443.510)
37.626	42.469	(1.305.175)	3.393.769
(4)	0	(16.185)	(14.296)
0	0	602	(1.134)
37.622	42.469	(1.320.758)	3.378.339
\$ 37.622	\$ 42.469	\$ (1.320.758)	\$ 3.378.339

## Ausweis der Nettovermögensänderungen

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund		PIMCO Balanced Income and Growth Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.434.728	\$ 2.981.392	\$ 177.208	\$ 313.987	\$ 670.116	\$ 750.076
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	281.871	461.927	75.070	64.256	424.105	39.784
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	502	2.598	613	681	12	4
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(416.964)	(621.025)	(42.990)	(57.745)	(140.280)	(167.583)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	184.592	(28.721)	4.349	(1.360)	38.776	46.306
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.484.729	\$ 2.796.171	\$ 214.250	\$ 319.819	\$ 992.729	\$ 668.587
	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund		Diversified Income ESG Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 7.439.798	\$ 8.751.796	\$ 412.839	\$ 564.684	\$ 57.563	\$ 9.854
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	1.306.262	888.864	35.971	16.092	317	50.269
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	8.564	7.326	19	25	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(944.984)	(1.974.800)	(79.496)	(91.148)	(4.063)	(1.754)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(62.822)	269.531	11.027	31.914	(955)	(380)
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 7.746.818	\$ 7.942.717	\$ 380.360	\$ 521.567	\$ 52.862	\$ 57.989
	Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 3.846.285	\$ 3.305.979	\$ 2.693.921	\$ 2.492.475	\$ 157.713	\$ 168.986
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	904.696	493.414	507.292	298.339	1.099	3.563
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.248	1.331	704	527	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(641.398)	(544.652)	(295.868)	(522.493)	(6.575)	(16.892)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	22.286	133.575	(22.424)	93.485	(1.413)	4.076
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 4.134.117	\$ 3.389.647	\$ 2.883.625	\$ 2.362.333	\$ 150.824	\$ 159.733

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 5.137.886	\$ 5.721.591	\$ 262.316	\$ 292.655	\$ 858.902	\$ 1.369.877	\$ 100.063	\$ 97.153
564.042	1.152.469	70.397	95.287	121.200	235.884	30.059	4.461
3.998	4.901	4	2	0	0	0	0
(1.070.705)	(1.317.218)	(30.331)	(106.394)	(202.412)	(518.107)	(10.371)	(5.449)
0	0	0	0	0	0	0	0
69.717	(111.741)	(6.894)	7.974	20.875	(114.488)	690	3.631
\$ 4.704.938	\$ 5.450.002	\$ 295.492	\$ 289.524	\$ 798.565	\$ 973.166	\$ 120.441	\$ 99.796
Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 3.445.573	\$ 3.483.601	€ 3.262.045	€ 5.115.170	\$ 2.880.941	\$ 1.919.668	\$ 102.408	\$ 6.609
276.243	187.421	117.536	263.195	571.824	1.046.430	23.992	446
647	705	15	35	1.134	1.071	2	2
(274.257)	(513.546)	(944.187)	(1.054.085)	(685.823)	(376.800)	(8.688)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
50.747	209.112	62.330	(66.104)	(95.846)	195.074	(4.327)	635
\$ 3.498.953	\$ 3.367.293	€ 2.497.739	€ 4.258.211	\$ 2.672.230	\$ 2.785.443	\$ 113.387	\$ 7.692
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund		Euro Bond Fund	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 282.790	\$ 205.131	\$ 19.946	\$ 20.937	\$ 271.208	\$ 237.961	€ 1.671.713	€ 1.913.275
41.575	38.588	2.624	2.533	78.839	109.092	252.091	242.427
38	22	0	0	77	432	0	0
(12.038)	(24.892)	(5.024)	(4.403)	(55.284)	(93.899)	(325.231)	(444.809)
0	0	0	0	0	0	0	0
6.584	11.719	(150)	1.016	(6.911)	1.106	(30.729)	42.668
\$ 318.949	\$ 230.568	\$ 17.396	\$ 20.083	\$ 288.622	\$ 254.692	€ 1.567.844	€ 1.753.561

## Ausweis der Nettovermögensänderungen (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	€ 537.186	€ 610.008	€ 1.387.227	€ 1.352.980	€ 923.969	€ 110.048
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	47.495	84.231	244.798	130.742	326.914	362.362
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	8	13	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(68.698)	(101.995)	(157.742)	(249.609)	(11.098)	(26.818)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(1.222)	17.695	1.322	28.044	(82.477)	4.373
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	€ 514.761	€ 609.939	€ 1.475.613	€ 1.262.170	€ 1.157.308	€ 449.965
	Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 13.077.262	\$ 11.420.112	\$ 3.561.180	\$ 3.106.190	\$ 800.126	\$ 716.022
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	4.182.289	3.108.542	824.189	814.491	199.931	79.619
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.819	1.646	6.611	3.499	737	454
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.777.721)	(2.235.847)	(366.321)	(627.987)	(123.419)	(88.472)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(141.590)	317.257	(132.835)	48.641	6.921	22.953
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 15.343.059	\$ 12.611.710	\$ 3.892.824	\$ 3.344.834	\$ 884.296	\$ 730.576
	Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund		Income Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum vom 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 1.177.052	\$ 1.364.375	\$ 2.381.093	\$ 2.571.862	\$ 70.543.117	\$ 57.980.327
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	34.476	254.055	208.918	270.535	17.869.038	13.763.965
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	13	1.675	1.724	96.671	77.852
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(189.071)	(387.573)	(360.788)	(384.549)	(8.495.910)	(8.234.205)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(14.471)	22.287	(67.112)	51.097	(1.179.762)	939.628
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 1.007.987	\$ 1.253.157	\$ 2.163.786	\$ 2.510.669	\$ 78.833.154	\$ 64.527.567

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

<b>Euro Short-Term Fund</b>		<b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>		<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b>		<b>Global Advantage Fund</b>	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
€ 193.514	€ 353.095	€ 367.767	€ 174.162	€ 130.610	€ 211.172	\$ 432.290	\$ 410.459
75.099	23.762	28.137	108.227	842.813	25.909	5.198	2.120
0	0	0	0	0	0	0	0
(65.469)	(167.912)	(61.954)	(65.889)	(37.013)	(90.342)	(1.410)	(6.904)
0	0	0	0	0	0	0	0
4.564	4.414	8.033	8.173	5.697	1.139	(14.933)	5.940
€ 207.708	€ 213.359	€ 341.983	€ 224.673	€ 942.107	€ 147.878	\$ 421.145	\$ 411.615
<b>Global High Yield Bond Fund</b>		<b>Global High Yield Bond ESG Fund</b>		<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>		<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum vom 17. Jun. 2024 bis 30. Jun. 2024		Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 2.980.250	\$ 3.102.868	\$ 0		\$ 10.713.722	\$ 10.538.341	\$ 2.170.207	\$ 1.369.890
551.142	494.510	9.752		1.267.841	2.744.657	357.317	754.616
2.021	1.377	0		1.786	2.085	26	12
(528.635)	(675.051)	0		(2.684.286)	(3.174.827)	(230.070)	(327.768)
0	0	0		0	0	0	0
1.191	146.132	26		(169.750)	382.595	(80.019)	22.599
\$ 3.005.969	\$ 3.069.836	\$ 9.778		\$ 9.129.313	\$ 10.492.851	\$ 2.217.461	\$ 1.819.349
<b>Income Fund II</b>		<b>Inflation Multi-Asset Fund</b>		<b>Low Average Duration Fund</b>		<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 125.160	\$ 56.623	\$ 253.248	\$ 403.078	\$ 809.845	\$ 1.072.758	\$ 972.843	\$ 654.749
193.217	86.951	8.759	13.707	85.604	71.088	107.723	159.600
27	17	72	73	317	306	313	172
(71.064)	(46.148)	(55.016)	(95.829)	(160.490)	(267.387)	(151.676)	(35.036)
0	0	0	0	0	0	0	0
(8.596)	274	1.290	3.149	9.132	9.247	(10.162)	18.732
\$ 238.744	\$ 97.717	\$ 208.353	\$ 324.178	\$ 744.408	\$ 886.012	\$ 919.041	\$ 798.217

## Ausweis der Nettovermögensänderungen (Fortsetzung)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Income Fund		Low Duration Opportunities Fund		Low Duration Opportunities ESG Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.030.305	\$ 1.084.380	\$ 787.624	\$ 1.345.781	\$ 5.221	\$ 4.928
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	418.268	437.266	7.705	248.767	0	0
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	50	58	1.215	1.437	1	1
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(159.531)	(132.106)	(76.281)	(552.650)	0	0
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	7.346	65.787	9.805	78.042	90	88
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.296.438	\$ 1.455.385	\$ 730.068	\$ 1.121.377	\$ 5.312	\$ 5.017
	Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 449.949	\$ 506.557	\$ 4.420.051	\$ 4.150.717	\$ 240.346	\$ 435.924
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	52.703	20.350	489.293	670.578	31.019	111.465
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	10	13	6.618	5.200	5	4
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(49.425)	(81.885)	(738.585)	(583.376)	(42.571)	(230.532)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(363)	16.901	(50.674)	83.250	(5.000)	(14.497)
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 452.874	\$ 461.936	\$ 4.126.703	\$ 4.326.369	\$ 223.799	\$ 302.364
	US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*			
	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023		
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 1.854.206	\$ 2.310.115	\$ 165.102.555	\$ 151.524.519		
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	349.961	328.573	37.086.911	32.330.533		
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	16.999	12.934	159.888	131.146		
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(262.569)	(627.187)	(24.340.921)	(29.325.755)		
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	(282.036)	265.492		
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	37.622	42.469	(1.320.758)	3.378.339		
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 1.996.219	\$ 2.066.904	\$ 176.405.639	\$ 158.304.274		

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

\* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2024 und zum 30. Juni 2023 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>		<b>Mortgage Opportunities Fund</b>		<b>StocksPLUS™ Fund</b>		<b>PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
\$ 98.493	\$ 120.137	\$ 925.256	\$ 849.148	\$ 1.962.988	\$ 1.008.739	\$ 11.175	\$ 9.528
13.281	4.956	360.999	82.072	1.769.769	825.580	553	1.073
2	2	432	198	794	429	0	0
(15.113)	(31.799)	(84.444)	(328.509)	(407.848)	(259.525)	(1.207)	(743)
0	0	0	0	0	0	0	0
15.815	3.795	14.064	17.427	314.828	228.736	1.602	1.689
\$ 112.478	\$ 97.091	\$ 1.216.307	\$ 620.336	\$ 3.640.531	\$ 1.803.959	\$ 12.123	\$ 11.547
<b>UK Corporate Bond Fund</b>		<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>		<b>US High Yield Bond Fund</b>		<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>	
Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2024	Berichtszeitraum zum 30. Jun. 2023
£ 361.061	£ 389.173	£ 324.768	£ 325.020	\$ 1.872.887	\$ 1.984.922	\$ 480.861	\$ 388.522
17.754	35.847	19.635	1.886	237.976	289.270	122.851	144.702
0	0	1	1	1.372	1.930	33	30
(129.862)	(82.653)	(2.105)	(19.552)	(389.253)	(397.917)	(105.430)	(104.172)
0	0	0	0	0	0	0	0
(5.294)	(7.532)	(10.712)	(9.443)	24.322	99.396	(4.427)	15.711
£ 243.659	£ 334.835	£ 331.587	£ 297.912	\$ 1.747.304	\$ 1.977.601	\$ 493.888	\$ 444.793

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>								<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>								<b>Colombia Government International Bond</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								8,750 % fällig am 14.11.2053 \$ 300 \$ 316 0,01				
Emeco Pty. Ltd. 6,250 % fällig am 10.07.2026 AUD	11.810	\$ 7.670	0,31	New Metro Global Ltd. 4,500 % fällig am 02.05.2026	5.200	3.170	0,13	Summe Kolumbien		6.343	0,25	
Perenti Finance Pty. Ltd. 7,500 % fällig am 26.04.2029	\$ 400	408	0,01	PCPD Capital Ltd. 5,125 % fällig am 18.06.2026	15.384	13.321	0,54	<b>FRANKREICH</b>				
Summe Australien		8.078	0,32	Seazen Group Ltd. 4,450 % fällig am 13.07.2025	8.100	6.072	0,24	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>BERMUDA</b>								<b>BNP Paribas S.A.</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(g) 1.100 1.112 0,04				
China Oil & Gas Group Ltd. 4,700 % fällig am 30.06.2026	800	736	0,03	Shui On Development Holding Ltd. 5,500 % fällig am 03.03.2025	3.400	2.801	0,11	9,250 % fällig am 17.11.2027 (e)(g) 4.100 4.358 0,18	<b>Credit Agricole S.A.</b>			
<b>KAIMANINSELN</b>								7,250 % fällig am 23.09.2028 (e)(g) € 5.400 5.981 0,24				
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>								Summe Frankreich 11.451 0,46				
Alibaba Group Holding Ltd. 0,500 % fällig am 01.06.2031	6.500	6.290	0,25	Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % Bargeld oder 6,250 % PIK) 5,250 % fällig am 30.09.2027 (b) 8.972 902 0,04	<b>HONGKONG</b>							
Cathay Pacific Finance Ltd. 2,750 % fällig am 05.02.2026 HKD	72.000	9.660	0,39	Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % Bargeld oder 6,500 % PIK) 5,500 % fällig am 30.09.2027 (b) 17.388 1.627 0,06	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
JD.com, Inc. 0,250 % fällig am 01.06.2029	\$ 3.500	3.292	0,13	Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % Bargeld oder 6,750 % PIK) 5,750 % fällig am 30.09.2028 (b) 36.548 3.139 0,13	Bank of East Asia Ltd. 4,000 % fällig am 29.05.2030 (g) \$ 7.300 7.143 0,29							
Meituan 0,000 % fällig am 27.04.2028 (c)	14.200	12.808	0,52	Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % Bargeld oder 7,000 % PIK) 6,000 % fällig am 30.09.2029 (b) 16.429 1.229 0,05	5,825 % fällig am 21.10.2025 (e)(g) 3.800 3.726 0,15							
Sunac China Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 30.09.2032	6.370	414	0,02	Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % Bargeld oder 7,250 % PIK) 6,250 % fällig am 30.09.2030 (b) 5.375 385 0,01	5,875 % fällig am 19.09.2024 (e)(g) 14.200 14.147 0,57							
Wynn Macau Ltd. 4,500 % fällig am 07.03.2029	11.800	12.116	0,49	Times China Holdings Ltd. 6,600 % fällig am 02.03.2023 ^ 7.236 206 0,01	6,750 % fällig am 16.07.2023 ^ 2.980 71 0,00							
Xiaomi Best Time International Ltd. 0,000 % fällig am 17.12.2027 (c)	5.200	4.842	0,19	VLL International, Inc. 5,750 % fällig am 28.11.2024	3.285	3.236	0,13	6,500 % fällig am 27.06.2034 (g) 10.200 10.140 0,41	<b>Central Plaza Development Ltd.</b>			
Summe Kaimaninseln		49.422	1,99	Weibo Corp. 3,500 % fällig am 05.07.2024	4.550	4.555	0,18	4,650 % fällig am 19.01.2026	3.400	3.184	0,13	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								Far East Horizon Ltd. 6,625 % fällig am 16.04.2027 10.000 10.044 0,40				
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,875 % fällig am 22.10.2030 ^	15.517	1.358	0,05	Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024	4.471	4.456	0,18	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 14.824	14.466	0,58	
4,200 % fällig am 06.02.2026 ^	8.300	740	0,03	5,125 % fällig am 15.12.2029	4.851	4.397	0,18	5,000 % fällig am 18.05.2026	\$ 20.900	19.467	0,78	
6,150 % fällig am 17.09.2025 ^	300	26	0,00	5,500 % fällig am 15.01.2026	28.044	27.475	1,11	5,050 % fällig am 27.01.2027	8.400	7.607	0,31	
eHi Car Services Ltd. 12,000 % fällig am 26.09.2027	17.464	16.069	0,65	5,500 % fällig am 01.10.2027	24.513	23.378	0,94	5,950 % fällig am 19.10.2025	6.600	6.355	0,26	
FWD Group Holdings Ltd. 5,000 % fällig am 24.09.2024	200	199	0,01	5,625 % fällig am 26.08.2028	17.730	16.639	0,67	Franshion Brilliant Ltd. 3,200 % fällig am 09.04.2026	3.000	2.713	0,11	
5,750 % fällig am 09.07.2024	200	200	0,01	Summe Kaimaninseln	455.876	18,35		4,250 % fällig am 23.07.2029	18.900	14.408	0,58	
6,375 % fällig am 13.09.2024 (e)	15.270	15.247	0,61					6,000 % fällig am 08.02.2026 (e)(h)	700	621	0,02	
7,635 % fällig am 02.07.2031 (a)	22.500	22.884	0,92					Fuqing Investment Management Ltd. 3,250 % fällig am 23.06.2025	3.900	3.614	0,15	
8,045 % fällig am 15.12.2024 (e)	11.100	10.874	0,44					GLP China Holdings Ltd. 2,950 % fällig am 29.03.2026	13.450	11.637	0,47	
8,400 % fällig am 05.04.2029	18.400	18.819	0,76					Huarong Finance Co. Ltd. 4,250 % fällig am 07.11.2027	6.569	6.074	0,24	
Geely Automobile Holdings Ltd. 4,000 % fällig am 09.12.2024 (e)	8.462	8.365	0,34					4,500 % fällig am 29.05.2029	7.700	6.986	0,28	
Greentown China Holdings Ltd. 4,700 % fällig am 29.04.2025	8.000	7.600	0,31					4,625 % fällig am 03.06.2026	13.577	13.088	0,53	
Health & Happiness International Holdings Ltd. 13,500 % fällig am 26.06.2026	21.235	22.608	0,91					4,750 % fällig am 27.04.2027	19.500	18.403	0,74	
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,500 % fällig am 30.06.2022 ^	17.900	649	0,03					4,875 % fällig am 22.11.2026	7.180	6.929	0,28	
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	15.750	571	0,02					5,000 % fällig am 19.11.2025	2.900	2.842	0,11	
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	13.200	445	0,02					Lai Sun MTN Ltd. 5,000 % fällig am 28.07.2026	9.100	6.047	0,24	
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^	20.200	732	0,03					Nanyang Commercial Bank Ltd. 3,800 % fällig am 20.11.2029 (g)	1.000	992	0,04	
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^	9.800	355	0,01					Ping'an Real Estate Capital Ltd. 3,450 % fällig am 29.07.2026	3.600	3.101	0,12	
11,250 % fällig am 09.04.2022 ^	6.700	243	0,01					Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,150 % fällig am 12.05.2025	3.900	3.363	0,14	
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	1.450	51	0,00					3,500 % fällig am 12.11.2029	7.400	4.133	0,17	
11,950 % fällig am 22.10.2022 ^	800	29	0,00					3,975 % fällig am 09.11.2027	24.200	15.378	0,62	
11,950 % fällig am 12.11.2023 ^	12.100	439	0,02					Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026	11.599	9.958	0,40	
KWG Group Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 10.08.2025 ^	16.723	1.137	0,05					Summe Hongkong	226.566	9,12		
Longfor Group Holdings Ltd. 3,850 % fällig am 13.01.2032	3.000	1.973	0,08					<b>INDIEN</b>				
3,950 % fällig am 16.09.2029	14.800	10.734	0,43					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
4,500 % fällig am 16.01.2028	6.400	5.074	0,20					Adani Green Energy Ltd. 4,375 % fällig am 08.09.2024 4.800 4.751 0,19				
Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	23.760	23.290	0,94					Adani Green Energy UP Ltd. 6,700 % fällig am 12.03.2042 16.200 14.983 0,60				
5,250 % fällig am 26.04.2026	11.324	10.950	0,44					Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. 4,200 % fällig am 04.08.2027 3.300 3.070 0,12				
5,375 % fällig am 04.12.2029	10.800	9.699	0,39					4,375 % fällig am 03.07.2029 3.400 3.047 0,12				
5,625 % fällig am 17.07.2027	8.250	7.883	0,32					Adani Renewable Energy RJ Ltd. 4,625 % fällig am 15.10.2039 3.968 3.187 0,13				
5,750 % fällig am 21.07.2028	39.977	37.487	1,51					Adani Transmission Step-One Ltd. 4,000 % fällig am 03.08.2026 8.130 7.710 0,31				
MGM China Holdings Ltd. 4,750 % fällig am 01.02.2027	32.155	30.656	1,23					Continuum Green Energy India Pvt 7,500 % fällig am 26.06.2033 9.000 8.934 0,36				
								<b>KOLUMBIEN</b>				
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
								Ecopetrol S.A. 5,875 % fällig am 28.05.2045 8.400 6.027 0,24				



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
6,750 % fällig am 18.04.2028 ^ \$	9.000	5.314	0,21	Brandywine Operating Partnership LP				NWD MTN Ltd.			
6,825 % fällig am 18.07.2026 ^	4.500	2.674	0,11	8,875 % fällig am 12.04.2029 \$	100	104	0,00	4,125 % fällig am 18.07.2029	\$ 891	\$ 694	0,03
6,850 % fällig am 14.03.2024 ^	66.171	38.488	1,55	Cantor Fitzgerald LP				Peak RE BVI Holding Ltd.			
6,850 % fällig am 03.11.2025 ^	39.900	23.650	0,95	7,200 % fällig am 12.12.2028	6.200	6.379	0,26	5,350 % fällig am 28.10.2025 (e)	7.270	7.062	0,28
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	4.450	2.585	0,11	Citigroup, Inc.				RKPF Overseas Ltd.			
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	20.600	12.267	0,49	7,125 % fällig am 15.08.2029 (e)	6.000	5.998	0,24	5,125 % fällig am 26.07.2026	16.550	5.236	0,21
Summe Sri Lanka		118.614	4,77	Freedom Mortgage Holdings LLC				5,200 % fällig am 12.01.2026	10.900	3.597	0,14
				9,125 % fällig am 15.05.2031	6.100	5.943	0,24	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.			
<b>THAILAND</b>								6,750 % fällig am 24.04.2033	7.830	7.883	0,32
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				Studio City Finance Ltd.			
Bangkok Bank PCL				U.S. Treasury Bonds				5,000 % fällig am 15.01.2029	17.300	15.242	0,61
5,000 % fällig am 23.09.2025 (e)(g)	23.300	22.737	0,92	1,875 % fällig am 15.11.2051	2.700	1.568	0,06	6,000 % fällig am 15.07.2025	12.163	12.141	0,49
Kasikornbank PCL				U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				6,500 % fällig am 15.01.2028	7.967	7.575	0,31
5,275 % fällig am 14.10.2025 (e)(g)	30.357	29.634	1,19	0,125 % fällig am 15.01.2032	51.572	44.669	1,80	Summe Jungferneisen (Britisch)		194.280	7,82
Summe Thailand		52.371	2,11	Summe USA		80.785	3,25	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
<b>TÜRKEI</b>				<b>VIETNAM</b>				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				STAASTEMISSIONEN				China Hongqiao Group Ltd.			
Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği A/S				Vietnam Debt & Asset Trading Corp.				7,750 % fällig am 27.03.2025	9.100	9.157	0,37
8,250 % fällig am 15.11.2028	6.100	6.254	0,25	1,000 % fällig am 10.10.2025	1.300	1.196	0,05	Yango Justice International Ltd.			
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				Vietnam Government International Bond				10,250 % fällig am 15.09.2022 ^	4.500	23	0,00
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,500 % fällig am 12.03.2028	888	841	0,03	Summe kurzfristige Instrumente		9.180	0,37
Diamond Ltd.				Summe Vietnam		2.037	0,08	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 2.345.204	94,38
7,950 % fällig am 28.07.2026	7.000	7.097	0,28	<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>				<b>AKTIEN</b>			
Lloyds Banking Group PLC				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
8,000 % fällig am 27.09.2029 (e)(g)	6.100	6.251	0,25	CAS Capital Ltd.				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	13.083.621	130.385	5,25
Standard Chartered PLC				4,000 % fällig am 12.07.2026 (e)	15.100	14.137	0,57	PIMCO Specialty Funds			
4,300 % fällig am 19.08.2028 (e)(g)	18.600	15.569	0,63	Central Plaza Development Ltd.				Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)	744.048	10.248	0,41
4,750 % fällig am 14.01.2031 (e)(g)	8.300	6.864	0,28	3,850 % fällig am 14.07.2025	3.700	3.516	0,14	Summe		140.633	5,66
6,000 % fällig am 26.07.2025 (e)(g)(i)	18.100	17.898	0,72	5,750 % fällig am 14.11.2024 (e)	1.500	1.476	0,06	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
7,750 % fällig am 15.08.2027 (e)(g)(i)	56.400	57.088	2,30	Champion Path Holdings Ltd.				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	48.700	4.872	0,20
7,875 % fällig am 08.03.2030 (e)(g)	10.800	10.847	0,44	4,500 % fällig am 27.01.2026	17.700	16.954	0,68	Summe Investmentfonds		\$ 145.505	5,86
Vedanta Resources Finance PLC				4,850 % fällig am 27.01.2028	9.100	8.287	0,33				
13,875 % fällig am 21.01.2027	9.400	9.304	0,37	Easy Tactic Ltd.							
13,875 % fällig am 09.12.2028	37.457	36.087	1,45	6,500 % fällig am 11.07.2025	1.722	56	0,00				
Vedanta Resources Ltd.				6,500 % fällig am 11.07.2027	55.964	1.860	0,08				
13,875 % fällig am 09.12.2028	7.332	7.022	0,28	6,500 % fällig am 11.07.2028	45.794	1.558	0,06				
Summe Großbritannien		174.027	7,00	LS Finance Ltd.							
<b>USA</b>				4,800 % fällig am 18.06.2026	2.300	2.105	0,08				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				NWD Finance BVI Ltd.							
AES Corp.				4,125 % fällig am 10.03.2028 (e)	23.655	14.388	0,58				
7,600 % fällig am 15.01.2055	2.450	2.482	0,10	4,800 % fällig am 29.07.2024 (e)	6.100	2.613	0,11				
Bayer U.S. Finance LLC				5,250 % fällig am 22.03.2026 (e)	32.800	26.732	1,08				
6,500 % fällig am 21.11.2033	6.600	6.754	0,27	6,150 % fällig am 16.03.2025 (e)	42.800	41.168	1,66				
6,875 % fällig am 21.11.2053	6.700	6.888	0,28								

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	159	\$ 55	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	1.487	894	0,04
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	42	52	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	390	367	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	67	(41)	0,00
				\$ 1.327	0,05
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 1.327	0,05

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2029	€ 110.800	\$ 360	0,02

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000 %	18.09.2029	£ 44.600	\$ (257)	(0,01)	
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	18.09.2029	INR 2.327.210	(36)	0,00	
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	18.09.2029	SGD 32.880	(105)	0,00	
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	18.09.2034	14.974	(70)	0,00	
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,250	18.09.2029	THB 1.935.300	521	0,02	
Erhalt	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,418	17.04.2029	552.000	4	0,00	
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	18.09.2029	3.431.870	(464)	(0,02)	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	\$ 19.400	(224)	(0,01)	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	37.550	(280)	(0,01)	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	13.300	(9)	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2031	2.400	89	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.12.2051	39.300	1.003	0,04	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	118.200	829	0,03	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	5.600	81	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	1.900	(23)	0,00	
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	57.100	243	0,01	
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2029	AUD 105.500	(575)	(0,02)	
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	105.500	1.853	0,07	
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	€ 15.900	232	0,01	
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	400	0	0,00	
						\$ 2.812	0,11
						\$ 3.172	0,13

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungsbetrags der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**OPTIONSKAUF****DEVIENOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens	
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,275	06.12.2024	206	\$ 25	\$ 52	0,01	
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	06.12.2024	167	21	32	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,350	06.12.2024	215	20	39	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	06.12.2024	251	23	36	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	14.01.2025	214	21	35	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	14.01.2025	250	20	31	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	23.01.2025	250	24	32	0,00	
BRC	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	111	12	17	0,00	
CBK	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.01.2025	250	26	47	0,01	
	Call - OTC USD versus CNH	7,450	14.02.2025	250	24	28	0,00	
MBC	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	18	2	3	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,375	14.02.2025	241	23	33	0,00	
SCX	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	83	8	13	0,00	
						\$ 249	\$ 398	0,02

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>**

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens	
BPS	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.12.2033	\$ 9.300	\$ (452)	\$ 40	\$ (412)	(0,02)	
BRC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	53.400	(1.560)	25	(1.535)	(0,06)	
MYC	Indonesia Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	62.800	(582)	(32)	(614)	(0,02)	
						\$ (2.594)	\$ 33	\$ (2.561)	(0,10)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000 %	20.06.2026	\$ 9.500	\$ (155)	\$ (907)	\$ (1.062)	(0,04)
CBK	Vietnam Government International Bond	1,000	20.12.2027	9.100	(263)	296	33	0,00
GST	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.06.2029	24.800	131	(25)	106	0,00
					\$ (287)	\$ (636)	\$ (923)	(0,04)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	\$ 55.883	PHP 3.285.920	\$ (95)	\$ (515)	\$ (610)	(0,02)

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	18.09.2029	MYR 132.020	\$ 224	\$ (43)	\$ 181	0,01
JPM	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2029	125.060	(135)	5	(130)	(0,01)
						\$ 89	\$ (38)	\$ 51	0,00

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2024	AUD	13.239	\$ 8.821	\$ 0	\$ (21)	0,00	
	07.2024	NZD	242	148	1	0	0,00	
	07.2024	\$	51	NZD 83	0	0	0,00	
BOA	08.2024	NZD	83	\$ 51	0	0	0,00	
	07.2024	€	55.544	60.304	775	0	775	0,03
	07.2024	HKD	2.827	362	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	\$	26.975	SGD 36.614	41	0	41	0,00
	08.2024	SGD	36.560	\$ 26.975	0	(41)	(41)	0,00
	02.2025	CNH	3.200	448	2	0	2	0,00
BRC	07.2024	IDR	213.317.627	13.032	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	\$	7.645	AUD 11.473	18	0	18	0,00
	08.2024	AUD	11.473	\$ 7.651	0	(18)	(18)	0,00
CBK	09.2024	CNH	70.140	9.777	114	0	114	0,00
	09.2024	TWD	1.782	55	0	0	0	0,00
	10.2024	CNH	302	42	1	0	1	0,00
CBK	12.2024	\$	816	CNH 5.852	0	(5)	(5)	0,00
	01.2025	CNH	6.329	\$ 886	6	0	6	0,00
	08.2024	TRY	400	11	0	0	0	0,00
DUB	09.2024	\$	1.065	29	0	(2)	(2)	0,00
	09.2024	\$	10.335	TRY 369.863	76	0	76	0,00
	02.2025	CNH	448	3.198	0	(2)	(2)	0,00
DUB	07.2024	£	448	\$ 569	3	0	3	0,00
	07.2024	THB	4.708	129	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	1.167	AUD 1.766	13	0	13	0,00
DUB	07.2024	€	1.052	981	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD	679	\$ 21	0	0	0	0,00
	09.2024	\$	20.230	INR 1.691.262	16	(8)	8	0,00
DUB	09.2024	\$	399	PHP 23.468	2	0	2	0,00
	01.2025	CNH	886	6.325	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	MYR	61.569	\$ 13.059	0	(2)	(2)	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
GLM	07.2024	\$ 12.803	MYR 60.302	\$ 0	\$ (11)	\$ (11)	0,00
JPM	07.2024	CNY 1.363	\$ 192	2	0	2	0,00
	07.2024	SGD 36.470	27.080	170	0	170	0,01
	07.2024	\$ 10.445	CNY 74.490	0	(112)	(112)	0,00
	07.2024	13.317	IDR 215.981.063	0	(118)	(118)	0,00
	08.2024	CNY 74.537	\$ 10.445	3	0	3	0,00
	08.2024	NZD 159	97	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 2.762	TRY 96.951	24	0	24	0,00
	09.2024	TWD 1.156	\$ 36	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 2.753	INR 230.688	7	0	7	0,00
	10.2024	CNH 62.998	\$ 8.805	102	0	102	0,00
	12.2024	5.855	816	4	0	4	0,00
MBC	07.2024	¥ 664.639	4.250	118	0	118	0,01
	07.2024	SGD 91	67	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 567	£ 448	0	0	0	0,00
	08.2024	£ 448	\$ 567	1	0	1	0,00
MYI	07.2024	€ 171	183	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 107	79	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 81	CHF 73	0	0	0	0,00
	07.2024	217	£ 171	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 460	\$ 14	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 1.841	INR 153.983	1	0	1	0,00
SCX	07.2024	CNY 73.075	\$ 10.276	142	0	142	0,01
	07.2024	\$ 58.459	€ 54.563	19	0	19	0,00
	08.2024	€ 54.563	\$ 58.545	0	(19)	(19)	0,00
	09.2024	CNH 48.682	6.786	79	0	79	0,00
	09.2024	TWD 669	21	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 12.489	INR 1.045.295	19	0	19	0,00
	09.2024	400	PHP 23.442	1	0	1	0,00
				\$ 1.760	\$ (372)	\$ 1.388	0,06

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschuttend und Investor AUD (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	07.2024	AUD 1.284	\$ 855	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07.2024	\$ 1.690	AUD 2.538	6	0	6	0,00
	08.2024	856	1.284	2	0	2	0,00
BOA	07.2024	7	10	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	AUD 1.284	\$ 855	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	\$ 856	AUD 1.284	2	0	2	0,00
BRC	07.2024	751	1.135	7	0	7	0,00
MBC	07.2024	AUD 22	\$ 15	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 63	AUD 95	0	0	0	0,00
				\$ 17	\$ (4)	\$ 13	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschuttend, E Class CHF (Hedged) thesaurierend und E Class CHF (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2024	\$ 1.899	CHF 1.708	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BRC	07.2024	CHF 5	\$ 5	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 39	CHF 35	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	CHF 16	\$ 17	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 163	CHF 149	2	0	2	0,00
MBC	07.2024	CHF 46	\$ 51	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.558	CHF 1.403	3	0	3	0,00
MYI	07.2024	CHF 38	\$ 43	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	\$ 135	CHF 121	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	CHF 1.712	\$ 1.908	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 1.885	CHF 1.704	11	0	11	0,00
	08.2024	1.908	1.706	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 21	\$ (3)	\$ 18	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 193	\$ 209	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2024	\$ 170.342	€ 156.898	0	(2.187)	(2.187)	(0,10)
BPS	07.2024	€ 146.594	\$ 156.797	0	(315)	(315)	(0,01)
	07.2024	\$ 173.421	€ 160.164	0	(1.765)	(1.765)	(0,07)
	08.2024	157.518	147.053	316	0	316	0,01
BRC	07.2024	€ 1.124	\$ 1.202	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	\$ 141.903	€ 131.039	0	(1.461)	(1.461)	(0,06)
CBK	07.2024	€ 182	\$ 196	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 326	€ 304	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	126	116	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2024	€ 150.476	\$ 160.904	0	(369)	(369)	(0,01)
	07.2024	\$ 342	€ 317	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	161.139	150.476	369	0	369	0,01
SCX	07.2024	€ 150.405	\$ 161.144	0	(53)	(53)	0,00
	07.2024	\$ 146	€ 136	0	0	0	0,00
	08.2024	161.381	150.405	51	0	51	0,00
				\$ 739	\$ (6.156)	\$ (5.417)	(0,23)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	£ 53	\$ 67	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	07.2024	13	17	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 15	£ 12	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	£ 14.967	\$ 18.939	18	0	18	0,01
	07.2024	\$ 462	£ 362	0	(5)	(5)	0,00
	08.2024	18.662	14.748	0	(16)	(16)	0,00
GLM	07.2024	£93	\$ 118	1	0	1	0,00
MBC	07.2024	14.883	18.833	19	0	19	0,01
	07.2024	\$ 19.059	£ 14.971	0	(133)	(133)	(0,01)
	08.2024	18.314	14.473	0	(16)	(16)	0,00
MYI	07.2024	18.248	14.327	0	(138)	(138)	(0,01)
SSB	07.2024	18.248	14.327	0	(137)	(137)	(0,01)
				\$ 38	\$ (445)	\$ (407)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Klasse Investor RMB (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	CNH 2	\$ 0	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BOA	07.2024	\$ 84	CNH 610	0	(1)	(1)	0,00
BRC	08.2024	84	613	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	74	533	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2024	6	43	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	84	606	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1	\$ (3)	\$ (2)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, E Class SGD (Hedged) ausschüttend und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 15.835	\$ 11.667	\$ 0	\$ (18)	\$ (18)	0,00
	07.2024	\$ 8.617	SGD 11.630	0	(35)	(35)	0,00
	08.2024	11.694	15.849	18	0	18	0,00
BPS	07.2024	SGD 15.857	\$ 11.692	0	(9)	(9)	0,00
	08.2024	\$ 11.692	SGD 15.834	9	0	9	0,00
BRC	07.2024	76	103	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	580	782	0	(3)	(3)	0,00
GLM	07.2024	SGD 172	\$ 128	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 1.551	SGD 2.088	0	(10)	(10)	0,00
MBC	07.2024	7.300	9.829	0	(47)	(47)	0,00
SCX	07.2024	8.676	11.691	0	(50)	(50)	(0,01)
UAG	07.2024	7.647	10.329	0	(26)	(26)	0,00
				\$ 28	\$ (198)	\$ (170)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (8.222) (0,33)

Summe Anlagen

\$ 2.486.986 100,09

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (2.257) (0,09)

Nettovermögen

\$ 2.484.729 100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,04 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Flourish Century	6,600 %	04.02.2022	25.08.2021 - 27.08.2021	\$ 10.747	\$ 419	0,02
Franshion Brilliant Ltd.	6,000	08.02.2026	10.05.2024	602	621	0,02
Goldman Sachs Finance Corp. International Ltd.	0,000	10.05.2027	25.04.2024	6.600	6.439	0,26
				<b>\$ 17.949</b>	<b>\$ 7.479</b>	<b>0,30</b>

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 19.311 USD (31. Dezember 2023: 13.246 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2023: 630 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 19.303 USD (31. Dezember 2023: 24.631 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 9.070 USD (31. Dezember 2023: 5.280 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.338.202	\$ 7.002	\$ 2.345.204
Investmentfonds	145.505	0	0	145.505
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	(3.723)	0	(3.723)
<b>Summen</b>	<b>\$ 145.505</b>	<b>\$ 2.334.479</b>	<b>\$ 7.002</b>	<b>\$ 2.486.986</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.166.143	\$ 1.794	\$ 2.167.937
Investmentfonds	207.288	4.856	0	212.144
Pensionsgeschäfte	0	3.856	0	3.856
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	8.798	0	8.798
<b>Summen</b>	<b>\$ 207.288</b>	<b>\$ 2.183.653</b>	<b>\$ 1.794</b>	<b>\$ 2.392.735</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	4,700 %	15.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (4.027)	\$ (4.099)	(0,16)
	4,750	15.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(9.084)	(9.248)	(0,37)
BRC	0,500	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.092)	(1.171)	(0,05)
	5,000	27.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (2.873)	(2.923)	(0,12)
MYI	0,250	18.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.821)	(1.952)	(0,08)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (19.393)</b>	<b>(0,78)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (13)	\$ 0	\$ (13)	\$ (65)	\$ 0	\$ (65)
BOA	(1.442)	1.750	308	(661)	350	(311)
BPS	(2.690)	2.810	120	(2.780)	2.630	(150)
BRC	(2.902)	3.230	328	975	(1.700)	(725)
CBK	124	0	124	(8)	0	(8)
DUB	(2)	0	(2)	(322)	440	118
GLM	(21)	0	(21)	87	0	87
GST	106	0	106	205	0	205
IND	k. A.	k. A.	k. A.	183	0	183
JPM	(658)	310	(348)	(678)	850	172
MBC	(22)	0	(22)	(78)	260	182
MYC	(614)	600	(14)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(137)	260	123	785	(1.300)	(515)
SCX	201	(60)	141	47	10	57
SSB	(137)	110	(27)	132	(220)	(88)
UAG	(15)	0	(15)	746	740	1.486

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	75,39	75,37
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	18,99	13,68
Investmentfonds	5,86	8,71
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,16
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,05	0,53
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,13	(0,11)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,33)	(0,06)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,78)	(0,53)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	0,32	0,81
Bermuda	0,03	k. A.
Brasilien	k. A.	0,30
Kaimaninseln	18,35	18,21
Chile	0,40	k. A.
China	0,30	1,95
Kolumbien	0,25	0,27
Frankreich	0,46	0,75
Hongkong	9,12	8,29
Indien	9,64	8,17
Indonesien	2,91	3,76
Italien	0,27	0,28
Japan	0,49	k. A.
Jersey, Kanalinseln	0,95	0,63
Mali Republik	0,31	0,29
Mauritius	5,52	6,77
Mexiko	1,33	0,30
Mongolei	1,83	1,87
Niederlande	2,06	1,48
Oman	k. A.	0,20
Pakistan	5,08	4,06
Peru	0,12	k. A.
Philippinen	3,03	3,62
Singapur	4,70	3,36
Südafrika	0,25	0,26
Südkorea	1,01	0,91
Sri Lanka	4,77	4,11
Thailand	2,11	2,45
Türkei	0,25	0,26
Großbritannien	7,00	5,25
USA	3,25	2,96
Vietnam	0,08	0,08
Jungfernseln (Britisch)	7,82	7,40
Kurzfristige Instrumente	0,37	0,00
Investmentfonds	5,86	8,71
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,16
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,05	0,53

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,02	(0,01)
Zinsswaps	0,11	(0,11)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,02	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,10)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,04)	(0,11)
Cross-Currency Swaps	(0,02)	(0,02)
Zinsswaps	0,00	0,01
Devisenterminkontrakte	0,06	(0,04)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,25)	0,10
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,09)	1,72
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Asia Strategic Interest Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
<b>AUSTRALIEN</b>								<b>KOLUMBIEN</b>				
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>								<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Brisbane Airport Corp. Pty. Ltd. 5,900 % fällig am 08.03.2034 AUD	1.200	\$ 807	0,38	Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	\$ 450	\$ 441	0,21	Ecopetrol S.A. 5,875 % fällig am 28.05.2045	\$ 700	\$ 502	0,23	
Emeco Pty. Ltd. 6,250 % fällig am 10.07.2026	450	292	0,13	MGM China Holdings Ltd. 4,750 % fällig am 01.02.2027	1.000	953	0,44	<b>FRANKREICH</b>				
Pacific National Finance Pty. Ltd. 4,750 % fällig am 22.03.2028 \$	600	573	0,27	5,250 % fällig am 26.04.2025	200	198	0,09	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Perenti Finance Pty. Ltd. 7,500 % fällig am 26.04.2029	500	510	0,24	5,375 % fällig am 04.12.2029	200	180	0,08	<b>BNP Paribas S.A.</b>				
Santos Finance Ltd. 5,250 % fällig am 13.03.2029	400	390	0,18	5,750 % fällig am 21.07.2028	500	469	0,22	9,250 % fällig am 17.11.2027 (d)(f)				
WestConnex Finance Co. Pty. Ltd. 6,150 % fällig am 09.10.2030 AUD	1.500	1.034	0,48	PCPD Capital Ltd. 5,125 % fällig am 18.06.2026	1.200	1.039	0,49	Credit Agricole S.A. 7,250 % fällig am 23.09.2028 (d)(f) €				
Woodside Finance Ltd. 3,700 % fällig am 15.09.2026 \$	1.000	962	0,45	Sands China Ltd. 2,300 % fällig am 08.03.2027 (h)	1.000	912	0,43	Summe Frankreich				
Summe Australien		4.568	2,13	5,400 % fällig am 08.08.2028	900	882	0,41	1.196 0,56				
<b>KAIMANINSELN</b>								<b>HONGKONG</b>				
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Alibaba Group Holding Ltd. 0,500 % fällig am 01.06.2031	500	484	0,23	Shui On Development Holding Ltd. 5,500 % fällig am 03.03.2025	300	247	0,12	AIA Group Ltd. 5,375 % fällig am 05.04.2034 \$				
Cathay Pacific Finance Ltd. 2,750 % fällig am 05.02.2026 HKD	6.000	805	0,38	5,500 % fällig am 29.06.2026	400	289	0,13	Bank of East Asia Ltd. 6,625 % fällig am 13.03.2027				
JD.com, Inc. 0,250 % fällig am 01.06.2029 \$	600	564	0,26	Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % Bargeld oder 6,000 % PIK) 5,000 % fällig am 30.09.2026 (b)	144	17	0,01	6,750 % fällig am 15.03.2027				
Meituan 0,000 % fällig am 27.04.2027 (c)	1.400	1.333	0,62	Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % Bargeld oder 6,500 % PIK) 5,500 % fällig am 30.09.2027 (b)	291	27	0,01	6,750 % fällig am 27.06.2034 (f)				
0,000 % fällig am 27.04.2028 (c)	500	451	0,21	Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % Bargeld oder 6,750 % PIK) 5,750 % fällig am 30.09.2028 (b)	1.285	110	0,05	China Cinda Management Ltd. 5,750 % fällig am 07.02.2027				
Sunac China Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 30.09.2032	242	15	0,01	Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % Bargeld oder 7,000 % PIK) 6,000 % fällig am 30.09.2029 (b)	434	32	0,01	Dah Sing Bank Ltd. 7,375 % fällig am 15.11.2033 (f)				
Wynn Macau Ltd. 4,500 % fällig am 07.03.2029	1.000	1.027	0,48	Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % Bargeld oder 7,250 % PIK) 6,250 % fällig am 30.09.2030 (b)	204	15	0,01	Far East Horizon Ltd. 6,625 % fällig am 16.04.2027				
Xiaomi Best Time International Ltd. 0,000 % fällig am 17.12.2027 (c)	900	838	0,39	Tencent Holdings Ltd. 3,240 % fällig am 03.03.2050	700	459	0,21	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026 €				
Summe Kaimaninseln		5.517	2,58	3,975 % fällig am 11.04.2029	1.700	1.616	0,75	5,050 % fällig am 27.01.2027 \$				
<b>CHILE</b>								5,950 % fällig am 19.10.2025				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>FRANSHION</b>				
AAC Technologies Holdings, Inc. 3,000 % fällig am 27.11.2024	800	791	0,37	Weibo Corp. 3,500 % fällig am 05.07.2024	1.138	1.139	0,53	3,200 % fällig am 09.04.2026				
3,750 % fällig am 02.06.2031	400	346	0,16	Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 15.01.2026	1.500	1.470	0,69	4,250 % fällig am 23.07.2029				
Alibaba Group Holding Ltd. 2,125 % fällig am 09.02.2031	800	661	0,31	5,500 % fällig am 01.10.2027	400	381	0,18	Fuqing Investment Management Ltd. 3,250 % fällig am 23.06.2025				
2,700 % fällig am 09.02.2041	800	538	0,25	5,625 % fällig am 26.08.2028	300	282	0,13	GLP China Holdings Ltd. 2,950 % fällig am 29.03.2026				
China Modern Dairy Holdings Ltd. 2,125 % fällig am 14.07.2026	1.400	1.297	0,61	Summe Kaimaninseln		26.768	12,49	Huarong Finance Co. Ltd. 4,250 % fällig am 07.11.2027				
CK Hutchison International Ltd. 4,750 % fällig am 21.04.2028	700	691	0,32	<b>CHINA</b>		32.285	15,07	4,625 % fällig am 03.06.2026				
4,875 % fällig am 21.04.2033	400	386	0,18	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,875 % fällig am 22.11.2026				
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,875 % fällig am 22.10.2030 ^	900	79	0,04	AES Andes S.A. 8,150 % fällig am 10.06.2055	300	301	0,14	5,000 % fällig am 19.11.2025				
4,800 % fällig am 06.08.2030 ^	1.500	124	0,06	<b>CHINA</b>				6,881 % fällig am 24.02.2025				
5,625 % fällig am 14.01.2030 ^	300	26	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					Lai Sun MTN Ltd. 5,000 % fällig am 28.07.2026			
eHi Car Services Ltd. 12,000 % fällig am 26.09.2027	768	707	0,33	China Life Insurance Overseas Co. Ltd. 5,350 % fällig am 15.08.2033	1.000	1.007	0,47	900 598 0,28				
FWD Group Holdings Ltd. 6,375 % fällig am 13.09.2024 (d)	650	649	0,30	Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022 ^ (g)	1.700	65	0,03	Lenovo Group Ltd. 5,831 % fällig am 27.01.2028				
7,635 % fällig am 02.07.2031 (a)	1.200	1.220	0,57	Greenland Global Investment Ltd. (6,875 % Bargeld oder 1,000 % PIK) 6,875 % fällig am 03.07.2030 (b)	1.177	130	0,06	6,536 % fällig am 27.07.2032				
7,784 % fällig am 06.12.2033	400	439	0,20	Huaxin Cement International Finance Co. Ltd. 2,250 % fällig am 19.11.2025	600	564	0,26	500 524 0,24				
8,400 % fällig am 05.04.2029	1.400	1.432	0,67	Midea Investment Development Co. Ltd. 2,880 % fällig am 24.02.2027	800	754	0,35	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,500 % fällig am 12.11.2029				
Geely Automobile Holdings Ltd. 4,000 % fällig am 09.12.2024 (d)	1.300	1.285	0,60	New Metro Global Ltd. 4,625 % fällig am 15.10.2025	440	309	0,15	3,975 % fällig am 09.11.2027				
Greentown China Holdings Ltd. 4,700 % fällig am 29.04.2025	700	665	0,31	4,800 % fällig am 15.12.2024	200	176	0,08	1.100 699 0,33				
Health & Happiness International Holdings Ltd. 13,500 % fällig am 26.06.2026	1.700	1.810	0,84	SF Holding Investment Ltd. 2,375 % fällig am 17.11.2026	400	374	0,18	Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026				
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	800	29	0,01	Yango Group Co. Ltd. 6,900 % fällig am 31.10.2022 ^ CNY	20.000	72	0,03	200 172 0,08				
11,250 % fällig am 09.04.2022 ^	500	18	0,01	Yango Justice International Ltd. 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	\$ 700	4	0,00	16.176 7,55				
11,950 % fällig am 22.10.2022 ^	300	11	0,01	Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	1.500	1.435	0,67	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
11,950 % fällig am 12.11.2023 ^	1.200	43	0,02	ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. 3,125 % fällig am 16.07.2025	1.350	1.305	0,61	<b>Airport Authority Hong Kong</b>				
Longfor Group Holdings Ltd. 3,950 % fällig am 16.09.2029	400	290	0,14	Summe China		6.195	2,89	2,100 % fällig am 08.03.2026 (d)				
								850 850 0,40				
								400 404 0,19				
								Summe Hongkong				
								18.466 8,62				
								<b>INDIEN</b>				
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
								Adani Electricity Mumbai Ltd. 3,949 % fällig am 12.02.2030				
								1.198 1.030 0,48				
								Adani Green Energy UP Ltd. 6,700 % fällig am 12.03.2042				
								1.000 925 0,43				
								Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. 4,375 % fällig am 03.07.2029				
								400 358 0,17				
								Adani Transmission Step-One Ltd. 4,000 % fällig am 03.08.2026				
								1.100 1.043 0,49				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Continuum Green Energy India Pvt 7,500 % fällig am 26.06.2033	\$ 800	\$ 794	0,37	Pertamina Persero PT 4,175 % fällig am 21.01.2050 6,450 % fällig am 30.05.2044	\$ 1.200	\$ 929	0,44	India Clean Energy Holdings 4,500 % fällig am 18.04.2027	\$ 200	\$ 184	0,09
GMR Hyderabad International Airport Ltd. 4,250 % fällig am 27.10.2027	1.100	1.031	0,48	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6,150 % fällig am 21.05.2048 6,250 % fällig am 25.01.2049	1.000	988	0,46	India Cleantech Energy 4,700 % fällig am 10.08.2026	1.194	1.139	0,53
HDFC Bank Ltd. 3,700 % fällig am 25.08.2026 (d)(f)	200	186	0,09	Summe Indonesien	500	498	0,23	India Green Power Holdings 4,000 % fällig am 22.02.2027	280	262	0,12
Indiabulls Housing Finance Ltd. 9,700 % fällig am 03.07.2027	800	785	0,37			12.102	5,65	Summe Mauritius		6.834	3,19
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032	1.000	891	0,41	<b>IRLAND</b>				<b>MEXIKO</b>			
IRB Infrastructure Developers Ltd. 7,110 % fällig am 11.03.2032	1.600	1.600	0,75	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 % fällig am 18.05.2031	380	338	0,16	SMBC Aviation Capital Finance DAC 5,450 % fällig am 03.05.2028	2.100	2.102	0,98	Banco Mercantil del Norte S.A. 6,750 % fällig am 27.09.2024 (d)(f)	1.260	1.254	0,59
JSW Steel Ltd. 5,050 % fällig am 05.04.2032	900	792	0,37	<b>ITALIEN</b>				Trust Fibra Uno 7,375 % fällig am 13.02.2034	500	494	0,23
Manappuram Finance Ltd. 7,375 % fällig am 12.05.2028	800	792	0,37	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Mexiko		1.748	0,82
Muthoot Finance Ltd. 7,125 % fällig am 14.02.2028	1.400	1.413	0,66	Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 500	485	0,23	<b>MONGOLEI</b>			
Network i2i Ltd. 3,975 % fällig am 03.03.2026 (d) 5,650 % fällig am 15.01.2025 (d)	200	190	0,09	<b>JAPAN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
NTPC Ltd. 4,250 % fällig am 26.02.2026	400	393	0,18	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				Mongolia Government International Bond 3,500 % fällig am 07.07.2027	350	316	0,15
Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	1.700	1.683	0,78	Resonac Holdings Corp. 0,000 % fällig am 29.12.2028 (c)	¥ 50.000	323	0,15	4,450 % fällig am 07.07.2031	300	253	0,12
Reliance Industries Ltd. 2,875 % fällig am 12.01.2032	400	339	0,16	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,125 % fällig am 07.04.2026	300	291	0,14
ReNew Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	900	874	0,41	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,063 % fällig am 12.09.2025	\$ 1.700	1.697	0,79	7,875 % fällig am 05.06.2029	200	205	0,09
+Shriram Finance Ltd. 4,150 % fällig am 18.07.2025 6,625 % fällig am 22.04.2027	958	935	0,44	SoftBank Group Corp. 3,125 % fällig am 06.01.2025 7,000 % fällig am 08.07.2031 (a)	508	498	0,24	8,650 % fällig am 19.01.2028	330	345	0,16
UltraTech Cement Ltd. 2,800 % fällig am 16.02.2031	700	701	0,33	Summe Japan		5.800	2,71	Summe Mongolei		1.410	0,66
		592	0,27	<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
		18.381	8,58	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Goldman Sachs Finance Corp. International Ltd. 0,000 % fällig am 10.05.2027 (c)(g)	500	488	0,23	ING Groep NV 8,000 % fällig am 16.05.2030 (d)(f)	500	511	0,24
Export-Import Bank of India 3,250 % fällig am 15.01.2030	1.000	902	0,42	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Mong Duong Finance Holdings BV 5,125 % fällig am 07.05.2029	1.265	1.203	0,56
Summe Indien		19.283	9,00	West China Cement Ltd. 4,950 % fällig am 08.07.2026	1.600	1.312	0,61	Prosus NV 4,193 % fällig am 19.01.2032	500	441	0,21
<b>INDONESIEN</b>				Summe Jersey, Kanalinseln		1.800	0,84	Yinson Boronia Production BV 8,947 % fällig am 31.07.2042	1.000	1.010	0,47
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>MALAYSIA</b>				Summe Niederlande		3.165	1,48
Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024	1.100	1.091	0,51	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>PAKISTAN</b>			
Bank Mandiri Persero Tbk PT 5,500 % fällig am 04.04.2026	800	800	0,37	Export-Import Bank of Malaysia Bhd. 1,831 % fällig am 26.11.2026	700	644	0,30	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3,750 % fällig am 30.03.2026 (f)	1.020	976	0,46	Summe Malaysia		4.891	2,28	Pakistan Government International Bond 6,000 % fällig am 08.04.2026	2.450	2.214	1,03
4,300 % fällig am 24.03.2027 (d)(f)	1.250	1.162	0,54	<b>MAURITIUS</b>				6,875 % fällig am 05.12.2027	1.400	1.214	0,57
5,280 % fällig am 05.04.2029	200	199	0,09	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				8,250 % fällig am 30.09.2025	900	860	0,40
Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7,750 % fällig am 10.02.2026	900	893	0,42	Khazanah Capital Ltd. 4,876 % fällig am 01.06.2033	300	294	0,14	8,875 % fällig am 08.04.2051	600	452	0,21
Cikarang Listrindo Tbk PT 4,950 % fällig am 14.09.2026	200	195	0,09	Khazanah Global Sukuk Bhd. 4,687 % fällig am 01.06.2028	700	689	0,32	Pakistan Water & Power Development Authority 7,500 % fällig am 04.06.2031	300	227	0,11
Freeport Indonesia PT 4,763 % fällig am 14.04.2027 5,315 % fällig am 14.04.2032	700	689	0,32	Misc Capital Two Labuan Ltd. 3,625 % fällig am 06.04.2025	2.600	2.562	1,19	Summe Pakistan		4.967	2,32
Indika Energy Tbk PT 8,750 % fällig am 07.05.2029	250	250	0,12	Petronas Capital Ltd. 2,480 % fällig am 28.01.2032 3,404 % fällig am 28.04.2061	400	333	0,16	<b>PERU</b>			
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 3,541 % fällig am 27.04.2032	500	432	0,20	Summe Philippinen		4.247	1,98	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Indonesia Asahan Aluminium PT 5,800 % fällig am 15.05.2050	800	736	0,34	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Banco de Credito del Peru S.A. 3,125 % fällig am 01.07.2030 (f)	200	193	0,09
Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT 5,375 % fällig am 23.03.2026	400	382	0,18	Export-Import Bank of Malaysia Bhd. 1,831 % fällig am 26.11.2026	700	644	0,30	<b>PHILIPPINEN</b>			
LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % fällig am 04.02.2039	619	624	0,29	Summe Malaysia		4.891	2,28	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Minejesa Capital BV 4,625 % fällig am 10.08.2030	186	179	0,08	CA Magnum Holdings 5,375 % fällig am 31.10.2026	1.600	1.527	0,71	Metropolitan Bank & Trust Co. 5,500 % fällig am 06.03.2034	900	897	0,42
Pakuwon Jati Tbk PT 4,875 % fällig am 29.04.2028	200	189	0,09	Greenko Dutch BV 3,850 % fällig am 29.03.2026	2.730	2.578	1,20	San Miguel Corp. 5,500 % fällig am 29.07.2025 (d)	500	490	0,23
				Greenko Power Ltd. 4,300 % fällig am 13.12.2028	174	159	0,08	San Miguel Global Power Holdings Corp. 7,000 % fällig am 21.10.2025 (d)	200	198	0,09
				Greenko Wind Projects Mauritius Ltd. 5,500 % fällig am 06.04.2025	1.000	985	0,46	Summe Philippinen		3.441	1,61

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>POLEN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>USA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Republic of Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 18.03.2054	\$ 900	\$ 875	0,41	Shinhan Card Co. Ltd. 2,500 % fällig am 27.01.2027	\$ 2.200	\$ 2.049	0,96	AES Corp. 7,600 % fällig am 15.01.2055	\$ 200	\$ 203	0,10
				5,500 % fällig am 12.03.2029	900	901	0,42	Bayer U.S. Finance LLC 6,500 % fällig am 21.11.2033	450	460	0,21
				Tongyang Life Insurance Co. Ltd. 5,250 % fällig am 22.09.2025 (d)	1.100	1.077	0,50	6,875 % fällig am 21.11.2053	500	514	0,24
						11.650	5,44	Brandywine Operating Partnership LP 8,875 % fällig am 12.04.2029	100	104	0,05
<b>SAUDI-ARABIEN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
Saudi Arabia Government International Bond 5,750 % fällig am 16.01.2054	1.100	1.075	0,50	Korea Housing Finance Corp. 4,875 % fällig am 27.08.2027	600	598	0,28	Cantor Fitzgerald LP 7,200 % fällig am 12.12.2028	400	411	0,19
				Korea National Oil Corp. 4,875 % fällig am 03.04.2028	600	596	0,28	Citigroup, Inc. 7,125 % fällig am 15.08.2029 (d)	500	500	0,23
				5,250 % fällig am 14.11.2026	2.200	2.199	1,02	Freedom Mortgage Holdings LLC 9,125 % fällig am 15.05.2031	400	390	0,18
						3.393	1,58	9,250 % fällig am 01.02.2029	100	100	0,05
				Summe Südkorea		15.973	7,45	Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. 5,000 % fällig am 27.07.2028	400	400	0,19
								Hyundai Capital America 2,750 % fällig am 27.09.2026	500	472	0,22
<b>SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>SRI LANKA STAATSEMISSIONEN</b>							
BOC Aviation Ltd. 3,500 % fällig am 10.10.2024	1.000	994	0,46	Sri Lanka Government International Bond 5,750 % fällig am 18.04.2023 ^	900	517	0,24	5,950 % fällig am 21.09.2026	1.600	1.613	0,75
Cathaylife Singapore Pte Ltd. 5,950 % fällig am 05.07.2034 (a)	1.100	1.104	0,52	6,200 % fällig am 11.05.2027 ^	1.100	648	0,30	Lendlease U.S. Capital, Inc. 4,500 % fällig am 26.05.2026	1.100	1.064	0,50
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. 4,250 % fällig am 25.03.2027	435	406	0,19	6,350 % fällig am 28.06.2024 ^	500	289	0,14				
GLP Pte. Ltd. 3,875 % fällig am 04.06.2025	1.300	1.205	0,56	6,750 % fällig am 18.04.2028 ^	400	236	0,11				
Medco Bell Pte. Ltd. 6,375 % fällig am 30.01.2027	478	470	0,22	6,825 % fällig am 18.07.2026 ^	500	297	0,14				
Medco Maple Tree Pte Ltd. 8,960 % fällig am 27.04.2029	500	524	0,25	6,850 % fällig am 14.03.2024 ^	1.100	640	0,30				
Medco Oak Tree Pte. Ltd. 7,375 % fällig am 14.05.2026	391	395	0,18	6,850 % fällig am 03.11.2025 ^	1.300	771	0,36				
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 4,602 % fällig am 15.06.2032 (f)	1.800	1.763	0,82	7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	900	536	0,25				
Singapore Airlines Ltd. 5,250 % fällig am 21.03.2034	1.000	1.027	0,48	Summe Sri Lanka		3.934	1,84	<b>US-SCHATZ Obligationen</b>			
United Overseas Bank Ltd. 1,750 % fällig am 16.03.2031 (f)	500	469	0,22					U.S. Treasury Notes 3,250 % fällig am 31.08.2024	3.400	3.387	1,58
Yinson Production Financial Services Pte Ltd. 9,625 % fällig am 03.05.2029	400	399	0,19					Summe USA		9.618	4,49
		8.756	4,09								
				<b>THAILAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Bangkok Bank PCL 4,300 % fällig am 15.06.2027	600	583	0,27	<b>VIETNAM STAATSEMISSIONEN</b>			
Singapore Government International Bond 3,250 % fällig am 01.06.2054 SGD 1.428		1.092	0,51	5,300 % fällig am 21.09.2028	1.150	1.150	0,54	Vietnam Debt & Asset Trading Corp. 1,000 % fällig am 10.10.2025	1.000	920	0,43
Summe Singapur		9.848	4,60					Vietnam Government International Bond 5,500 % fällig am 12.03.2028	1.850	1.753	0,82
				<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Vietnam		2.673	1,25
				Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. 4,875 % fällig am 25.07.2033	800	775	0,36	<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH) UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				NBK SPC Ltd. 5,500 % fällig am 06.06.2030	1.000	1.010	0,47	CAS Capital Ltd. 4,000 % fällig am 12.07.2026 (d)	600	562	0,26
				Summe Vereinigte Arabische Emirate		1.785	0,83	Central Plaza Development Ltd. 3,850 % fällig am 14.07.2025	200	190	0,09
				<b>GROSSBRITANNIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Champion Path Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 27.01.2026	600	575	0,27
				Diamond Ltd. 7,950 % fällig am 28.07.2026	1.000	1.014	0,47	Easy Tactic Ltd. 6,500 % fällig am 11.07.2027	753	25	0,01
				HSBC Holdings PLC 8,000 % fällig am 07.03.2028 (d)(f)	400	421	0,20	6,500 % fällig am 11.07.2028	1.896	65	0,03
				Lloyds Banking Group PLC 8,000 % fällig am 27.09.2029 (d)(f)	500	512	0,24	Joy Treasure Assets Holdings, Inc. 5,750 % fällig am 06.06.2029	600	598	0,28
				Prudential Funding Asia PLC 2,950 % fällig am 03.11.2033	500	445	0,21	NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % fällig am 10.03.2028 (d)	850	517	0,24
				Standard Chartered PLC 1,822 % fällig am 23.11.2025	1.400	1.377	0,64	4,800 % fällig am 29.07.2024 (d)	400	171	0,08
				3,603 % fällig am 12.01.2033	500	421	0,20	5,250 % fällig am 22.03.2026 (d)	2.200	1.793	0,84
				4,300 % fällig am 19.08.2028 (d)(f)	500	419	0,19	6,150 % fällig am 16.03.2025 (d)	900	866	0,40
				5,905 % fällig am 14.05.2035	500	496	0,23	Peak RE BVI Holding Ltd. 5,350 % fällig am 28.10.2025 (d)	800	777	0,36
				6,000 % fällig am 26.07.2025 (d)(f)	600	593	0,28	RKPF Overseas Ltd. 5,125 % fällig am 26.07.2026	1.000	316	0,15
				6,170 % fällig am 09.01.2027	1.500	1.511	0,70	Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	1.600	1.410	0,66
				6,187 % fällig am 06.07.2027	500	505	0,23	6,000 % fällig am 15.07.2025	400	399	0,18
				7,018 % fällig am 08.02.2030	1.500	1.585	0,74	6,500 % fällig am 15.01.2028	400	380	0,18
				7,750 % fällig am 15.08.2027 (d)(f)	800	810	0,38	Summe Jungfernseln (Britisch)		8.644	4,03
				7,875 % fällig am 08.03.2030 (d)(f)	300	301	0,14	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>			
				Vedanta Resources Finance PLC 13,875 % fällig am 21.01.2027	282	279	0,13	China Hongqiao Group Ltd. 7,750 % fällig am 27.03.2025	900	906	0,42
				13,875 % fällig am 09.12.2028	882	850	0,40	Summe kurzfristige Instrumente		906	0,42
				Vedanta Resources Ltd. 13,875 % fällig am 09.12.2028	470	450	0,21	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 203.811	95,13
				Summe Großbritannien		11.989	5,59				

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>INVESTMENTFONDS</b>				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				PIMCO ETFs plc - PIMCO			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	1.061.662	\$ 10.580	4,94	US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	10.100	\$ 1.010	0,47
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (e)	1.880	26	0,01	<b>Summe Investmentfonds</b>		<b>\$ 11.616</b>	<b>5,42</b>
		10.606	4,95				

**PENSIONS-GESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
SSB	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 527	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 28.02.2027	\$ (538)	\$ 527	\$ 527	0,25
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (538)</b>	<b>\$ 527</b>	<b>\$ 527</b>	<b>0,25</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	6	\$ (7)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	24	3	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	2	1	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	74	19	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	44	23	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	40	37	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	15	0	0,00
				\$ 76	0,04
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ 76</b>	<b>0,04</b>

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Mundys SpA	1,000 %	20.06.2025	€ 100	\$ 1	0,00

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>**

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Asia Ex-Japan IG-41 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2029	\$ 3.550	\$ (4)	0,00
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	(1,000)	20.06.2029	€ 8.700	27	0,01
				\$ 23	0,01

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000 %	18.09.2029	£ 3.800	\$ (22)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	18.09.2029	INR 200.140	(3)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	18.09.2029	SGD 2.560	(8)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	18.09.2034	1.168	(5)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,250	18.09.2029	THB 146.700	39	0,02
Erhalt	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,400	17.04.2029	41.440	1	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	18.09.2029	304.060	(41)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	\$ 1.600	(18)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	4.800	20	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	300	4	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	0,500 %	16.12.2025	AUD 800	\$ (11)	(0,01)
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2029	6.200	(71)	(0,03)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	6.200	162	0,07
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	€ 200	3	0,00
					\$ 50	0,02
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 74</b>	<b>0,03</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rücklerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rücklerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,275	06.12.2024	15	\$ 2	\$ 4	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	06.12.2024	13	2	2	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,350	06.12.2024	15	1	3	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	06.12.2024	19	2	3	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	14.01.2025	16	1	3	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	14.01.2025	20	1	2	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	23.01.2025	20	2	3	0,00
BRC	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	9	1	1	0,00
CBK	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.01.2025	20	2	4	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,450	14.02.2025	20	2	2	0,00
MBC	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	1	0	0	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,375	14.02.2025	19	2	3	0,00
SCX	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	7	1	1	0,00
					\$ 19	\$ 31	0,01

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHÜTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.12.2033	\$ 700	\$ (34)	\$ 3	\$ (31)	(0,02)
BRC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	4.000	(117)	2	(115)	(0,05)
					\$ (151)	\$ 5	\$ (146)	(0,07)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHÜTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000 %	20.06.2026	\$ 600	\$ (10)	\$ (57)	\$ (67)	(0,03)
GST	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.06.2029	2.000	11	(3)	8	0,01
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2029	5.200	72	(21)	51	0,02
JPM	Philippines Government International Bond	1,000	20.06.2029	1.300	24	(6)	18	0,01
					\$ 97	\$ (87)	\$ 10	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rücklerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

- (2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	\$ 4.321	PHP 254.080	\$ (7)	\$ (40)	\$ (47)	(0,03)

**ZINSSWAPS**

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	18.09.2029	MYR 10.160	\$ 17	\$ (3)	\$ 14	0,01
JPM	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2029	11.970	(13)	0	(13)	(0,01)
						\$ 4	\$ (3)	\$ 1	0,00

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 4.290	\$ 4.658	\$ 60	\$ 0	\$ 60	0,03
	07.2024	HKD 3.622	464	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 56	SGD 76	0	0	0	0,00
	08.2024	SGD 75	\$ 56	0	0	0	0,00
	02.2025	CNH 257	36	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	IDR 15.228.780	930	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 2.172	AUD 3.260	5	0	5	0,00
	07.2024	2.227	SGD 3.021	2	0	2	0,00
	08.2024	AUD 3.260	\$ 2.174	0	(5)	(5)	0,00
	08.2024	SGD 3.016	2.227	0	(2)	(2)	0,00
	09.2024	CNH 5.846	815	9	0	9	0,01
	09.2024	TWD 33	1	0	0	0	0,00
	12.2024	\$ 64	CNH 459	0	0	0	0,00
	01.2025	CNH 507	\$ 71	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 74	HKD 575	0	0	0	0,00
BRC	07.2024	3	THB 96	0	0	0	0,00
	07.2024	175	TRY 5.942	2	0	2	0,00
	08.2024	174	6.026	2	0	2	0,00
	09.2024	49	1.781	1	0	1	0,00
	02.2025	36	CNH 257	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	£ 39	\$ 50	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 35	1	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 1.502	INR 125.551	2	(1)	1	0,00
DUB	01.2025	71	CNH 507	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	MYR 4.467	\$ 947	0	0	0	0,00
FAR	07.2024	AUD 3.260	2.172	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	\$ 110	€ 103	0	0	0	0,00
	07.2024	309	¥ 49.235	0	(3)	(3)	0,00
GLM	08.2024	¥ 49.004	\$ 309	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 918	MYR 4.326	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	387	TRY 13.363	2	0	2	0,00
	09.2024	184	6.541	1	0	1	0,00
JPM	07.2024	SGD 2.808	\$ 2.085	13	0	13	0,01
	07.2024	\$ 283	CNY 2.019	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	951	IDR 15.418.923	0	(8)	(8)	0,00
	08.2024	CNY 2.020	\$ 283	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 204	INR 17.125	1	0	1	0,00
	10.2024	CNH 5.265	\$ 736	8	0	8	0,00
MBC	12.2024	459	64	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 49.277	315	9	0	9	0,00
	07.2024	SGD 158	117	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 4.638	€ 4.337	11	0	11	0,01
	07.2024	49	£ 39	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 4.337	\$ 4.645	0	(10)	(10)	0,00
	08.2024	£ 39	49	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MYI	07.2024	€ 10	\$ 11	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	SGD 235	174	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2	£ 1	0	0	0	0,00
	09.2024	137	INR 11.431	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	CNY 2.018	\$ 284	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 16	€ 15	0	0	0	0,00
	09.2024	CNH 4.078	\$ 568	7	0	7	0,00
	09.2024	\$ 927	INR 77.598	1	0	1	0,00
SSB	09.2024	60	PHP 3.514	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 47	\$ 51	1	0	1	0,00
				\$ 145	\$ (40)	\$ 105	0,06

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend und E Class EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 9	\$ 9	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 2.519	€ 2.321	0	(32)	(32)	(0,02)
CBK	07.2024	11	10	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 9	\$ 9	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	2.152	2.302	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	\$ 2.093	€ 1.923	0	(32)	(32)	(0,01)
MYI	08.2024	2.300	2.148	5	0	5	0,00
	08.2024	11	10	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	€ 2.147	\$ 2.300	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 2.362	€ 2.177	0	(28)	(28)	(0,01)
SSB	08.2024	2.301	2.144	1	0	1	0,00
	07.2024	€ 2.121	\$ 2.272	0	(1)	(1)	0,00
UAG	08.2024	\$ 2.275	€ 2.121	1	0	1	0,00
	07.2024	6	5	0	0	0	0,00
				\$ 7	\$ (99)	\$ (92)	(0,04)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2024	£ 134	\$ 169	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 155	£ 122	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	188	149	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	£ 125	\$ 159	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 161	£ 126	0	(1)	(1)	0,00
SCX	08.2024	159	125	0	0	0	0,00
	07.2024	161	126	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend und E Class SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 9.886	\$ 7.284	\$ 0	\$ (11)	\$ (11)	(0,01)
	07.2024	\$ 6.822	SGD 9.208	0	(29)	(29)	(0,02)
	08.2024	7.339	9.947	12	0	12	0,01
CBK	07.2024	393	529	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	SGD 63	\$ 47	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	\$ 6.540	SGD 8.834	0	(22)	(22)	(0,01)
	07.2024	539	728	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2024	239	322	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2024	6.861	9.245	0	(40)	(40)	(0,02)
UAG	07.2024	133	180	0	0	0	0,00
				\$ 12	\$ (107)	\$ (95)	(0,05)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (236) (0,11)

Summe Anlagen

\$ 215.868 100,76

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (1.618) (0,76)

Nettovermögen

\$ 214.250 100,00

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,32 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum		Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Flourish Century	6,600 %	04.02.2022	25.08.2021	-27.08.2021	\$ 1.676	\$ 65	0,03
Goldman Sachs Finance Corp. International Ltd.	0,000	10.05.2027		25.04.2024	500	488	0,23
					\$ 2.176	\$ 553	0,26

(h) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 547 USD (31. Dezember 2023: 546 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.485 USD (31. Dezember 2023: 1.422 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 320 USD (31. Dezember 2023: 320 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 203.186	\$ 625	\$ 203.811
Investmentfonds	11.616	0	0	11.616
Pensionsgeschäfte	0	527	0	527
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(7)	(79)	0	(86)
Summen	\$ 11.609	\$ 203.634	\$ 625	\$ 215.868

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 159.876	\$ 554	\$ 160.430
Investmentfonds	10.564	1.007	0	11.571
Pensionsgeschäfte	0	252	0	252
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(6)	649	0	643
Summen	\$ 10.558	\$ 161.784	\$ 554	\$ 172.896

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	4,300 %	22.11.2023	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (503)	\$ (516)	(0,24)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (516)	(0,24)

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ 37	\$ 0	\$ 37
BOA	k. A.	k. A.	k. A.	(34)	0	(34)
BPS	(55)	270	215	(95)	270	175
BRC	(109)	0	(109)	2	0	2
CBK	3	0	3	1	0	1
FAR	(5)	0	(5)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	(7)	0	(7)
GLM	(20)	0	(20)	11	0	11
GST	59	(60)	(1)	120	0	120
IND	k. A.	k. A.	k. A.	6	0	6
JPM	(31)	0	(31)	(63)	0	(63)
MBC	(22)	0	(22)	14	0	14
MYI	(1)	50	49	42	50	92
SCX	(56)	0	(56)	105	0	105
SSB	1	0	1	1	0	1
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	14	0	14

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	73,66	77,00
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	21,47	13,53
Investmentfonds	5,42	6,53
Pensionsgeschäfte	0,25	0,14
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	0,28
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,03	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,11)	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,24)	(0,28)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	2,13	2,72
Brasilien	k. A.	0,33
Kaimaninseln	15,07	14,34
Chile	0,14	k. A.
China	2,89	3,87
Kolumbien	0,23	k. A.
Frankreich	0,56	0,70
Hongkong	8,62	7,76
Indien	9,00	7,24
Indonesien	5,65	6,14
Irland	0,98	1,28
Italien	0,23	0,28
Japan	2,71	2,02
Jersey, Kanalinseln	0,84	0,45
Luxemburg	k. A.	0,26
Malaysia	2,28	2,78
Mauritius	3,19	4,08
Mexiko	0,82	0,45
Mongolei	0,66	0,67
Niederlande	1,48	0,97
Pakistan	2,32	1,82
Peru	0,09	k. A.
Philippinen	1,61	1,47
Polen	0,41	k. A.
Saudi-Arabien	0,50	k. A.
Singapur	4,60	3,36
Südafrika	0,25	k. A.
Südkorea	7,45	10,65
Sri Lanka	1,84	1,23
Thailand	1,97	2,39
Türkei	k. A.	0,24
Vereinigte Arabische Emirate	0,83	0,45
Großbritannien	5,59	4,36
USA	4,49	3,88
Vietnam	1,25	1,53
Jungferninseln (Britisch)	4,03	2,81

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kurzfristige Instrumente	0,42	k. A.
Investmentfonds	5,42	6,53
Pensionsgeschäfte	0,25	0,14
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,04	0,28
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,01	(0,02)
Zinsswaps	0,02	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,01	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,07)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,04)
Cross-Currency Swaps	(0,03)	(0,03)
Zinsswaps	0,00	0,01
Devisenterminkontrakte	0,06	(0,04)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,09)	0,19
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,76)	2,43
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Balanced Income and Growth Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Al Silk Midco Ltd. 8,785 % fällig am 04.03.2031	€ 1.000	\$ 1.064	0,11	Santander UK Group Holdings PLC 6,833 % fällig am 21.11.2026	\$ 2.500	\$ 2.534	0,26	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.04.2054	\$ 6.118	\$ 5.770	0,58
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
ABN AMRO Bank NV 6,875 % fällig am 22.09.2031 (h)(j)	1.600	1.739	0,18	Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034	1.900	1.961	0,20	5,000 % fällig am 01.11.2053 - 01.05.2054	22.960	22.200	2,24
AIB Group PLC 7,125 % fällig am 30.10.2029 (h)(j)	1.700	1.825	0,18	Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % Bargeld oder 6,000 % PIK) 5,000 % fällig am 30.09.2026 (c)	31	4	0,00	5,500 % fällig am 01.04.2054	7.155	7.059	0,71
Alamo Re Ltd. 16,605 % fällig am 07.06.2026	\$ 260	257	0,03	Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % Bargeld oder 6,250 % PIK) 5,250 % fällig am 30.09.2027 (c)	31	3	0,00	6,000 % fällig am 01.10.2053	8.853	8.883	0,90
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	216	194	0,02	Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % Bargeld oder 6,500 % PIK) 5,500 % fällig am 30.09.2027 (c)	62	6	0,00	6,500 % fällig am 01.11.2053 - 01.12.2053	10.983	11.187	1,13
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % fällig am 02.03.2026	€ 2.000	2.168	0,22	Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % Bargeld oder 7,000 % PIK) 6,000 % fällig am 30.09.2029 (c)	94	8	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2054	6.500	5.535	0,56
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,381 % fällig am 13.03.2029	\$ 600	602	0,06	Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % Bargeld oder 7,250 % PIK) 6,250 % fällig am 30.09.2030 (c)	44	3	0,00	3,500 % fällig am 01.08.2054	13.800	12.217	1,23
6,033 % fällig am 13.03.2035	600	599	0,06	UBS Group AG 4,125 % fällig am 09.06.2033	€ 1.700	1.840	0,19	4,000 % fällig am 01.08.2054	13.000	11.903	1,20
Banco Santander S.A. 5,538 % fällig am 14.03.2030	300	298	0,03	6,537 % fällig am 12.08.2033	\$ 3.100	3.255	0,33	4,500 % fällig am 01.08.2054	7.900	7.450	0,75
6,753 % fällig am 14.03.2028	200	202	0,02	UniCredit SpA 5,459 % fällig am 30.06.2035	1.400	1.312	0,13	5,000 % fällig am 01.07.2054	18.800	18.171	1,83
6,938 % fällig am 07.11.2033	1.200	1.312	0,13	VICI Properties LP 3,875 % fällig am 15.02.2029	800	740	0,07	5,500 % fällig am 01.08.2054	24.800	24.458	2,46
Bank of America Corp. 1,102 % fällig am 24.05.2032	€ 2.000	1.799	0,18	4,625 % fällig am 01.12.2029	800	758	0,08	6,000 % fällig am 01.08.2054	43.300	43.407	4,37
5,875 % fällig am 15.03.2028 (h)	\$ 602	600	0,06	5,750 % fällig am 01.04.2034	100	99	0,01	6,500 % fällig am 01.07.2054 - 01.08.2054	33.600	34.195	3,44
Barclays PLC 4,347 % fällig am 08.05.2035	€ 1.600	1.719	0,17	6,125 % fällig am 01.04.2034	100	96	0,01	7,000 % fällig am 01.08.2054	2.100	2.159	0,22
4,972 % fällig am 16.05.2029	\$ 800	783	0,08	Wells Fargo & Co. 1,741 % fällig am 04.05.2030	€ 1.800	1.762	0,18				
BPCE S.A. 7,003 % fällig am 19.10.2034	2.000	2.140	0,22	Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	\$ 1.300	7	0,00				
CaixaBank S.A. 5,673 % fällig am 15.03.2030	200	199	0,02			55.731	5,62				
6,037 % fällig am 15.06.2035	200	201	0,02	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
Credit Agricole S.A. 6,500 % fällig am 23.09.2029 (h)(j)	€ 1.600	1.718	0,17	American Airlines Pass-Through Trust 3,575 % fällig am 15.07.2029	386	365	0,04	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	5.700	3.599	0,37
Danske Bank A/S 3,875 % fällig am 09.01.2032	1.700	1.813	0,18	Bayer U.S. Finance LLC 6,500 % fällig am 21.11.2033	200	205	0,02	4,000 % fällig am 15.11.2042	3.040	2.802	0,28
Deutsche Bank AG 1,750 % fällig am 19.11.2030	1.900	1.792	0,18	Carvana Co. (13,000 % PIK) 13,000 % fällig am 01.06.2030 (c)	1.059	1.108	0,11	4,000 % fällig am 15.11.2052	2.290	2.087	0,21
Erste Group Bank AG 7,000 % fällig am 15.04.2031 (h)(j)	1.600	1.687	0,17	Choice Hotels International, Inc. 5,850 % fällig am 01.08.2034 (b)	100	99	0,01	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g) 0,125 % fällig am 15.04.2026	8.249	7.881	0,79
Ford Motor Credit Co. LLC 6,050 % fällig am 05.03.2031	\$ 2.600	2.604	0,26	Energy Transfer LP 3,750 % fällig am 15.05.2030	2.100	1.932	0,19	0,625 % fällig am 15.02.2043	1.773	1.332	0,13
HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034	1.800	1.875	0,19	Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	1.300	1.213	0,12	0,875 % fällig am 15.02.2047	1.559	1.172	0,12
ING Groep NV 5,550 % fällig am 19.03.2035	300	296	0,03	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 15.08.2029	2.800	2.552	0,26	1,125 % fällig am 15.01.2033	15.261	14.126	1,42
Intesa Sanpaolo SpA 4,950 % fällig am 01.06.2042	2.700	2.019	0,20			7.474	0,75	1,375 % fällig am 15.07.2033	3.200	3.023	0,31
JPMorgan Chase & Co. 2,522 % fällig am 22.04.2031	1.200	1.038	0,11	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>U.S. Treasury Notes</b>			
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	650	24	0,00	Pacific Gas & Electric Co. 2,500 % fällig am 01.02.2031	1.100	907	0,09	4,375 % fällig am 30.11.2030	22.500	22.523	2,27
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	1.100	37	0,00	5,900 % fällig am 15.06.2032	5.700	5.707	0,58	4,500 % fällig am 31.03.2026	5.400	5.372	0,54
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	250	9	0,00			6.614	0,67	4,500 % fällig am 15.04.2027	5.500	5.493	0,55
Lloyds Banking Group PLC 3,875 % fällig am 14.05.2032	€ 1.700	1.819	0,18	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		69.819	7,04			69.410	6,99
Mizuho Financial Group, Inc. 5,382 % fällig am 10.07.2030 (b)	\$ 300	300	0,03	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
5,594 % fällig am 10.07.2035 (b)	300	299	0,03	Multiplan Corp. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK) 6,000 % fällig am 15.10.2027 (c)	1.400	987	0,10	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 4,819 % fällig am 25.02.2036	31	27	0,00
Morgan Stanley 5,148 % fällig am 25.01.2034	€ 1.500	1.745	0,18	Sunac China Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 30.09.2032	52	3	0,00	4,912 % fällig am 25.07.2036	90	75	0,01
Nationwide Building Society 2,972 % fällig am 16.02.2028	\$ 2.100	1.969	0,20			990	0,10	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 5,760 % fällig am 25.04.2037	1.285	1.111	0,11
NatWest Group PLC 6,016 % fällig am 02.03.2034	1.900	1.944	0,20	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>Cheshire PLC</b>			
Nomura Holdings, Inc. 5,594 % fällig am 02.07.2027 (b)	200	200	0,02	Fannie Mae 1,130 % fällig am 25.03.2036 (a)	95	9	0,00	7,334 % fällig am 20.08.2045	£ 1.231	1.562	0,16
5,783 % fällig am 03.07.2034 (b)	200	199	0,02	Freddie Mac 0,000 % fällig am 15.05.2035	162	147	0,02	Countrywide Alternative Loan Trust 5,760 % fällig am 25.07.2035	\$ 838	635	0,06
6,580 % fällig am 02.07.2027 (b)	200	201	0,02	0,652 % fällig am 15.08.2043 (a)	299	34	0,00	5,780 % fällig am 25.09.2047	168	149	0,01
Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC 0,000 % fällig am 05.04.2032 (e)	1.700	1.111	0,11	Ginnie Mae 6,233 % fällig am 20.09.2071	6.173	6.187	0,62	6,000 % fällig am 25.04.2037	696	571	0,06
				6,246 % fällig am 20.08.2068	745	736	0,07	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 6,080 % fällig am 25.04.2035	102	87	0,01
				Ginnie Mae, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2054	2.000	1.744	0,18	Dilosk RMB DAC 4,470 % fällig am 25.01.2063	€ 1.500	1.610	0,16
								Eurosail PLC 6,353 % fällig am 13.06.2045	£ 1.234	1.485	0,15
								First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 6,000 % fällig am 25.02.2037	\$ 44	17	0,00
								Great Hall Mortgages PLC 5,613 % fällig am 18.06.2038	£ 1.343	1.682	0,17
								5,653 % fällig am 18.06.2039	1.500	1.856	0,19
								5,813 % fällig am 18.06.2038	3.900	4.721	0,48
								HomeBanc Mortgage Trust 6,320 % fällig am 25.08.2029	\$ 239	228	0,02
								Impac CMB Trust 6,080 % fällig am 25.04.2035	152	139	0,01
								6,105 % fällig am 25.04.2035	196	174	0,02
								IndyMac Mortgage Loan Trust 5,780 % fällig am 25.04.2037	1.610	1.344	0,14
								6,020 % fällig am 25.07.2035	87	61	0,01
								Lehman XS Trust 5,860 % fällig am 25.08.2046	1.002	910	0,09
								Madison Avenue Mortgage Trust 3,294 % fällig am 15.08.2034	1.137	1.057	0,11
								MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 5,940 % fällig am 25.05.2037	555	225	0,02







## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
CPFL Energia S.A.	14.600	\$ 86	0,01	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				
Endesa S.A.	23.380	440	0,04	Bancolumbia S.A.				<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				
Enel SpA (d)	634.282	4.404	0,44	0,000 %				5,384 % fällig am				
Energisa S.A.	17.700	145	0,01	Cia Energetica de Minas Gerais				15.08.2024 (b)(e)(f) \$ 1.200 \$ 1.192 0,12				
Engie Brasil Energia S.A.	12.900	103	0,01	0,000 %				5,386 % fällig am				
Fortum Oyj (d)	29.717	435	0,04	Cia Paranaense de Energia				01.08.2024 (e)(f) 12.200 12.145 1,22				
Iberdrola S.A. (d)	11.931	155	0,02	0,000 %				5,388 % fällig am				
Kansai Electric Power Co., Inc. (d)	55.300	929	0,09	Gerdau S.A.				29.08.2024 (e)(f) 1.100 1.091 0,11				
Kunlun Energy Co. Ltd.	304.000	315	0,03	108.600 359 0,04				5,407 % fällig am				
Osaka Gas Co. Ltd. (d)	26.700	590	0,06	Nationwide Building Society				24.09.2024 (e)(f) 1.400 1.383 0,14				
Power Grid Corp. of India Ltd. (d)	365.518	1.448	0,15	10,250 %				15.811 1,59				
Sembcorp Industries Ltd.	69.700	247	0,02	1.490 246 0,02				Summe kurzfristige Instrumente 15.811 1,59				
SE PLC (d)	76.315	1.723	0,17	Petroleo Brasileiro S.A.				Summe Übertragbare Wertpapiere \$ 1.088.778 109,68				
Tenaga Nasional Bhd.	203.200	594	0,06	0,000 %				AKTIEN				
Tokyo Gas Co. Ltd. (d)	28.300	609	0,06	64.293 2.952 0,30				INVESTMENTFONDS				
Verbund AG	5.308	420	0,04	372.600 2.552 0,26				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
Vistra Corp.	21.482	1.847	0,19	6.673 0,67				PIMCO Select Funds plc -				
Zhejiang Zhenheng Electric Power Co. Ltd. 'A' (d)	60.800	60	0,01	REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS				PIMCO US Dollar				
				Nippon Building Fund, Inc. 34 119 0,01				Short-Term Floating				
				Simon Property Group, Inc. 25.459 3.865 0,39				NAV Fund (i) 3.996.272 39.825 4,01				
				3.984 0,40				Summe Investmentfonds \$ 39.825 4,01				
				17.561 1,77								
				570.532 57,47								

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
DEU	5,350 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 5.000	U.S. Treasury Bonds 5,375 % fällig am 15.02.2031	\$ (5.100)	\$ 5.000	\$ 5.002	0,50
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	761	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(776)	761	761	0,08
GSC	5,400	28.06.2024	01.07.2024	1.200	Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.11.2052	(1.240)	1.200	1.201	0,12
SSB	2,600	28.06.2024	01.07.2024	207	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	(211)	207	207	0,02
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (7.327)</b>	<b>\$ 7.168</b>	<b>\$ 7.171</b>	<b>0,72</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	48	\$ (33)	0,00
CAC 40 Index July Futures	Short	07.2024	5	8	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Short	09.2024	2	(2)	0,00
Euro STOXX 50 September Futures	Short	09.2024	11	2	0,00
FTSE 100 Index September Futures	Long	09.2024	24	(2)	0,00
FTSE China A50 Index July Futures	Long	07.2024	187	(12)	0,00
FTSE/JSE Index September Futures	Short	09.2024	1	0	0,00
IBEX 35 July Futures	Long	07.2024	2	(1)	0,00
Mini MSCI Emerging Markets Index September Futures	Short	09.2024	7	(2)	0,00
MSCI Singapore Index July Futures	Short	07.2024	59	(12)	0,00
OMXS30 Index July Futures	Short	07.2024	10	(1)	0,00
S&P CNX Nifty Index July Futures	Long	07.2024	16	14	0,00
S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures	Long	09.2024	6	11	0,00
SPI 200 Index September Futures	Short	09.2024	7	(4)	0,00
Topix Index September Futures	Short	09.2024	15	(29)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	46	16	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	53	(47)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	42	(26)	0,00
WIG20 Index September Futures	Long	09.2024	40	23	0,00
				<b>\$ (97)</b>	<b>(0,01)</b>
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (97)</b>	<b>(0,01)</b>

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 41 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2029	€ 1.130	\$ 6	0,00
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	(1,000)	20.06.2029	4.770	7	0,00
				\$ 13	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000 %	20.12.2028	\$ 4.455	\$ (23)	0,00
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000	20.06.2029	25.300	(32)	(0,01)
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	930	(1)	0,00
				\$ (56)	(0,01)

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	18.09.2034	£ 2.400	\$ 5	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	21.000	(178)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	¥ 690.000	(15)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,125	12.10.2024	18.020.000	1	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	300.000	31	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	21.03.2034	573.500	14	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	18.09.2034	703.900	1	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	\$ 800	(9)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	3.100	(64)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	6.100	(69)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	4.000	(91)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	5.100	(57)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	23.920	50	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,308	21.02.2029	10.400	(85)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	26.600	157	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	27.240	44	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	19.140	(244)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	1.600	10	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	6.000	(95)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	400	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	3.700	52	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	900	35	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2031	13.100	(68)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	15.300	134	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	4.500	18	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	200	(1)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2036	10.100	(528)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,760	23.08.2033	7.135	(39)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	4.504	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	30.08.2033	4.300	(21)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	475	6	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.06.2027	7.600	(50)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	1.700	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2034	7.600	170	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,256	04.01.2027	BRL 19.800	(98)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,604	04.01.2027	27.900	(150)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	20.03.2034	CAD 1.700	(1)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	18.09.2034	1.300	(13)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,750	19.06.2029	NZD 2.500	4	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	AUD 5.100	30	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 5.600	(102)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	300	2	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,673	31.05.2029	MXN 600	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,680	31.05.2029	1.000	2	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,681	31.05.2029	1.300	3	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,683	31.05.2029	500	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,700	05.11.2027	63.500	(53)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,720	07.03.2029	400	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,725	07.03.2029	1.000	2	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,730	07.03.2029	600	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,760	01.03.2029	1.700	3	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,770	01.03.2029	800	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,780	01.03.2029	800	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,810	29.05.2031	900	2	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,073 %	03.06.2027	MXN 2.700	\$ 3	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,260	03.06.2027	1.600	2	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,340	03.06.2027	2.800	3	0,00
					\$ (1.258)	(0,12)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (1.301)</b>	<b>(0,13)</b>

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSoPTIONEN

#### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final / Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	8.200	\$ (359)	\$ (291)	(0,03)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 3.100	\$ (16)	\$ 18	\$ 2	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.900	\$ (9)	\$ 1	\$ (8)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	12.200	(40)	8	(32)	(0,01)
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.200	(22)	6	(16)	0,00
					\$ (71)	\$ 15	\$ (56)	(0,01)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
MEI	Erhalt	BOVESPA Index	35	0,000 %	BRL 4.312	14.08.2024	\$ 0	\$ 14	\$ 14	0,00
	Receive	NDUEACWF Index	31.935	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	\$ 13.649	08.01.2025	0	94	94	0,01
MYI	Receive	NDUEACWF Index	19.000	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	8.029	19.03.2025	0	145	145	0,01
	Zahlung	KOSPI2 Index	2.500.000	0,000	KRW 932.060	12.09.2024	0	(25)	(25)	0,00
	Zahlung	SET 50 Index	19.000	0,000	THB 15.353	27.09.2024	0	3	3	0,00
	Receive	NDUEACWF Index	91.994	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	\$ 38.798	27.11.2024	0	762	762	0,08
	Receive	NDUEACWF Index	22.827	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	9.645	07.05.2025	0	175	175	0,02
	Receive	NDUEACWF Index	22.979	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	9.709	04.06.2025	0	179	179	0,02
							\$ 0	\$ 1.347	\$ 1.347	0,14

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	CAD 309	\$ 225	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2024	NZD 6.154	\$ 3.776	26	0	26	0,00
	07.2024	\$ 959	NZD 1.565	0	(5)	(5)	0,00
	08.2024	NZD 1.565	\$ 959	5	0	5	0,00
	09.2024	\$ 311	NZD 500	0	(6)	(6)	0,00
BOA	10.2024	CNH 674	\$ 94	1	0	1	0,00
	07.2024	KRW 1.010.450	739	4	0	4	0,00
	07.2024	SGD 245	181	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 30	€ 28	0	0	0	0,00
	07.2024	15	KRW 20.875	0	0	0	0,00
	07.2024	9	PLN 38	0	0	0	0,00
	08.2024	SGD 27	\$ 20	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 13	TRY 457	0	0	0	0,00
	09.2024	SGD 135	\$ 100	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 890	£ 700	0	(5)	(5)	0,00
BPS	09.2024	100	INR 8.371	0	0	0	0,00
	09.2024	100	THB 3.622	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	AUD 68	\$ 45	0	0	0	0,00
	07.2024	CAD 1.024	750	2	0	2	0,00
	07.2024	€ 3.349	3.626	36	0	36	0,00
	07.2024	£ 18.016	23.014	240	0	240	0,02
	07.2024	KRW 1.002.878	731	1	0	1	0,00
	07.2024	PLN 29	7	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 322	238	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 5.343	AUD 8.018	12	0	12	0,00
	07.2024	1.816	BRL 9.472	0	(111)	(111)	(0,01)
	07.2024	685	¥ 107.000	0	(20)	(20)	0,00
	07.2024	15	KRW 20.719	0	0	0	0,00
	07.2024	450	PLN 1.824	3	0	3	0,00
	07.2024	181	SGD 245	0	0	0	0,00
	08.2024	AUD 8.018	\$ 5.347	0	(12)	(12)	0,00
	08.2024	€ 2.582	2.765	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	SGD 245	181	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 238	SGD 322	0	0	0	0,00
	08.2024	9	TRY 315	0	0	0	0,00
09.2024	CNH 358	\$ 50	1	0	1	0,00	
09.2024	MXN 64.327	3.451	0	(24)	(24)	0,00	
09.2024	TWD 42.466	1.320	1	(1)	0	0,00	
09.2024	\$ 200	HUF 74.311	1	0	1	0,00	
09.2024	7	TWD 232	0	0	0	0,00	
10.2024	CNH 299	\$ 42	0	0	0	0,00	
BRC	07.2024	DKK 118	17	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 17.345	112	4	0	4	0,00
	07.2024	NOK 22.628	2.142	16	0	16	0,00
	07.2024	PLN 2.498	631	11	(1)	10	0,00
	07.2024	\$ 421	BRL 2.197	0	(25)	(25)	0,00
	07.2024	10	PLN 40	0	0	0	0,00
	07.2024	868	TRY 30.925	60	0	60	0,01
	08.2024	847	29.242	5	0	5	0,00
	09.2024	MXN 29	\$ 2	0	0	0	0,00
	09.2024	THB 3.654	100	0	0	0	0,00
	09.2024	TRY 439	12	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	\$ 1	MXN 12	0	0	0	0,00
	11.2024	13	TRY 508	1	0	1	0,00
CBK	07.2024	BRL 4.352	\$ 799	15	0	15	0,00
	07.2024	CHF 10	11	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 1.770	1.901	4	0	4	0,00
	07.2024	£ 5.449	6.913	25	0	25	0,00
	07.2024	SEK 818	77	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 5.561	CNY 39.567	0	(114)	(114)	(0,01)
	07.2024	35	£ 27	0	0	0	0,00
	07.2024	15	PLN 60	0	0	0	0,00
	07.2024	65	THB 2.392	0	0	0	0,00
	07.2024	313	TRY 10.546	1	0	1	0,00
	07.2024	302	ZAR 5.498	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	799	BRL 4.366	0	(16)	(16)	0,00
	09.2024	INR 1.475	\$ 18	0	0	0	0,00
	09.2024	¥ 25.700	163	1	0	1	0,00
	09.2024	TWD 16.191	502	0	(1)	(1)	0,00
09.2024	\$ 100	SGD 134	0	(1)	(1)	0,00	
DUB	07.2024	BRL 5.876	\$ 1.124	66	0	66	0,01
	07.2024	CLP 500.027	541	11	0	11	0,00
	07.2024	KRW 548.128	398	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 8	KRW 11.324	0	0	0	0,00
	07.2024	4	PLN 15	0	0	0	0,00
FAR	08.2024	675	BRL 3.476	0	(52)	(52)	(0,01)
	07.2024	AUD 7.408	\$ 4.936	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	€ 47.372	51.595	825	0	825	0,08
	07.2024	\$ 9.973	¥ 1.557.404	0	(293)	(293)	(0,03)
	07.2024	1.835	NZD 3.008	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	NZD 3.008	\$ 1.835	2	0	2	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2024	\$ 224	CHF 198	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	09.2024	1.078	€ 1.000	1	(3)	(2)	0,00
	09.2024	629	¥ 97.946	0	(13)	(13)	0,00
GLM	07.2024	PLN 59	\$ 15	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 284	BRL 1.489	0	(16)	(16)	0,00
	07.2024	1.995	CAD 2.746	12	0	12	0,00
	07.2024	157	MYR 741	0	0	0	0,00
	07.2024	ZAR 27.461	\$ 1.501	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	BRL 2.509	489	39	0	39	0,00
	08.2024	\$ 6.500	BRL 34.382	0	(334)	(334)	(0,03)
	08.2024	500	TRY 17.252	3	0	3	0,00
	09.2024	100	ILS 367	0	(2)	(2)	0,00
	09.2024	1.246	¥ 191.368	0	(42)	(42)	0,00
	09.2024	35	TRY 1.237	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	CHF 1.382	\$ 1.564	26	0	26	0,00
	07.2024	CNY 731	103	2	0	2	0,00
	07.2024	KRW 676.467	490	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	PEN 766	205	5	0	5	0,00
	07.2024	PLN 102	25	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 76	57	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 31	AUD 46	0	0	0	0,00
	07.2024	301	BRL 1.586	0	(16)	(16)	0,00
	07.2024	1.666	CHF 1.495	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	47	CNY 336	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	26	DKK 178	0	0	0	0,00
	07.2024	276	IDR 4.468.266	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	10	KRW 13.978	0	0	0	0,00
	07.2024	4	PLN 17	0	0	0	0,00
	07.2024	ZAR 52.017	\$ 2.826	0	(19)	(19)	0,00
	08.2024	AUD 46	31	0	0	0	0,00
	08.2024	CHF 1.490	1.666	2	0	2	0,00
	08.2024	CNY 337	47	1	0	1	0,00
	08.2024	DKK 178	26	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 1.586	TRY 54.562	3	0	3	0,00
	09.2024	MXN 10.589	\$ 585	13	0	13	0,00
	09.2024	TWD 27.546	856	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 133	AUD 200	1	0	1	0,00
	09.2024	100	BRL 546	0	(3)	(3)	0,00
	09.2024	679	CHF 594	0	(12)	(12)	0,00
	09.2024	254	£ 200	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	1.459	MXN 26.399	0	(32)	(32)	0,00
MBC	10.2024	CNH 620	\$ 87	1	0	1	0,00
	07.2024	CAD 15.523	11.396	52	0	52	0,00
	07.2024	CZK 5.821	252	4	0	4	0,00
	07.2024	€ 520	564	6	0	6	0,00
	07.2024	£ 76	97	1	0	1	0,00
	07.2024	HUF 256.675	690	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	¥ 2.034.590	12.801	152	0	152	0,01
	07.2024	\$ 5.335	CAD 7.304	3	0	3	0,00
	07.2024	5.167	£ 4.084	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	92	HUF 34.449	1	0	1	0,00
	07.2024	1.940	¥ 303.658	0	(52)	(52)	0,00
	07.2024	1.652	NOK 17.602	1	0	1	0,00
	07.2024	5	PLN 21	0	0	0	0,00
	08.2024	CAD 7.299	\$ 5.335	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	£ 3.769	4.769	4	0	4	0,00
	08.2024	NOK 17.588	1.652	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	SEK 70	7	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 816	CAD 1.116	1	0	1	0,00
	08.2024	7.324	¥ 1.170.286	0	(14)	(14)	0,00
	09.2024	336	AUD 500	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	146	CAD 200	0	0	0	0,00
	09.2024	9	TWD 274	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	NZD 700	\$ 429	3	0	3	0,00
	07.2024	PLN 1.949	480	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	SGD 29	21	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 4.502	BRL 23.257	0	(316)	(316)	(0,03)
	07.2024	5.521	CAD 7.595	29	0	29	0,00
	07.2024	18	DKK 122	0	0	0	0,00
	07.2024	387	€ 362	1	0	1	0,00
	07.2024	6	£ 5	0	0	0	0,00
	07.2024	471	NOK 5.027	1	0	1	0,00
	07.2024	33	PLN 132	0	0	0	0,00
	07.2024	1.636	SEK 17.275	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	295	SGD 399	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	DKK 122	\$ 18	0	0	0	0,00
	08.2024	NOK 5.023	471	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	SEK 17.248	1.636	4	0	4	0,00
	09.2024	INR 150	2	0	0	0	0,00
	09.2024	MXN 1.924	100	0	(4)	(4)	0,00
	09.2024	TWD 10.958	342	1	0	1	0,00
	09.2024	\$ 100	CLP 93.485	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	100	HUF 36.826	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2024	\$ 100	IDR 1.623.090	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	09.2024	100	ILS 371	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	200	MXN 3.737	2	0	2	0,00
	09.2024	100	MYR 468	0	0	0	0,00
	09.2024	868	NOK 9.183	0	(4)	(4)	0,00
	09.2024	200	PLN 808	1	0	1	0,00
RBC	07.2024	CAD 720	\$ 525	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 24.639	£ 19.430	0	(78)	(78)	(0,01)
	08.2024	£ 19.430	\$ 24.643	77	0	77	0,01
	09.2024	AUD 1.400	932	0	(5)	(5)	0,00
	09.2024	IDR 1.642.149	100	0	0	0	0,00
	09.2024	INR 8.364	100	0	0	0	0,00
	09.2024	NZD 1.200	734	2	0	2	0,00
	09.2024	PHP 5.883	100	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 100	COP 414.611	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	61	NZD 100	0	0	0	0,00
	09.2024	100	PHP 5.845	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	AUD 588	\$ 392	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 16.435	1.575	23	0	23	0,00
SCX	07.2024	CAD 65	47	0	0	0	0,00
	07.2024	CNY 39.172	5.508	116	0	116	0,01
	07.2024	KRW 508.907	373	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 56.766	€ 52.983	19	0	19	0,00
	07.2024	8	KRW 10.514	0	0	0	0,00
	07.2024	10	PLN 38	0	0	0	0,00
	07.2024	ZAR 38.511	\$ 2.090	0	(16)	(16)	0,00
	08.2024	€ 52.983	56.849	0	(18)	(18)	0,00
	09.2024	CNH 318	44	1	0	1	0,00
	09.2024	INR 869	10	0	0	0	0,00
	09.2024	PHP 569	10	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 15.928	494	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	\$ 292	CAD 399	0	0	0	0,00
	09.2024	94	INR 7.852	0	0	0	0,00
	09.2024	68	PHP 4.005	0	0	0	0,00
	09.2024	9	TWD 303	0	0	0	0,00
	10.2024	1.194	CNH 8.600	0	(6)	(6)	0,00
SSB	07.2024	536	¥ 83.800	0	(16)	(16)	0,00
	09.2024	KRW 138.499	\$ 100	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	NOK 199	19	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 100	CZK 2.305	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	200	KRW 271.888	0	(2)	(2)	0,00
	09.2024	254	NOK 2.688	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	870	SEK 9.060	0	(11)	(11)	0,00
	09.2024	4.180	TWD 134.680	4	0	4	0,00
	09.2024	200	ZAR 3.658	0	(1)	(1)	0,00
TOR	07.2024	1.397	NZD 2.280	0	(7)	(7)	0,00
	08.2024	COP 3.652.302	\$ 911	36	0	36	0,00
	08.2024	NZD 2.280	1.397	7	0	7	0,00
	09.2024	CAD 1.298	952	1	0	1	0,00
UAG	07.2024	BRL 27.774	5.161	162	0	162	0,02
	07.2024	CHF 104	115	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	DKK 183	27	0	0	0	0,00
	07.2024	ILS 2.223	600	9	0	9	0,00
	07.2024	\$ 3.352	KRW 4.608.333	0	0	0	0,00
				\$ 2.216	\$ (1.801)	\$ 415	0,04

#### ABGESICHERTE DEWISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	\$ 56	NZD 92	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	NZD 92	\$ 56	0	0	0	0,00
BOA	07.2024	€ 976	1.057	11	0	11	0,00
	07.2024	MXN 5.536	330	27	0	27	0,00
	07.2024	\$ 155	CLP 144.422	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	205.013	€ 188.830	0	(2.635)	(2.635)	(0,26)
	07.2024	209	ILS 783	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	CLP 144.422	\$ 155	2	0	2	0,00
	08.2024	ILS 782	209	1	0	1	0,00
BPS	07.2024	BRL 19	4	0	0	0	0,00
	07.2024	CAD 3	2	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 146.054	156.243	20	(310)	(290)	(0,03)
	07.2024	£ 9.615	12.282	129	0	129	0,01
	07.2024	\$ 6.150	AUD 9.230	14	0	14	0,00
	07.2024	138.594	€ 128.020	0	(1.390)	(1.390)	(0,14)
	07.2024	1	¥ 142	0	0	0	0,00
	07.2024	1.184	SGD 1.606	1	0	1	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	AUD 9.230	\$ 6.155	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	0,00
	08.2024	SGD 1.604	1.184	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 3	BRL 19	0	0	0	0,00
BRC	08.2024	154.195	€ 143.951	311	0	311	0,03
	07.2024	DKK 7.089	\$ 1.032	13	0	13	0,00
	07.2024	€ 288	308	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	IDR 10.411.807	641	4	0	4	0,00
	07.2024	NOK 1.003	95	1	0	1	0,00
	07.2024	THB 42.942	1.169	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	\$ 3.587	KRW 4.992.856	39	0	39	0,00
	07.2024	910	MXN 16.607	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	527	PHP 30.891	1	0	1	0,00
	08.2024	KRW 4.984.248	\$ 3.587	0	(36)	(36)	0,00
	08.2024	MXN 16.607	906	2	0	2	0,00
	08.2024	PHP 30.908	527	0	(2)	(2)	0,00
CBK	09.2024	TRY 31.452	896	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	CHF 603	662	0	(8)	(8)	0,00
	07.2024	€ 584	631	5	0	5	0,00
	07.2024	ILS 784	211	3	0	3	0,00
	07.2024	MXN 5.536	330	28	0	28	0,00
	07.2024	PHP 30.940	528	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 26.491	2.495	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	TWD 209.067	6.458	16	(2)	14	0,00
	07.2024	\$ 208	BRL 1.124	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	3.829	INR 320.085	10	0	10	0,00
	07.2024	555	PLN 2.239	2	0	2	0,00
	08.2024	BRL 1.121	\$ 207	5	0	5	0,00
	08.2024	INR 320.397	3.829	0	(10)	(10)	0,00
DUB	08.2024	PLN 2.240	555	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	INR 83.198	998	0	0	0	0,00
FAR	07.2024	KRW 4.981.378	3.625	8	0	8	0,00
	07.2024	AUD 9.230	6.150	0	(15)	(15)	0,00
	07.2024	¥ 2.785.431	17.837	522	0	522	0,05
	07.2024	NZD 402	248	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 196.364	€ 180.290	0	(3.139)	(3.139)	(0,32)
	07.2024	17.963	¥ 2.862.042	0	(171)	(171)	(0,02)
	07.2024	108	NZD 177	0	0	0	0,00
	08.2024	¥ 2.848.614	\$ 17.963	171	0	171	0,02
GLM	08.2024	NZD 177	108	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 419	454	5	0	5	0,00
	07.2024	MYR 4.480	954	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 952	MYR 4.480	0	(2)	(2)	0,00
JPM	08.2024	MYR 4.480	\$ 954	3	0	3	0,00
	07.2024	CNY 197	28	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 744	796	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	INR 242.209	2.900	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	SGD 1.607	1.194	8	0	8	0,00
	07.2024	\$ 1.514	BRL 8.201	0	(38)	(38)	0,00
	07.2024	7.782	CHF 6.983	0	(10)	(10)	0,00
	07.2024	1.513	CNY 10.788	0	(16)	(16)	0,00
	07.2024	1.537	DKK 10.709	2	0	2	0,00
	07.2024	1.989	INR 166.023	2	0	2	0,00
	07.2024	6.423	TWD 209.176	24	0	24	0,00
	08.2024	BRL 8.229	\$ 1.514	38	0	38	0,00
	08.2024	CHF 6.957	7.782	10	0	10	0,00
	08.2024	CNY 10.795	1.513	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK 10.690	1.537	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	INR 166.178	1.989	0	(2)	(2)	0,00
MBC	08.2024	TWD 208.990	6.423	0	(21)	(21)	0,00
	07.2024	CAD 13.244	9.726	48	0	48	0,01
	07.2024	€ 180.447	192.969	11	(438)	(427)	(0,04)
	07.2024	HUF 147.405	411	11	0	11	0,00
	07.2024	¥ 79.192	506	14	0	14	0,00
	07.2024	PLN 2.238	569	12	0	12	0,00
	07.2024	\$ 7.679	CAD 10.512	4	0	4	0,00
	07.2024	8.638	HKD 67.451	1	0	1	0,00
	07.2024	73	NOK 781	0	0	0	0,00
	07.2024	7	SEK 69	0	0	0	0,00
	08.2024	CAD 10.505	\$ 7.679	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	HKD 67.389	8.638	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	NOK 776	73	0	0	0	0,00
MYI	08.2024	\$ 190.785	€ 178.160	437	0	437	0,05
	07.2024	CZK 10.228	\$ 446	9	0	9	0,00
	07.2024	€ 24	26	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 439	CZK 10.251	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	1.053	DKK 7.350	3	0	3	0,00
	07.2024	634	IDR 10.420.876	2	0	2	0,00
	07.2024	21	NOK 222	0	0	0	0,00
	07.2024	2.505	SEK 26.455	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	213	ZAR 3.888	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	ZAR 22.200	\$ 1.188	0	(27)	(27)	0,00
	08.2024	CZK 10.247	439	1	0	1	0,00
	08.2024	DKK 7.337	1.053	0	(3)	(3)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	IDR 10.427.725	\$ 634	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	08.2024	NOK 222	21	0	0	0	0,00
	08.2024	SEK 26.414	2.505	7	0	7	0,00
	08.2024	ZAR 3.897	213	1	0	1	0,00
RBC	07.2024	€ 261	283	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 12.193	£ 9.615	0	(38)	(38)	0,00
	08.2024	£ 9.615	\$ 12.195	38	0	38	0,00
RYL	07.2024	DKK 18	3	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 238	255	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	CNY 10.583	1.488	20	0	20	0,00
	07.2024	€ 178.855	191.629	3	(62)	(59)	(0,01)
	07.2024	\$ 0	CHF 0	0	0	0	0,00
	08.2024	190.614	€ 177.650	60	0	60	0,01
SSB	07.2024	BRL 9.306	\$ 1.814	139	0	139	0,02
	07.2024	MXN 5.536	330	27	0	27	0,00
	07.2024	\$ 12.747	€ 11.750	0	(154)	(154)	(0,01)
TOR	07.2024	CHF 28	\$ 31	0	0	0	0,00
	07.2024	CLP 144.422	159	6	0	6	0,00
	07.2024	\$ 397	HUF 147.425	3	0	3	0,00
	07.2024	82	NZD 134	0	0	0	0,00
	08.2024	HUF 147.598	\$ 397	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	NZD 134	82	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	CHF 6.356	7.034	0	(40)	(40)	0,00
	07.2024	DKK 10.973	1.594	17	0	17	0,00
	07.2024	HKD 67.460	8.633	0	(8)	(8)	0,00
	07.2024	INR 221.328	2.653	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	\$ 1.166	THB 42.942	5	0	5	0,00
	07.2024	580	ZAR 10.681	5	0	5	0,00
	08.2024	€ 173	\$ 186	0	0	0	0,00
	08.2024	THB 42.942	1.167	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	ZAR 10.706	580	0	(5)	(5)	0,00
				\$ 2.333	\$ (8.655)	\$ (6.322)	(0,63)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	\$ 0	NZD 0	0	0	0	0,00
BOA	07.2024	€ 29	\$ 31	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 6	0	0	0	0	0,00
	07.2024	TWD 185	6	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 0	CLP 120	0	0	0	0,00
	07.2024	1	ILS 2	0	0	0	0,00
	08.2024	CLP 120	\$ 0	0	0	0	0,00
BPS	08.2024	ILS 2	1	0	0	0	0,00
	07.2024	BRL 0	0	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 152	192	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 1	0	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 7	AUD 10	0	0	0	0,00
	07.2024	398	£ 312	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	1	SGD 2	0	0	0	0,00
	08.2024	AUD 10	\$ 7	0	0	0	0,00
	08.2024	SGD 2	1	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 0	BRL 0	0	0	0	0,00
BRC	08.2024	192	£ 152	0	0	0	0,00
	07.2024	DKK 8	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2024	IDR 12.287	1	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 2	0	0	0	0	0,00
	07.2024	THB 42	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 5	KRW 6.477	0	0	0	0,00
	07.2024	1	MXN 17	0	0	0	0,00
	07.2024	0	PHP 8	0	0	0	0,00
	07.2024	3	TRY 96	0	0	0	0,00
	08.2024	KRW 6.466	\$ 5	0	0	0	0,00
	08.2024	MXN 17	1	0	0	0	0,00
CBK	08.2024	PHP 9	0	0	0	0	0,00
	07.2024	CHF 1	1	0	0	0	0,00
	07.2024	COP 2.508	1	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 1	2	0	0	0	0,00
	07.2024	ILS 2	1	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 6	0	0	0	0	0,00
	07.2024	PHP 9	0	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 28	3	0	0	0	0,00
	07.2024	TRY 68	2	0	0	0	0,00
	07.2024	TWD 34	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 0	BRL 1	0	0	0	0,00
	07.2024	17	£ 14	0	0	0	0,00
	07.2024	7	INR 582	0	0	0	0,00
	07.2024	0	PLN 2	0	0	0	0,00
	08.2024	BRL 1	\$ 0	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	INR 582	\$ 7	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	PLN 2	0	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	KRW 6.462	5	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 222	£ 174	0	(2)	(2)	0,00
FAR	07.2024	AUD 10	\$ 7	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 3.168	20	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 20	¥ 3.166	0	0	0	0,00
	07.2024	0	NZD 0	0	0	0	0,00
	08.2024	¥ 3.151	\$ 20	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	MYR 3	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1	MYR 3	0	0	0	0,00
	08.2024	MYR 3	\$ 1	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	SGD 2	1	0	0	0	0,00
	07.2024	TRY 34	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2	BRL 9	0	0	0	0,00
	07.2024	9	CHF 8	0	0	0	0,00
	07.2024	2	CNY 12	0	0	0	0,00
	07.2024	2	DKK 12	0	0	0	0,00
	07.2024	1	TWD 34	0	0	0	0,00
	08.2024	BRL 9	\$ 2	0	0	0	0,00
	08.2024	CHF 8	9	0	0	0	0,00
	08.2024	CNY 12	2	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK 12	2	0	0	0	0,00
MBC	08.2024	TWD 34	1	0	0	0	0,00
	07.2024	CAD 14	11	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 174	220	0	0	0	0,00
	07.2024	HUF 48	0	0	0	0	0,00
	07.2024	PLN 1	0	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 11	CAD 14	0	0	0	0,00
	07.2024	1	COP 2.508	0	0	0	0,00
	07.2024	31	€ 29	0	0	0	0,00
	07.2024	9	HKD 74	0	0	0	0,00
	07.2024	0	NOK 2	0	0	0	0,00
	07.2024	0	SEK 0	0	0	0	0,00
	08.2024	CAD 14	\$ 11	0	0	0	0,00
	08.2024	COP 2.508	1	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 29	31	0	0	0	0,00
	08.2024	HKD 74	9	0	0	0	0,00
	08.2024	NOK 2	0	0	0	0	0,00
MYI	08.2024	\$ 219	£ 173	0	0	0	0,00
	07.2024	CZK 2	\$ 0	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 0	CZK 2	0	0	0	0,00
	07.2024	1	DKK 8	0	0	0	0,00
	07.2024	1	IDR 12.298	0	0	0	0,00
	07.2024	3	SEK 28	0	0	0	0,00
	07.2024	1	ZAR 21	0	0	0	0,00
	07.2024	ZAR 21	\$ 1	0	0	0	0,00
	08.2024	CZK 2	0	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK 8	1	0	0	0	0,00
	08.2024	IDR 12.306	1	0	0	0	0,00
	08.2024	SEK 28	3	0	0	0	0,00
	08.2024	ZAR 21	1	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	£ 172	219	1	0	1	0,00
	08.2024	\$ 219	£ 172	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2024	CHF 1	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2024	CNY 12	2	0	0	0	0,00
SSB	07.2024	BRL 10	2	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 6	0	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	CLP 120	0	0	0	0	0,00
	07.2024	NZD 0	0	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 0	HUF 48	0	0	0	0,00
	08.2024	HUF 48	\$ 0	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 0	NZD 0	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	CHF 6	\$ 7	0	0	0	0,00
	07.2024	DKK 12	2	0	0	0	0,00
	07.2024	HKD 74	9	0	0	0	0,00
	07.2024	INR 582	7	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1	THB 42	0	0	0	0,00
	08.2024	THB 42	\$ 1	0	0	0	0,00
				\$ 2	\$ (6)	\$ (4)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional RMB (Hedged) thesaurierend und Institutional RMB (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 50	\$ 54	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2024	HKD 130	17	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 2.869	2	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 9	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 385	CNH 2.793	0	(3)	(3)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	BRL 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	£ 19	24	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 2	0	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 2.849	2	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 12	AUD 17	0	0	0	0,00
	07.2024	2	SGD 3	0	0	0	0,00
	08.2024	AUD 17	\$ 12	0	0	0	0,00
	08.2024	SGD 3	2	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 0	BRL 0	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 124	\$ 4	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 23	CNH 168	0	0	0	0,00
	10.2024	11	82	0	0	0	0,00
BRC	07.2024	DKK 16	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 11	1	0	0	0	0,00
	07.2024	THB 39	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2	MXN 28	0	0	0	0,00
	08.2024	MXN 28	\$ 2	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 384	CNH 2.799	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	CHF 1	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 9	1	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 49	5	0	0	0	0,00
	07.2024	TWD 44	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 0	BRL 2	0	0	0	0,00
	07.2024	1	INR 110	0	0	0	0,00
	08.2024	BRL 2	\$ 0	0	0	0	0,00
	08.2024	INR 110	1	0	0	0	0,00
	09.2024	521	6	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 45	1	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	KRW 1.556	1	0	0	0	0,00
FAR	07.2024	AUD 17	12	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 5.648	36	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 35	¥ 5.645	0	0	0	0,00
	08.2024	¥ 5.619	\$ 35	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	MYR 4	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 293	CNH 2.121	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	1	MYR 4	0	0	0	0,00
	08.2024	MYR 4	\$ 1	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	CNY 3	0	0	0	0	0,00
	07.2024	IDR 18.733	1	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 1.923	1	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 3	2	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 3	BRL 16	0	0	0	0,00
	07.2024	14	CHF 13	0	0	0	0,00
	07.2024	28	CNY 200	0	0	0	0,00
	07.2024	3	DKK 23	0	0	0	0,00
	07.2024	1	TWD 44	0	0	0	0,00
	08.2024	BRL 16	\$ 3	0	0	0	0,00
	08.2024	CHF 13	14	0	0	0	0,00
	08.2024	CNY 200	28	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK 23	3	0	0	0	0,00
	08.2024	TWD 44	1	0	0	0	0,00
	09.2024	INR 71	1	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 77	2	0	0	0	0,00
	10.2024	\$ 17	CNH 120	0	0	0	0,00
MBC	05.2025	AED 3	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2024	CAD 24	18	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 18	CAD 24	0	0	0	0,00
	07.2024	31	CNH 222	0	0	0	0,00
	07.2024	53	€ 50	0	0	0	0,00
	07.2024	24	£ 19	0	0	0	0,00
	07.2024	1	NOK 9	0	0	0	0,00
	07.2024	0	SEK 0	0	0	0	0,00
	08.2024	CAD 24	\$ 18	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 50	53	0	0	0	0,00
	08.2024	£ 19	24	0	0	0	0,00
	08.2024	NOK 9	1	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 6	0	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	\$ 2	DKK 16	0	0	0	0,00
	07.2024	0	NOK 2	0	0	0	0,00
	07.2024	5	SEK 49	0	0	0	0,00
	07.2024	2	ZAR 38	0	0	0	0,00
	07.2024	ZAR 38	\$ 2	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK 16	2	0	0	0	0,00
	08.2024	NOK 2	0	0	0	0	0,00
	08.2024	SEK 49	5	0	0	0	0,00
	08.2024	ZAR 38	2	0	0	0	0,00
	09.2024	INR 47	1	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 31	1	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	DKK 0	0	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	CHF 0	0	0	0	0	0,00
	07.2024	CNY 169	24	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 1.444	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 382	CNH 2.765	0	(4)	(4)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2024	INR 322	\$ 4	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	09.2024	TWD 51	2	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 7	CNH 49	0	0	0	0,00
SOG	07.2024	CNY 28	\$ 4	0	0	0	0,00
SSB	07.2024	BRL 18	4	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 9	1	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	CNH 2.828	387	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 387	CNH 2.822	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	CHF 11	\$ 13	0	0	0	0,00
	07.2024	DKK 24	3	0	0	0	0,00
	07.2024	ILS 3	1	0	0	0	0,00
	07.2024	INR 110	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 0	HKD 1	0	0	0	0,00
	07.2024	1	THB 39	0	0	0	0,00
	08.2024	THB 39	\$ 1	0	0	0	0,00
				\$ 2	\$ (9)	\$ (7)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen M Retail SGD (Hedged) thesaurierend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II and UM Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	CAD 406	\$ 296	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	07.2024	€ 4.394	4.771	62	0	62	0,01
	07.2024	HKD 130	17	0	0	0	0,00
	07.2024	INR 21.831	262	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 161.501	118	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 1.011	60	5	0	5	0,00
	07.2024	SEK 1.484	142	2	0	2	0,00
	07.2024	SGD 80.503	59.311	2	(90)	(90)	(0,01)
	07.2024	TWD 6.188	191	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 20	ILS 77	0	0	0	0,00
	07.2024	42.290	SGD 57.079	0	(173)	(173)	(0,02)
	08.2024	ILS 77	\$ 20	0	0	0	0,00
BPS	08.2024	\$ 60.101	SGD 81.455	91	0	91	0,01
	07.2024	AUD 215	\$ 142	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	BRL 1.634	314	20	0	20	0,00
	07.2024	CAD 1.403	1.028	3	0	3	0,00
	07.2024	€ 509	552	6	0	6	0,00
	07.2024	£ 1.670	2.132	20	0	20	0,00
	07.2024	SGD 78.962	58.221	0	(43)	(43)	0,00
	07.2024	\$ 1.736	AUD 2.605	4	0	4	0,00
	07.2024	412	BRL 2.163	0	(22)	(22)	0,00
	07.2024	286	¥ 44.607	0	(8)	(8)	0,00
	07.2024	85	KRW 118.314	1	0	1	0,00
	08.2024	AUD 2.605	\$ 1.737	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	KRW 118.109	85	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 1	BRL 5	0	0	0	0,00
	08.2024	58.221	SGD 78.848	45	0	45	0,01
BRC	09.2024	TWD 31	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2024	AUD 336	222	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	BRL 465	89	5	0	5	0,00
	07.2024	CHF 71	80	1	0	1	0,00
	07.2024	DKK 1.339	195	2	0	2	0,00
	07.2024	IDR 2.256.490	139	1	0	1	0,00
	07.2024	NOK 208	20	0	0	0	0,00
	07.2024	THB 40	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.126	KRW 1.568.007	12	0	12	0,00
	07.2024	166	MXN 3.032	0	0	0	0,00
	07.2024	10.566	SGD 14.249	0	(53)	(53)	(0,01)
	08.2024	KRW 1.565.303	\$ 1.126	0	(11)	(11)	0,00
	08.2024	MXN 3.032	165	0	0	0	0,00
CBK	09.2024	TRY 3.753	107	0	0	0	0,00
	07.2024	AUD 133	88	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	BRL 273	53	4	0	4	0,00
	07.2024	CHF 344	378	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	£ 1.170	1.488	10	0	10	0,00
	07.2024	ILS 77	21	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 1.011	60	5	0	5	0,00
	07.2024	PLN 347	88	1	0	1	0,00
	07.2024	SEK 2.511	237	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	TWD 45.063	1.391	3	(1)	2	0,00
	07.2024	\$ 49	BRL 267	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	1.892	INR 158.130	5	0	5	0,00
	07.2024	96	PLN 387	0	0	0	0,00
	07.2024	13.924	SGD 18.781	0	(65)	(65)	(0,01)
	08.2024	BRL 268	\$ 49	1	0	1	0,00
	08.2024	INR 158.284	1.892	0	(5)	(5)	0,00
	08.2024	PLN 387	96	0	0	0	0,00
	09.2024	INR 152	2	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
DUB	07.2024	BRL 335	\$ 65	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
	07.2024	HKD 803	103	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 1.064.193	774	2	0	2	0,00
	07.2024	ZAR 2.145	114	0	(3)	(3)	0,00
FAR	07.2024	AUD 1.475	983	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	¥ 459.503	2.942	86	0	86	0,01
GLM	07.2024	AED 298	81	0	0	0	0,00
	07.2024	AUD 148	99	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 627	679	7	0	7	0,00
	07.2024	INR 9.061	109	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 35.016	227	9	0	9	0,00
	07.2024	KRW 210.273	152	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	MYR 591	126	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 126	MYR 591	0	0	0	0,00
	07.2024	12.629	SGD 17.015	0	(74)	(74)	(0,01)
	08.2024	MYR 591	\$ 126	0	0	0	0,00
IND	07.2024	AED 102	28	0	0	0	0,00
	07.2024	HKD 602	77	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	BRL 1.064	208	16	0	16	0,00
	07.2024	CAD 124	90	0	0	0	0,00
	07.2024	CHF 160	177	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 362	BRL 1.961	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	2.311	CHF 2.074	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	431	CNY 3.077	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	513	DKK 3.578	1	0	1	0,00
	07.2024	33.837	SGD 45.544	0	(232)	(232)	(0,02)
	07.2024	1.876	TWD 61.091	7	0	7	0,00
	08.2024	BRL 1.968	\$ 362	9	0	9	0,00
	08.2024	CHF 2.066	2.311	3	0	3	0,00
	08.2024	CNY 3.079	431	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK 3.572	513	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	TWD 61.036	1.876	0	(6)	(6)	0,00
MBC	07.2024	AUD 298	198	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	CAD 1.910	1.402	6	0	6	0,00
	07.2024	CHF 84	94	1	0	1	0,00
	07.2024	€ 1.123	1.222	19	0	19	0,00
	07.2024	¥ 287.481	1.839	52	0	52	0,01
	07.2024	NOK 1.063	101	1	0	1	0,00
	07.2024	PLN 40	10	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 825	610	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 2.808	CAD 3.845	2	0	2	0,00
	07.2024	3.593	£ 2.840	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	2.504	HKD 19.552	0	0	0	0,00
	07.2024	93	NOK 988	0	0	0	0,00
	07.2024	1	SEK 7	0	0	0	0,00
	07.2024	4.911	SGD 6.620	0	(27)	(27)	0,00
	08.2024	CAD 3.843	\$ 2.808	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	£ 2.840	3.594	3	0	3	0,00
	08.2024	HKD 19.534	2.504	0	0	0	0,00
	08.2024	NOK 988	93	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	CHF 109	121	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	€ 75	80	0	0	0	0,00
	07.2024	HKD 706	90	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 14.939	95	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 352	DKK 2.456	1	0	1	0,00
	07.2024	137	IDR 2.258.456	1	0	1	0,00
	07.2024	26	NOK 282	0	0	0	0,00
	07.2024	735	SEK 7.762	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	25	SGD 34	0	0	0	0,00
	07.2024	259	ZAR 4.719	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	ZAR 2.586	\$ 138	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	DKK 2.452	352	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	IDR 2.259.940	137	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	NOK 282	26	0	0	0	0,00
	08.2024	SEK 7.750	735	2	0	2	0,00
	08.2024	ZAR 4.730	259	1	0	1	0,00
	09.2024	INR 48	1	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	€ 428	465	6	0	6	0,00
	07.2024	HKD 1.115	143	0	0	0	0,00
	07.2024	INR 12.909	154	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	KRW 250.382	182	1	(1)	0	0,00
	07.2024	TWD 6.824	211	1	0	1	0,00
RYL	07.2024	DKK 1.852	270	4	0	4	0,00
	07.2024	SEK 3.764	357	1	0	1	0,00
SCX	07.2024	CHF 314	350	1	0	1	0,00
	07.2024	CNY 193	27	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 12.396	79	2	0	2	0,00
	07.2024	SGD 237	176	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 8.138	€ 7.596	3	0	3	0,00
	07.2024	55.651	SGD 75.015	0	(300)	(300)	(0,03)
	08.2024	€ 7.596	\$ 8.150	0	(3)	(3)	0,00
SOG	07.2024	CNY 2.337	329	5	0	5	0,00
	07.2024	TWD 2.984	92	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens		
SSB	07.2024	BRL 621	\$ 121	\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,00		
	07.2024	CNY 545	77	1	0	1	0,00		
	07.2024	€ 439	476	6	0	6	0,00		
	07.2024	INR 6.252	75	0	0	0	0,00		
	07.2024	¥ 80.538	516	15	0	15	0,00		
TOR	07.2024	MXN 1.011	60	5	0	5	0,00		
	07.2024	\$ 5.287	¥ 845.318	0	(32)	(32)	0,00		
UAG	08.2024	¥ 841.354	\$ 5.287	31	0	31	0,00		
	07.2024	CHF 992	1.098	0	(6)	(6)	0,00		
	07.2024	DKK 2.850	414	4	0	4	0,00		
	07.2024	HKD 16.328	2.090	0	(2)	(2)	0,00		
	07.2024	INR 108.074	1.296	0	0	0	0,00		
	07.2024	\$ 229	SGD 310	0	0	0	0,00		
	07.2024	1	THB 40	0	0	0	0,00		
	08.2024	THB 40	\$ 1	0	0	0	0,00		
						\$ 642	\$ (1.210)	\$ (568)	(0,06)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						\$ (5.484)	(0,55)		
<b>Summe Anlagen</b>						\$ 1.128.889	113,72		
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						\$ (136.160)	(13,72)		
<b>Nettovermogen</b>						\$ 992.729	100,00		

### ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
- (i) Mit dem Fonds verbunden.
- (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (k) Eingeschrankte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,02 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Baidu, Inc. 'A'	12.03.2024	\$ 124	\$ 102	0,01
Parkland Corp.	12.12.2023	335	307	0,03
		\$ 459	\$ 409	0,04

Barmittel in Hohle von 7.879 USD (31. Dezember 2023: 5.701 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 1.345 USD) und Barmittel in Hohle von 6.840 USD (31. Dezember 2023: 350 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit fur Finanzderivate verpfandet.

#### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 386.034	\$ 702.260	\$ 484	\$ 1.088.778
Investmentfonds	39.825	0	0	39.825
Pensionsgeschafte	0	7.168	0	7.168
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(41)	(6.841)	0	(6.882)
<b>Summen</b>	<b>\$ 425.818</b>	<b>\$ 702.587</b>	<b>\$ 484</b>	<b>\$ 1.128.889</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 247.646	\$ 518.134	\$ 1.789	\$ 767.569
Investmentfonds	881	0	0	881
Pensionsgeschäfte	0	12.604	0	12.604
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(108)	(2.899)	0	(3.007)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(2.036)	0	(2.036)
<b>Summen</b>	<b>\$ 248.419</b>	<b>\$ 525.803</b>	<b>\$ 1.789</b>	<b>\$ 776.011</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 20	\$ 0	\$ 20	\$ (77)	\$ 0	\$ (77)
BOA	(2.704)	2.990	286	(346)	342	(4)
BPS	(1.099)	1.160	61	90	0	90
BRC	41	0	41	539	(1.130)	(591)
CBK	(102)	0	(102)	(560)	350	(210)
DUB	35	0	35	(230)	0	(230)
FAR	(2.039)	2.150	111	1	0	1
GLM	(681)	0	(681)	(463)	(60)	(523)
GST	(8)	0	(8)	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(269)	260	(9)	114	0	114
MBC	291	(190)	101	362	(570)	(208)
MEI	253	0	253	28	0	28
MYC	(32)	0	(32)	(1)	0	(1)
MYI	777	(140)	637	231	0	231
RBC	4	0	4	19	0	19
RYL	28	0	28	(444)	732	288
SAL	(16)	0	(16)	(9)	0	(9)
SCX	(181)	280	99	(266)	271	5
SOG	5	0	5	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	19	0	19	33	0	33
TOR	42	0	42	121	0	121
UAG	132	0	132	(190)	(320)	(510)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	78,21	80,16
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	29,77	34,38
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,70	k. A.
Investmentfonds	4,01	0,13
Pensionsgeschäfte	0,72	1,88
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	(0,07)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,13)	(0,22)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,55)	(0,16)
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,30)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,11	k. A.
Unternehmensanleihen und Wechsel	7,04	5,35
Wandelanleihen & Wechsel	0,10	0,14
US-Regierungsbehörden	22,51	24,13
US-Schatzobligationen	6,99	6,91
Non-Agency-MBS	3,90	1,85
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,63	7,89
Staatsemissionen	2,27	4,16
Stammaktien	57,47	57,73
Vorzugswertpapiere	0,67	0,41
Real Estate Investment Trusts	0,40	0,04
Kurzfristige Instrumente	1,59	5,93

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Investmentfonds	4,01	0,13
Pensionsgeschäfte	0,72	1,88
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	(0,07)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,01)	0,00
Zinsswaps	(0,12)	(0,21)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,03)	(0,04)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,01)	(0,00)
Total Return Swaps auf Indizes	0,14	(0,04)
Devisenterminkontrakte	0,04	(0,15)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,69)	0,07
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,30)
Sonstige Aktiva und Passiva	(13,72)	(15,80)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>ÖSTERREICH</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
7,750 % fällig am 16.08.2029 (d)(f)		\$ 10.065	0,22	8,000 % fällig am 22.08.2031 (d)(f)	57.100	57.456	1,22	2,569 % fällig am 22.09.2026 (h)	7.850	7.532	0,16
8,000 % fällig am 15.10.2027 (d)(f)	€ 38.800	\$ 37.633	0,80	8,500 % fällig am 14.08.2028 (d)(f)	24.600	25.257	0,54	5,375 % fällig am 16.04.2034	€ 8.900	9.688	0,20
7,000 % fällig am 15.04.2031 (d)(f)		28.200	0,63	9,250 % fällig am 17.11.2027 (d)(f)	16.500	17.537	0,37	7,500 % fällig am 03.06.2026 (d)(f)(h)	47.185	51.803	1,10
8,500 % fällig am 15.10.2028 (d)(f)(h)		17.800	0,44	BPCE S.A.				UnipolSai Assicurazioni SpA			
Summe Österreich		87.919	1,87	1,500 % fällig am 13.01.2042 (f)	€ 15.800	15.615	0,33	4,900 % fällig am 23.05.2034	4.500	4.757	0,10
								<b>JAPAN</b>			
<b>BELGIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,250 % fällig am 24.10.2025 (d)(f)	67.800	70.551	1,50	2,125 % fällig am 13.10.2046 (f)	36.000	31.532	0,67	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
4,750 % fällig am 17.04.2035	18.500	20.014	0,42	4,250 % fällig am 11.01.2035	5.500	5.966	0,13	8,200 % fällig am 15.01.2029 (d)(f)	\$ 44.000	47.383	1,01
8,000 % fällig am 05.09.2028 (d)(f)	45.400	51.668	1,10	6,508 % fällig am 18.01.2035	\$ 18.000	18.032	0,38	Summe Japan		82.740	1,76
Summe Belgien		142.233	3,02	Credit Agricole Assurances S.A.							
								<b>DEUTSCHLAND</b>			
<b>KANADA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bank of Nova Scotia				5,875 % fällig am 25.10.2033	€ 10.700	12.435	0,26	HSBC Bank Capital Funding Sterling LP			
3,625 % fällig am 27.10.2081 (f)(h)	\$ 16.900	14.359	0,31	Credit Agricole S.A.				5,844 % fällig am 05.11.2031 (d)(h)	£ 60.732	79.522	1,69
4,900 % fällig am 04.06.2025 (d)(f)(h)		24.000	0,50	6,251 % fällig am 10.01.2035	\$ 25.600	25.770	0,55	HSBC Capital Funding Dollar LP			
8,000 % fällig am 27.01.2084 (f)	21.900	22.670	0,48	6,500 % fällig am 23.09.2029 (d)(f)	€ 61.900	66.465	1,41	10,176 % fällig am 30.06.2030 (d)	\$ 3.517	4.264	0,09
Royal Bank of Canada				7,250 % fällig am 23.09.2028 (d)(f)	€ 103.600	114.749	2,44	Summe Jersey, Kanalsinseln		83.786	1,78
7,500 % fällig am 02.05.2084 (f)	32.600	33.702	0,72	Electricite de France S.A.							
Scotiabank Capital Trust				9,125 % fällig am 15.03.2033 (d)	\$ 28.600	31.177	0,66				
5,650 % fällig am 31.12.2056	CAD 16.616	12.800	0,27	Groupe des Assurances du Credit Mutuel SADI							
Toronto-Dominion Bank				5,000 % fällig am 30.10.2044	€ 14.200	15.007	0,32				
7,250 % fällig am 31.07.2084 (a)(f)	\$ 11.900	11.900	0,25	RCI Banque S.A.							
8,125 % fällig am 31.10.2082 (f)(h)	11.400	11.843	0,25	5,500 % fällig am 09.10.2034 (a)	20.700	22.158	0,47				
Summe Kanada		130.860	2,78	Societe Generale S.A.							
								<b>MEXIKO</b>			
<b>DÄNEMARK</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Danske Bank A/S				3,337 % fällig am 21.01.2033 (h)	\$ 20.100	16.669	0,35	BBVA Bancomer S.A.			
6,259 % fällig am 22.09.2026 (h)	2.900	2.921	0,06	6,691 % fällig am 10.01.2034	22.800	23.324	0,50	8,125 % fällig am 08.01.2039 (f)	12.800	12.971	0,28
								<b>NIEDERLANDE</b>			
<b>FINNLAND</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nordea Bank Abp				8,000 % fällig am 29.09.2025 (d)(f)	31.650	31.633	0,67	ABN AMRO Bank NV			
3,750 % fällig am 01.03.2029 (d)(f)	44.700	37.380	0,79	10,000 % fällig am 14.11.2028 (d)(f)	17.800	18.512	0,39	4,750 % fällig am 22.09.2027 (d)(f)	€ 32.700	32.834	0,70
								<b>NORWEGEN</b>			
<b>FRANKREICH</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Altice France S.A.				Summe Deutschland		678.382	14,42	de Volksbank NV			
4,250 % fällig am 15.10.2029	€ 8.000	5.717	0,12					7,000 % fällig am 15.12.2027 (d)(f)	23.100	24.716	0,53
5,500 % fällig am 15.10.2029	\$ 16.300	10.766	0,23					ING Groep NV			
11,500 % fällig am 01.02.2027 (g)	€ 500	439	0,01					3,875 % fällig am 16.05.2027 (d)(f)	\$ 45.026	38.258	0,81
AXA S.A.								4,250 % fällig am 16.05.2031 (d)(f)	33.900	26.473	0,56
3,375 % fällig am 31.05.2034	650	686	0,01					4,875 % fällig am 16.05.2029 (d)(f)	7.000	6.099	0,13
6,375 % fällig am 16.07.2033 (d)(f)	2.000	2.196	0,05					5,750 % fällig am 16.11.2026 (d)(f)	9.700	9.332	0,20
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.								8,000 % fällig am 16.05.2030 (d)(f)	102.900	105.063	2,23
4,375 % fällig am 11.01.2034	13.700	14.372	0,31					NN Group NV			
BNP Paribas S.A.								5,250 % fällig am 01.03.2043	€ 19.600	21.674	0,46
4,500 % fällig am 25.02.2030 (d)(f)	\$ 12.900	10.269	0,22					Stichting AK Rabobank Certificaten			
4,625 % fällig am 12.01.2027 (d)(f)	22.400	20.215	0,43					6,500 % (d)	70.139	81.685	1,74
4,625 % fällig am 25.02.2031 (d)(f)	6.800	5.462	0,12					Summe Niederlande		583.521	12,40
6,875 % fällig am 06.12.2029 (d)(f)	€ 25.000	27.363	0,58								
7,375 % fällig am 11.06.2030 (d)(f)	19.200	21.427	0,46								
								<b>PORTUGAL</b>			
<b>ITALIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA								Banco Espirito Santo S.A.			
7,708 % fällig am 18.01.2028	7.208	8.157	0,17					2,625 % fällig am 08.05.2017 ^	€ 26.300	8.174	0,18
8,000 % fällig am 22.01.2030	6.400	6.937	0,15					4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	11.100	3.450	0,07
8,500 % fällig am 10.09.2030	11.850	13.019	0,28					4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	20.000	6.216	0,13
10,500 % fällig am 23.07.2029	12.250	15.730	0,33					Summe Portugal		17.840	0,38
Intesa Sanpaolo SpA											
4,198 % fällig am 01.06.2032	\$ 4.330	3.665	0,08								
4,950 % fällig am 01.06.2042	6.100	4.562	0,10								
5,875 % fällig am 01.09.2031 (d)(f)(h)	€ 4.800	4.923	0,10								
7,200 % fällig am 28.11.2033	\$ 400	428	0,01								
7,700 % fällig am 17.09.2025 (d)(f)	43.900	43.897	0,93								
7,750 % fällig am 11.01.2027 (d)(f)	€ 30.200	33.263	0,71								
7,778 % fällig am 20.06.2054	\$ 40.500	42.350	0,90								
8,248 % fällig am 21.11.2033 (h)	26.700	29.465	0,63								
9,125 % fällig am 07.09.2029 (d)(f)	€ 52.700	62.478	1,33								



## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	211	\$ 136	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	1.584	(1.394)	(0,03)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	937	1.559	0,03
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	45	31	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	1.589	2.049	0,04
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	298	147	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	3.477	1.144	0,03
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	2.923	(1.113)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	5.409	2.841	0,06
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	2.064	(1.520)	(0,03)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	51	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	326	441	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	586	236	0,01
				\$ 4.558	0,10
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ 4.558</b>	<b>0,10</b>

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 3.800	\$ 1.550	0,03
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	95.400	2.467	0,05
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	34.800	1.804	0,04
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	126.800	1.930	0,04
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	18.09.2026	22.100	(106)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	\$ 17.300	52	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	59.300	620	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 51.700	2.554	0,06
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	67.600	(1.158)	(0,02)
					\$ 9.713	0,21
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 9.713</b>	<b>0,21</b>

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## DEWISENTERMINIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 18.349	\$ 20.006	\$ 341	\$ 0	\$ 341	0,01
	07.2024	SGD 11	8	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	€ 1.491.049	1.614.174	16.141	0	16.141	0,34
	07.2024	£ 1.725	2.192	11	0	11	0,00
	07.2024	\$ 674	AUD 1.012	2	0	2	0,00
	07.2024	1.589.512	€ 1.485.971	3.182	(104)	3.078	0,06
	07.2024	1.503	£ 1.182	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	692	SGD 938	1	0	1	0,00
BRC	08.2024	AUD 1.012	\$ 675	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	€ 1.479.851	1.585.160	0	(3.181)	(3.181)	(0,07)
	08.2024	SGD 937	692	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 19.951	€ 18.645	32	0	32	0,00
CBK	07.2024	€ 1.142	SGD 1.545	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	€ 330	\$ 359	6	0	6	0,00
	07.2024	£ 23.565	30.063	274	0	274	0,01
	07.2024	SEK 4.530	427	0	(1)	(1)	0,00
DUB	07.2024	\$ 5	CHF 5	0	0	0	0,00
	07.2024	8.170	£ 6.431	0	(40)	(40)	0,00
	08.2024	£ 11.177	\$ 14.130	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	499.184	636.949	5.931	0	5.931	0,12
FAR	07.2024	AUD 1.012	673	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	CHF 53	59	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	CNY 1.059	148	2	0	2	0,00
	07.2024	€ 159.440	173.151	2.271	0	2.271	0,05
	07.2024	SGD 2.187	1.625	11	0	11	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 10.771	€ 10.066	\$ 17	\$ 0	\$ 17	0,00
	07.2024	1.644	£ 1.298	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	59	CHF 53	0	0	0	0,00
	08.2024	148	CNY 1.060	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	CAD 19.281	\$ 14.161	70	0	70	0,00
	07.2024	€ 2.305	2.475	5	0	5	0,00
	07.2024	£ 2.248	2.857	15	0	15	0,00
	07.2024	SGD 296	219	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 14.091	CAD 19.293	8	0	8	0,00
	07.2024	14.196	€ 13.038	0	(222)	(222)	(0,01)
	07.2024	661.956	£ 523.203	0	(576)	(576)	(0,01)
	08.2024	CAD 19.280	\$ 14.091	0	(9)	(9)	0,00
	08.2024	£ 442.486	559.927	479	0	479	0,01
MYI	07.2024	€ 653	700	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 31	39	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 151	112	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 223	€ 208	1	0	1	0,00
	07.2024	983	£ 777	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	429	SEK 4.536	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	SEK 4.529	\$ 429	1	0	1	0,00
RBC	07.2024	\$ 11.296	€ 10.400	0	(150)	(150)	0,00
RYL	07.2024	£ 5.392	\$ 6.900	84	0	84	0,00
	07.2024	\$ 1.567	€ 1.465	3	0	3	0,00
SCX	07.2024	€ 175.836	\$ 190.788	2.336	0	2.336	0,05
	07.2024	\$ 149	CNY 1.058	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	7.007	€ 6.522	0	(17)	(17)	0,00
	07.2024	22	SGD 31	0	0	0	0,00
SSB	07.2024	€ 18.125	\$ 19.662	236	0	236	0,01
	08.2024	319.894	343.216	0	(130)	(130)	0,00
UAG	07.2024	\$ 54	CHF 49	0	0	0	0,00
				\$ 31.461	\$ (4.456)	\$ 27.005	0,57

### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend, Institutional AUD (Hedged) ausschüttend, Investor AUD (Hedged) ausschüttend und Z Class AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD 28.197	\$ 18.782	\$ 0	\$ (49)	\$ (49)	0,00
	07.2024	\$ 25.483	AUD 38.263	71	0	71	0,00
	08.2024	18.798	28.197	49	0	49	0,00
BOA	07.2024	AUD 59	\$ 39	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	28.342	18.883	0	(45)	(45)	0,00
	08.2024	\$ 18.804	AUD 28.197	43	0	43	0,00
BRC	07.2024	AUD 486	\$ 322	0	(3)	(3)	0,00
CBK	07.2024	1.062	705	0	(4)	(4)	0,00
DUB	07.2024	211	140	0	(1)	(1)	0,00
FAR	07.2024	26.445	17.639	0	(22)	(22)	0,00
	07.2024	\$ 19.342	AUD 29.030	46	0	46	0,00
	08.2024	17.654	26.445	22	0	22	0,00
MBC	07.2024	805	1.211	4	0	4	0,00
RBC	07.2024	AUD 164	\$ 109	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	398	265	0	(1)	(1)	0,00
TOR	07.2024	\$ 11.212	AUD 16.858	47	0	47	0,00
				\$ 282	\$ (125)	\$ 157	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	BRL 6.710	\$ 1.244	\$ 36	\$ 0	\$ 36	0,00
	07.2024	\$ 735	BRL 3.942	0	(25)	(25)	0,00
	08.2024	1.240	6.710	0	(36)	(36)	0,00
CBK	07.2024	BRL 28.055	\$ 5.186	135	0	135	0,01
	07.2024	\$ 6.126	BRL 31.716	0	(416)	(416)	(0,01)
	08.2024	5.289	28.722	0	(137)	(137)	0,00
JPM	07.2024	BRL 23.639	\$ 4.366	110	0	110	0,00
	07.2024	\$ 4.711	BRL 24.245	0	(346)	(346)	(0,01)
	08.2024	4.222	22.941	0	(107)	(107)	0,00
SCX	07.2024	BRL 4	\$ 1	0	0	0	0,00
SSB	07.2024	28.066	5.186	133	0	133	0,00
	07.2024	\$ 5.178	BRL 26.571	0	(395)	(395)	(0,01)
	08.2024	5.186	28.161	0	(134)	(134)	0,00
				\$ 414	\$ (1.596)	\$ (1.182)	(0,02)

Zum 30. Juni 2024 standen für die ausschüttende Investor CAD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	\$ 476	CAD 651	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	07.2024	CAD 951	\$ 695	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 701	CAD 955	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	695	950	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	CAD 1.928	\$ 1.408	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 578	CAD 787	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	1.408	1.927	1	0	1	0,00
MYI	07.2024	CAD 33	\$ 24	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 356	CAD 486	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1	\$ (8)	\$ (7)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und E Class CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 11.843	CHF 10.652	\$ 12	\$ 0	\$ 12	0,00
BRC	07.2024	CHF 180	\$ 203	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 149	CHF 132	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2024	CHF 79	\$ 87	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 1.227	CHF 1.117	16	0	16	0,00
JPM	07.2024	CHF 12.982	\$ 14.466	19	0	19	0,00
	08.2024	\$ 14.466	CHF 12.934	0	(19)	(19)	0,00
MBC	08.2024	CHF 57	\$ 63	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	\$ 543	CHF 488	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	14.302	12.919	75	0	75	0,00
UAG	07.2024	CHF 12.906	\$ 14.384	22	0	22	0,00
	07.2024	\$ 14.164	CHF 12.800	80	0	80	0,00
	08.2024	14.384	12.858	0	(22)	(22)	0,00
				\$ 226	\$ (43)	\$ 183	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) ausschüttend, R Class EUR (Hedged) ausschüttend und T Class EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 447	\$ 487	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	07.2024	\$ 713.088	€ 656.801	0	(9.161)	(9.161)	(0,19)
BPS	07.2024	€ 610.833	\$ 653.351	3	(1.312)	(1.309)	(0,03)
	07.2024	\$ 598.423	€ 552.764	0	(5.998)	(5.998)	(0,13)
	08.2024	653.583	610.162	1.312	0	1.312	0,03
BRC	07.2024	€ 6.678	\$ 7.146	0	(11)	(11)	0,00
CBK	07.2024	383	418	7	0	7	0,00
	07.2024	\$ 703	€ 655	0	(1)	(1)	0,00
FAR	07.2024	692.229	635.566	0	(11.062)	(11.062)	(0,23)
GLM	07.2024	€ 654	\$ 708	7	0	7	0,00
JPM	07.2024	1.680	1.798	0	(3)	(3)	0,00
MBC	07.2024	627.990	671.662	131	(1.517)	(1.386)	(0,03)
	07.2024	\$ 465	€ 433	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	662.907	619.040	1.517	0	1.517	0,03
MYI	07.2024	€ 259	\$ 278	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	6	7	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	446	477	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2024	620.549	664.856	0	(218)	(218)	0,00
	07.2024	\$ 1.046	€ 974	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	665.834	620.549	209	0	209	0,00
SSB	07.2024	€ 2.744	\$ 2.940	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 27.637	€ 25.477	0	(332)	(332)	(0,01)
	08.2024	2.944	2.744	1	0	1	0,00
UAG	08.2024	€ 22.380	\$ 23.966	0	(55)	(55)	0,00
				\$ 3.195	\$ (29.675)	\$ (26.480)	(0,56)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, M Retail GBP (Hedged) ausschüttend and R Class GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 35.415	\$ 44.784	\$ 15	\$ 0	\$ 15	0,00
	07.2024	\$ 88.151	£ 69.172	0	(711)	(711)	(0,01)
	08.2024	44.629	35.288	0	(14)	(14)	0,00
BRC	07.2024	37	29	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	£ 900	\$ 1.144	6	0	6	0,00
	07.2024	\$ 2.126	£ 1.672	0	(13)	(13)	0,00
	08.2024	£ 9	\$ 11	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
DUB	07.2024	\$ 46.537	£ 36.471	\$ 0	\$ (433)	\$ (433)	(0,01)
MBC	07.2024	£ 35.602	\$ 45.044	40	0	40	0,00
	07.2024	\$ 36	£ 28	0	0	0	0,00
	08.2024	44.968	35.536	0	(39)	(39)	0,00
RBC	07.2024	£ 35.469	\$ 44.978	142	0	142	0,00
	08.2024	\$ 44.986	£ 35.469	0	(141)	(141)	0,00
RYL	07.2024	18	14	0	0	0	0,00
				\$ 203	\$ (1.351)	\$ (1.148)	(0,02)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend II und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 62.625	\$ 46.139	\$ 0	\$ (70)	\$ (70)	0,00
	07.2024	\$ 40.609	SGD 54.813	1	(165)	(164)	0,00
	08.2024	46.139	62.533	70	0	70	0,00
BPS	07.2024	SGD 62.792	\$ 46.298	0	(34)	(34)	0,00
	08.2024	\$ 46.298	SGD 62.701	36	0	36	0,00
BRC	07.2024	SGD 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 887	SGD 1.198	0	(3)	(3)	0,00
CBK	07.2024	2.641	3.563	0	(12)	(12)	0,00
GLM	07.2024	1.169	1.573	0	(8)	(8)	0,00
JPM	07.2024	SGD 299	\$ 222	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 44.559	SGD 59.975	0	(305)	(305)	(0,01)
MBC	07.2024	2.009	2.711	0	(9)	(9)	0,00
MYI	07.2024	24	32	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	SGD 108	\$ 80	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 44.623	SGD 60.128	0	(257)	(257)	(0,01)
UAG	07.2024	422	570	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 108	\$ (864)	\$ (756)	(0,02)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (2.228) (0,05)

Summe Anlagen

\$ 4.907.732 104,31

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (202.794) (4,31)

Nettovermögen

\$ 4.704.938 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,51 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Altice France S.A.	11,500 %	01.02.2027	20.12.2023	\$ 534	\$ 439	0,01

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 249.948 USD (31. Dezember 2023: 275.063 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 10.103 USD (31. Dezember 2023: 4.406 USD) und Barmittel in Höhe von 11.860 USD (31. Dezember 2023: 8.850 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 629 USD (31. Dezember 2023: 7.385 USD) und Barmittel in Höhe von 1.028 USD (31. Dezember 2023: 12.629 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 39.071 USD (31. Dezember 2023: 46.179 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 4.893.306	\$ 1.008	\$ 4.894.314
Investmentfonds	51	0	0	51
Pensionsgeschäfte	0	1.324	0	1.324
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2.764	9.279	0	12.043
<b>Summen</b>	<b>\$ 2.815</b>	<b>\$ 4.903.909</b>	<b>\$ 1.008</b>	<b>\$ 4.907.732</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.267.319	\$ 1.008	\$ 5.268.327
Investmentfonds	147	0	0	147
Pensionsgeschäfte	0	7.572	0	7.572
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	80	1.476	0	1.556
<b>Summen</b>	<b>\$ 227</b>	<b>\$ 5.276.367</b>	<b>\$ 1.008</b>	<b>\$ 5.277.602</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettvermögens
BPS	3,550 %	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (2.177)	\$ (2.337)	(0,05)
	5,350	12.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	£ (4.870)	(6.228)	(0,13)
	5,750	04.04.2024	03.07.2024	\$ (6.972)	(7.070)	(0,15)
	5,900	05.04.2024	03.07.2024	(37.204)	(37.734)	(0,80)
BRC	3,700	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (5.409)	(5.808)	(0,12)
	4,000	08.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (4.244)	(4.270)	(0,09)
IND	5,650	11.04.2024	10.07.2024	(30.901)	(31.294)	(0,67)
JML	3,000	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (4.641)	(4.982)	(0,11)
	3,650	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(6.184)	(6.640)	(0,14)
JPS	5,784	28.06.2024	27.09.2024	\$ (38.949)	(38.968)	(0,83)
SCX	5,710	08.05.2024	05.09.2024	(18.696)	(18.855)	(0,40)
	5,710	04.06.2024	05.09.2024	(38.467)	(38.632)	(0,82)
WFS	5,743	08.04.2024	08.07.2024	(27.790)	(28.162)	(0,60)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (230.980)</b>	<b>(4,91)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 71	\$ 0	\$ 71	\$ 939	\$ (980)	\$ (41)
BOA	(8.964)	9.810	846	(14)	0	(14)
BPS	9.310	(10.040)	(730)	(3.885)	8.850	4.965
BRC	14	0	14	3.327	(7.000)	(3.673)
CBK	(186)	0	(186)	619	(610)	9
DUB	5.497	(5.110)	387	178	0	178
FAR	(11.019)	11.860	841	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(1)	0	(1)	298	(320)	(22)
JPM	1.648	(1.790)	(142)	65	0	65
MBC	(106)	0	(106)	3.492	(5.190)	(1.698)
MYI	(1)	0	(1)	884	(980)	(96)
RBC	(149)	0	(149)	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	85	0	85	(2)	0	(2)
SCX	2.049	(2.120)	(71)	725	(960)	(235)
SSB	(622)	293	(329)	331	(450)	(119)
TOR	122	(270)	(148)	246	0	246
UAG	24	(280)	(256)	(2.859)	4.406	1.547

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	82,55	93,20
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	21,00	8,76
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,47	0,59
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,03	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	0,45
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,21	(0,51)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,05)	0,08
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(4,91)	(4,52)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Österreich	1,87	1,55
Belgien	3,02	2,61
Kanada	2,78	1,31
Dänemark	0,06	0,06
Finnland	0,79	0,87
Frankreich	14,42	12,53
Deutschland	3,21	2,70
Irland	4,55	3,99
Italien	7,28	8,60
Japan	1,76	1,21
Jersey, Kanalinseln	1,78	1,82
Mexiko	0,28	k. A.
Niederlande	12,40	12,89
Norwegen	0,64	k. A.
Portugal	0,38	0,34
Slowenien	0,44	0,51
Spanien	9,18	10,31
Schweden	0,75	0,48
Schweiz	4,63	4,81
Großbritannien	21,09	21,40
USA	3,98	3,17
Kurzfristige Instrumente	8,73	11,39
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,03	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	0,45
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,21	(0,51)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	0,57	(0,30)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,62)	0,38
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,31)	(2,72)
Nettovermögen	100,00	100,00



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ISLAND</b>				<b>CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan European Core Fund</b>				<b>TenneT Holding BV</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,500 % fällig am 27.01.2028 € 1.200 \$ 1.135 0,38				4,500 % fällig am 28.10.2034 € 700 \$ 803 0,27			
Iceland Government International Bond				0,900 % fällig am 12.10.2029 1.000 907 0,31				Vesteda Finance BV			
3,500 % fällig am 21.03.2034 € 900 \$ 974 0,33				<b>CPI Property Group S.A.</b>				4,000 % fällig am 07.05.2032 1.400 1.507 0,51			
				1,750 % fällig am 14.01.2030 100 81 0,03				<b>VIA Outlets BV</b>			
				4,000 % fällig am 22.01.2028 £ 400 442 0,15				1,750 % fällig am 15.11.2028 1.100 1.055 0,36			
				<b>Nestle Finance International Ltd.</b>				<b>Wabtec Transportation Netherlands BV</b>			
				3,000 % fällig am 23.01.2031 € 1.800 1.909 0,65				1,250 % fällig am 03.12.2027 1.900 1.889 0,64			
				<b>P3 Group SARL</b>				<u>20.952 7,09</u>			
				4,625 % fällig am 13.02.2030 500 538 0,18				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>INDIEN</b>				<b>Prologis International Funding S.A.</b>				<b>Niederlandse Waterschapsbank NV</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,750 % fällig am 23.03.2033 475 385 0,13				3,000 % fällig am 05.06.2031 200 214 0,07			
JSW Hydro Energy Ltd.				1,625 % fällig am 17.06.2032 1.425 1.281 0,43				3,000 % fällig am 20.04.2033 900 963 0,33			
4,125 % fällig am 18.05.2031 \$ 1.064 946 0,32				3,625 % fällig am 07.03.2030 200 210 0,07				<b>Netherlands Government International Bond</b>			
ReNew Wind Energy AP2				<b>Segro Capital SARL</b>				3,250 % fällig am 15.01.2044 300 336 0,11			
4,500 % fällig am 14.07.2028 1.700 1.545 0,52				0,500 % fällig am 22.09.2031 1.000 854 0,29				<u>1.513 0,51</u>			
Summe Indien				<b>SELP Finance SARL</b>				<u>22.465 7,60</u>			
				4,625 % fällig am 13.02.2030 500 538 0,18				Summe Niederlande			
				Summe Luxemburg							
				10.637 3,60							
<b>IRLAND</b>				<b>MAURITIUS</b>				<b>NEUSEELAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>AIB Group PLC</b>				<b>India Green Power Holdings</b>				<b>Auckland Council</b>			
2,875 % fällig am 30.05.2031 € 600 624 0,21				4,000 % fällig am 22.02.2027 \$ 373 349 0,12				3,000 % fällig am 18.03.2034 200 209 0,07			
7,125 % fällig am 30.10.2029 (b)(c) 500 537 0,18				<b>MEXIKO</b>				<b>NORWEGEN</b>			
Bank of Ireland Group PLC				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
5,000 % fällig am 04.07.2031 400 454 0,15				<b>Metalsa S.A. de C.V.</b>				<b>DNB Bank ASA</b>			
7,594 % fällig am 06.12.2032 £ 600 784 0,27				3,750 % fällig am 04.05.2031 1.000 798 0,27				4,625 % fällig am 01.11.2029 400 445 0,15			
Smurfit Kappa Treasury ULG				<b>MULTINATIONAL</b>				<b>Statkraft A/S</b>			
0,500 % fällig am 22.09.2029 € 1.000 916 0,31				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,375 % fällig am 22.03.2032 100 107 0,04			
5,438 % fällig am 03.04.2034 \$ 1.400 1.389 0,47				<b>Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC</b>				<u>552 0,19</u>			
Trane Technologies Financing Ltd.				2,000 % fällig am 01.09.2028 € 500 469 0,16				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
5,100 % fällig am 13.06.2034 600 598 0,20				3,000 % fällig am 01.09.2029 150 130 0,04				<b>Kommunalbanken A/S</b>			
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.				Summe multinational				2,875 % fällig am 25.04.2029 1.300 1.387 0,47			
3,000 % fällig am 19.04.2051 650 536 0,18				599 0,20				Summe Norwegen			
3,500 % fällig am 02.05.2052 1.200 1.000 0,34								<u>1.939 0,66</u>			
<u>6.838 2,31</u>								<b>SINGAPUR</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>ITALIEN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>				<b>Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,250 % fällig am 25.03.2027 \$ 609 568 0,19			
<b>Ferrovie dello Stato Italiane SpA</b>				<b>Alliander NV</b>				<b>SÜDKOREA</b>			
3,750 % fällig am 14.04.2027 € 1.200 1.292 0,44				4,500 % fällig am 27.03.2032 (b) 200 215 0,07				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Intesa Sanpaolo SpA</b>				<b>Arcadis NV</b>				<b>LG Energy Solution Ltd.</b>			
3,625 % fällig am 16.10.2030 700 741 0,25				4,875 % fällig am 28.02.2028 400 442 0,15				5,750 % fällig am 25.09.2028 300 304 0,10			
<b>UniCredit SpA</b>				<b>ASR Nederland NV</b>				<b>Shinhan Bank Co. Ltd.</b>			
5,850 % fällig am 15.11.2027 1.600 1.791 0,61				3,625 % fällig am 12.12.2028 400 429 0,15				3,320 % fällig am 29.01.2027 € 1.300 1.387 0,47			
<u>3.824 1,30</u>				<b>CTP NV</b>				<u>1.691 0,57</u>			
				1,250 % fällig am 21.06.2029 2.000 1.862 0,63				<b>SPANIEN</b>			
				4,750 % fällig am 05.02.2030 400 435 0,15				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Digital Intrepid Holding BV</b>				<b>Banco Santander S.A.</b>			
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>				0,625 % fällig am 15.07.2031 1.500 1.266 0,43				0,625 % fällig am 24.06.2029 900 857 0,29			
1,500 % fällig am 30.04.2045 1.050 689 0,23				<b>DSV Finance BV</b>				<b>CaixaBank S.A.</b>			
4,000 % fällig am 30.10.2031 400 436 0,15				0,500 % fällig am 03.03.2031 500 439 0,15				0,500 % fällig am 09.02.2029 100 95 0,03			
<u>1.125 0,38</u>				<b>EnBW International Finance BV</b>				1,500 % fällig am 03.12.2026 £ 600 715 0,24			
<u>4.949 1,68</u>				4,300 % fällig am 23.05.2034 300 333 0,11				3,750 % fällig am 07.09.2029 € 1.900 2.068 0,70			
				<b>Enel Finance International NV</b>				<b>Caja Rural de Navarra SCC</b>			
				1,375 % fällig am 12.07.2026 \$ 1.000 926 0,31				3,000 % fällig am 26.04.2027 2.100 2.225 0,75			
<b>JAPAN</b>				<b>ING Groep NV</b>				<b>EDP Servicios Financieros Espana S.A.</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,000 % fällig am 12.02.2035 € 900 972 0,33				4,375 % fällig am 04.04.2032 1.300 1.444 0,49			
<b>Norinchukin Bank</b>				4,875 % fällig am 16.05.2029 (b)(c) \$ 1.000 871 0,29				<b>Telefonica Emisiones S.A.</b>			
2,080 % fällig am 22.09.2031 \$ 1.000 791 0,27				8,000 % fällig am 16.05.2030 (b)(c) 1.000 1.021 0,35				4,183 % fällig am 21.11.2033 500 548 0,19			
4,867 % fällig am 14.09.2027 600 583 0,20				<b>JAB Holdings BV</b>				<u>7.952 2,69</u>			
<b>NTT Finance Corp.</b>				4,375 % fällig am 25.04.2034 € 1.100 1.185 0,40				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
0,399 % fällig am 13.12.2028 € 1.300 1.225 0,41				<b>JDE Peet's NV</b>				<b>Adif Alta Velocidad</b>			
4,239 % fällig am 25.07.2025 \$ 2.900 2.864 0,97				2,250 % fällig am 24.09.2031 \$ 1.000 809 0,27				3,500 % fällig am 30.04.2032 1.300 1.384 0,47			
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>				<b>LeasePlan Corp. NV</b>				<b>Autonomous Community of Madrid</b>			
2,800 % fällig am 10.03.2027 800 754 0,25				0,250 % fällig am 07.09.2026 € 1.400 1.398 0,47				3,596 % fällig am 30.04.2033 300 325 0,11			
<u>6.217 2,10</u>				<b>Lseg Netherlands BV</b>				<b>Spain Government International Bond</b>			
				4,231 % fällig am 29.09.2030 500 554 0,19				1,000 % fällig am 30.07.2042 1.700 1.167 0,39			
				<b>Nationale-Niederlanden Bank NV</b>							
				0,500 % fällig am 21.09.2028 1.100 1.040 0,35							
				1,875 % fällig am 17.05.2032 200 195 0,07							
				<b>NE Property BV</b>							
				2,000 % fällig am 20.01.2030 1.400 1.306 0,44							





## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD 2.023	\$ 1.348	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
BOA	07.2024	€ 94.275	102.360	1.322	0	1.322	0,45
BPS	07.2024	47.359	51.272	515	0	515	0,17
	07.2024	£ 23.033	29.423	307	0	307	0,10
	07.2024	\$ 3.939	AUD 5.912	9	0	9	0,00
	07.2024	2.644	€ 2.457	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	24	SGD 33	0	0	0	0,00
	08.2024	AUD 5.912	\$ 3.943	0	(9)	(9)	0,00
	08.2024	SGD 33	24	0	0	0	0,00
BRC	07.2024	€ 1.531	1.646	5	0	5	0,00
	09.2024	MXN 13	1	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	AUD 3.222	2.146	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	€ 2.162	2.315	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	£ 961	1.223	8	0	8	0,00
GLM	07.2024	€ 700	758	8	0	8	0,00
	08.2024	\$ 693	BRL 3.667	0	(35)	(35)	(0,01)
JPM	07.2024	£ 550	\$ 704	9	0	9	0,00
	07.2024	SGD 14	11	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 663	MXN 12.005	0	(15)	(15)	(0,01)
MBC	07.2024	AUD 667	\$ 443	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	CAD 7.550	5.545	27	0	27	0,01
	07.2024	€ 1.086	1.178	14	0	14	0,01
	07.2024	\$ 5.518	CAD 7.555	3	0	3	0,00
	07.2024	54.973	€ 51.410	126	0	126	0,04
	08.2024	CAD 7.550	\$ 5.518	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	€ 51.410	55.053	0	(127)	(127)	(0,04)
MYI	07.2024	£ 18	22	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 19	14	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 93	€ 87	0	0	0	0,00
	07.2024	497	£ 393	0	0	0	0,00
	07.2024	9	SGD 13	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	31.125	£ 24.544	0	(99)	(99)	(0,03)
	08.2024	£ 24.544	\$ 31.130	98	0	98	0,03
SCX	07.2024	\$ 99.903	€ 93.245	33	0	33	0,01
	08.2024	€ 93.245	\$ 100.050	0	(32)	(32)	(0,01)
				\$ 2.484	\$ (344)	\$ 2.140	0,72

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD 1.052	\$ 701	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07.2024	\$ 1.379	AUD 2.071	4	0	4	0,00
	08.2024	701	1.052	2	0	2	0,00
BRC	07.2024	655	990	6	0	6	0,01
MBC	07.2024	14	21	0	0	0	0,00
				\$ 12	\$ (2)	\$ 10	0,01

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 44	CHF 39	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	07.2024	4	3	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	37	33	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	1	1	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	CHF 40	\$ 45	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 43	CHF 39	0	0	0	0,00
	08.2024	45	40	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 96	\$ 103	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 48.398	€ 44.578	0	(623)	(623)	(0,21)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	€ 41.504	\$ 44.393	\$ 0	\$ (89)	\$ (89)	(0,03)
	07.2024	\$ 46.342	€ 42.805	0	(466)	(466)	(0,16)
	08.2024	€ 37	\$ 40	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 44.371	€ 41.423	89	0	89	0,03
BRC	07.2024	43.156	39.852	0	(444)	(444)	(0,15)
CBK	07.2024	€ 279	\$ 299	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 223	€ 208	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	€ 2	\$ 2	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	36	38	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	42.786	45.752	1	(105)	(104)	(0,04)
	08.2024	\$ 45.785	€ 42.752	106	0	106	0,04
SCX	07.2024	€ 42.740	\$ 45.792	0	(15)	(15)	(0,01)
	08.2024	\$ 45.859	€ 42.740	14	0	14	0,01
				\$ 210	\$ (1.742)	\$ (1.532)	(0,52)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 27.797	\$ 35.151	\$ 12	\$ 0	\$ 12	0,01
	07.2024	\$ 106.741	£ 83.838	0	(762)	(762)	(0,26)
	08.2024	35.013	27.684	0	(11)	(11)	0,00
BRC	07.2024	25	20	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	£ 99	\$ 126	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 3.282	£ 2.578	0	(23)	(23)	(0,01)
	08.2024	10	8	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	£ 30.083	\$ 38.068	40	0	40	0,01
	07.2024	\$ 2	£ 2	0	0	0	0,00
	08.2024	36.041	28.482	0	(31)	(31)	(0,01)
RBC	07.2024	£ 28.458	\$ 36.087	114	0	114	0,04
	08.2024	\$ 36.093	£ 28.458	0	(114)	(114)	(0,04)
				\$ 167	\$ (941)	\$ (774)	(0,26)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 2	SEK 24	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	07.2024	SEK 15.733	\$ 1.484	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 1.180	SEK 12.364	0	(12)	(12)	0,00
CBK	07.2024	1.484	15.708	1	0	1	0,00
	07.2024	SEK 492	\$ 47	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	\$ 685	SEK 7.269	2	0	2	0,00
	07.2024	SEK 24	\$ 2	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 659	SEK 6.918	0	(5)	(5)	0,00
RYL	07.2024	16	168	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 43	\$ 4	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	\$ 659	SEK 6.925	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	SEK 5	\$ 0	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	\$ 1.181	SEK 12.364	0	(14)	(14)	(0,01)
	07.2024	2	21	0	0	0	0,00
				\$ 3	\$ (37)	\$ (34)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 1.913	\$ 1.409	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07.2024	\$ 2.693	SGD 3.636	0	(10)	(10)	(0,01)
	08.2024	SGD 10	\$ 7	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 1.409	SGD 1.910	2	0	2	0,00
CBK	07.2024	17	23	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	SGD 17	\$ 13	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 26	SGD 35	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	SGD 4	\$ 3	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2	SGD 3	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	SGD 3	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.401	SGD 1.887	0	(8)	(8)	0,00
UAG	07.2024	SGD 5	\$ 3	0	0	0	0,00
				\$ 2	\$ (20)	\$ (18)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (208) (0,07)

Summe Anlagen

\$ 288.224 97,54

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 7.268 2,46

Nettovermögen

\$ 295.492 100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Nullkuponwertpapier.  
 (b) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar  
 (c) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 623 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.388 USD (31. Dezember 2023: 3.138 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.040 USD (31. Dezember 2023: 50 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 281.859	\$ 0	\$ 281.859
Pensionsgeschäfte	0	6.894	0	6.894
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(619)	90	0	(529)
<b>Summen</b>	<b>\$ (619)</b>	<b>\$ 288.843</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 288.224</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 249.832	\$ 0	\$ 249.832
Pensionsgeschäfte	0	5.800	0	5.800
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(2.137)	2.269	0	132
<b>Summen</b>	<b>\$ (2.137)</b>	<b>\$ 257.901</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 255.764</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 1	\$ 32	\$ 0	\$ 32
BOA	689	(760)	(71)	90	0	90
BPS	(416)	510	94	35	0	35
BRC	(445)	530	85	(17)	50	33
CBK	(20)	0	(20)	(2)	0	(2)
GLM	(27)	0	(27)	(172)	0	(172)
JPM	(6)	0	(6)	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	44	0	44	2	0	2
MYI	0	(10)	(10)	274	(540)	(266)
RBC	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(5)	0	(5)	(15)	0	(15)
SCX	(22)	0	(22)	88	0	88
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	173	0	173
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	42	0	42

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	78,80	82,55
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	16,39	12,69
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,20	2,21
Pensionsgeschäfte	2,33	(0,12)
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,09)	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	0,20
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,07)	(0,31)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	1,88	0,37
Österreich	0,93	0,51
Belgien	1,16	0,50
Brasilien	0,20	0,08
Kanada	2,63	1,97
Chile	0,90	0,85
Zypern	k. A.	0,36
Tschechische Republik	0,22	0,26
Dänemark	1,65	1,54
Finnland	1,02	1,39
Frankreich	6,07	6,56
Deutschland	11,37	13,86
Island	0,33	k. A.
Indien	0,84	0,95
Irland	2,31	2,23
Italien	1,68	1,95
Japan	2,10	3,15
Jersey, Kanalinseln	0,33	0,05
Luxemburg	3,60	3,20
Mauritius	0,12	0,14
Mexiko	0,27	0,37
Multinational	0,20	0,63
Niederlande	7,60	7,67
Neuseeland	0,07	k. A.
Norwegen	0,66	0,18
Singapur	0,19	0,22
Südkorea	0,57	0,38
Spanien	3,68	3,97
Supranational	7,30	8,34
Schweden	1,77	1,58
Vereinigte Arabische Emirate	k. A.	0,23
Großbritannien	10,61	10,77
USA	22,86	20,67
Jungfernseln (Britisch)	0,27	0,31
Pensionsgeschäfte	2,33	2,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,09)	(0,12)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,02)	(0,03)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	0,72	(0,37)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,79)	0,57
Sonstige Aktiva und Passiva	2,46	2,50
Nettovermögen	100,00	100,00





BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (b)	2.933	\$ 29	0,00
<b>Summe Investmentfonds</b>		<b>\$ 29</b>	<b>0,00</b>

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 333	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (340)	\$ 333	\$ 333	0,04
SAL	5,270	28.06.2024	01.07.2024	2.000	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(2.048)	2.000	2.001	0,25
	5,400	28.06.2024	01.07.2024	18.000	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 31.03.2026	(18.386)	18.000	18.008	2,26
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (20.774)</b>	<b>\$ 20.333</b>	<b>\$ 20.342</b>	<b>2,55</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2024	69	\$ 15	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	124	(21)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2024	107	132	0,02
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	164	(206)	(0,03)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2024	373	(8)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	207	(177)	(0,02)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	39	(128)	(0,02)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	55	66	0,01
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	733	361	0,04
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	942	(591)	(0,07)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	323	(257)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	121	(101)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	313	219	0,03
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	628	(433)	(0,06)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	130	77	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	92	37	0,00
				<b>\$ (1.015)</b>	<b>(0,13)</b>

**VERKAUFSoPTIONEN****FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
Call - EUREX Euro-Schatz August 2024 Futures	€ 106,200	26.07.2024	306	\$ (53)	\$ (21)	0,00
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>					<b>\$ (1.036)</b>	<b>(0,13)</b>

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000 %	18.09.2029	£ 29.200	\$ 159	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.09.2027	¥ 74.880	2	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.12.2031	986.000	40	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,550	14.09.2028	2.370.000	67	0,01
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2047	\$ 1.750	50	0,01
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,428	20.12.2047	400	11	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	1.115	31	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499	20.12.2047	570	16	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,880 %	25.01.2052	\$ 5.000	\$ (60)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,237	21.11.2053	7.640	105	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,340	21.11.2028	37.090	(379)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	18.600	474	0,06
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	22.300	(523)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	4.600	72	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,758	18.01.2026	690	10	0,00
Erhalt	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	NZD 900	(3)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 1.200	4	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	900	(2)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	950	(2)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	1.600	(4)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	200	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	4.900	(27)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	2.400	(6)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	2.100	(12)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	4.700	(18)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	2.100	(7)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	30.400	1.286	0,16
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	64.800	(1.379)	(0,17)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,879	15.08.2032	13.400	15	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,475	26.02.2025	145.000	192	0,02
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	4.000	(7)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	60	0	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,356	15.11.2033	3.200	(16)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,363	15.11.2033	1.800	(9)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,390	15.11.2033	1.800	(9)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,400	15.02.2044	3.400	7	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,421	15.05.2052	700	(2)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	11.900	50	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,488	15.05.2037	4.790	(19)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,548	15.11.2053	500	2	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,570	15.06.2032	8.800	37	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,580	15.03.2052	500	(2)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,590	15.03.2052	4.940	(16)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	10.600	47	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,620	15.11.2053	200	1	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,680	15.04.2053	2.100	(9)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,682	15.10.2053	600	(3)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,700	15.04.2053	1.100	(5)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,736	15.10.2053	900	(4)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,763	15.09.2053	1.800	(8)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	4,470	15.09.2024	19.900	47	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	\$ 1.000	12	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	3.000	37	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	700	(7)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	3.600	(35)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,155	17.10.2027	1.900	(24)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	5.100	35	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,335	05.02.2028	2.680	(32)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	1.790	(20)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,360	09.05.2028	2.690	(30)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	2.750	(31)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,560	12.09.2024	3.400	(22)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,565	12.09.2024	5.000	(32)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,573	26.08.2028	1.100	11	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,645	10.09.2028	1.500	15	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,690	01.06.2026	2.100	24	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	1.270	14	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	3.100	35	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	1.400	16	0,00
Zahlung	FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	€ 390	3	0,00
Zahlung	UKRPI	3,100	15.06.2031	£ 2.300	(57)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,400	15.06.2030	1.610	(40)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,530	15.10.2031	540	(14)	0,00
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	300	(7)	0,00
Erhalt	UKRPI	4,125	15.09.2032	590	13	0,00
Erhalt	UKRPI	4,130	15.09.2032	2.610	56	0,01
Erhalt	UKRPI	4,143	15.10.2032	2.300	49	0,01
					<b>\$ 164</b>	<b>0,02</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 164</b>	<b>0,02</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## VERKAUFSOPTIONEN

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final / Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.200	\$ (55)	\$ (43)	(0,01)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	3,150 %	06.10.2025	13.100	\$ (151)	\$ (176)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,150	06.10.2025	13.100	(151)	(59)	(0,01)
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950	15.09.2025	10.800	(131)	(119)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	15.09.2025	10.800	(131)	(68)	(0,01)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	6.800	(88)	(66)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	6.800	(88)	(42)	(0,01)
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	14.600	(185)	(126)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	14.600	(185)	(102)	(0,01)
							\$ (1.110)	\$ (758)	(0,09)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
DUB	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 1.031	\$ (72)	\$ 72	\$ 0	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	1.238	(64)	63	(1)	0,00
					\$ (136)	\$ 135	\$ (1)	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998 %	20.06.2028	ILS 890	\$ 0	\$ (20)	\$ (20)	0,00
BRC	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	810	0	(18)	(18)	0,00
CKL	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	750	(2)	(14)	(16)	0,00
GLM	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	1.430	0	(29)	(29)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	610	0	(14)	(14)	0,00
HUS	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	480	0	(11)	(11)	0,00
						\$ (2)	\$ (106)	\$ (108)	(0,01)

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	BCOMTR Index	70.056	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 16.803	18.02.2025	\$ 0	\$ (157)	\$ (157)	(0,02)
	Erhalt	BCOMTR1 Index	1.368.505	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	125.120	18.02.2025	0	(1.170)	(1.170)	(0,15)
CBK	Erhalt	BCOMF1TC Index	348.889	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	41.211	18.02.2025	0	(409)	(409)	(0,05)
	Erhalt	BCOMTR Index	35.951	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	8.623	18.02.2025	0	(81)	(81)	(0,01)
	Erhalt	CIXBSTR3 Index	693.551	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	182.240	18.02.2025	0	(1.610)	(1.610)	(0,20)
GST	Erhalt	BCOMF1TC Index	235.692	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	90.279	18.02.2025	0	(897)	(897)	(0,11)
	Erhalt	BCOMTR Index	256.229	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	61.457	18.02.2025	0	(575)	(575)	(0,07)
JPM	Erhalt	BCOMF1TC Index	315.223	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	63.150	18.02.2025	0	(627)	(627)	(0,08)
	Erhalt	BCOMTR Index	99.288	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	23.815	18.02.2025	0	(223)	(223)	(0,03)
	Erhalt	JMABDEWU Index	494.170	0,053 %	79.348	18.02.2025	0	505	505	0,06
	Erhalt	JMABNIU5 Index	164.986	0,000	30.535	18.02.2025	0	62	62	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
MAC	Erhalt	PIMCOBVB Index	155.117	0,600 %	\$ 17.634	15.07.2024	\$ 0	\$ 520	\$ 520	0,07
	Erhalt	PIMCOBDB Index	539.651	0,210	90.194	16.09.2024	0	417	417	0,05
MEI	Erhalt	BCOMTR Index	54.100	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	12.976	18.02.2025	0	(121)	(121)	(0,01)
SOG	Erhalt	BCOMTR Index	233.991	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	56.123	18.02.2025	0	(524)	(524)	(0,07)
							\$ 0	\$ (4.890)	\$ (4.890)	(0,61)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	\$ 271	NZD 443	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	08.2024	NZD 443	\$ 271	1	0	1	0,00
	10.2024	\$ 1.140	CNH 8.158	0	(13)	(13)	0,00
BOA	07.2024	KRW 1.662.898	\$ 1.216	8	0	8	0,00
	07.2024	\$ 253	PLN 1.008	0	(2)	(2)	0,00
BPS	07.2024	£ 58.540	\$ 74.779	779	0	779	0,10
	07.2024	KRW 1.650.437	1.202	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 9.538	AUD 14.315	22	0	22	0,00
	07.2024	409	€ 380	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	200	IDR 3.277.278	0	0	0	0,00
	07.2024	872	NZD 1.419	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	605	PLN 2.402	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	1.415	SGD 1.919	1	0	1	0,00
	08.2024	AUD 14.315	\$ 9.546	0	(22)	(22)	0,00
	08.2024	SGD 1.916	1.415	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	CNH 19.194	2.679	34	0	34	0,01
	09.2024	TWD 56.943	1.770	11	0	11	0,00
	09.2024	\$ 452	INR 37.804	1	0	1	0,00
	10.2024	CNH 10.318	\$ 1.440	15	0	15	0,00
	10.2024	\$ 228	CNH 1.632	0	(2)	(2)	0,00
BRC	07.2024	DKK 12.313	\$ 1.793	23	0	23	0,00
	07.2024	MXN 4.358	236	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	NOK 3.949	375	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 351	PLN 1.401	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	13.824	SEK 146.513	11	0	11	0,00
	08.2024	SEK 146.289	\$ 13.824	0	(10)	(10)	0,00
	09.2024	MXN 6.678	353	0	(8)	(8)	0,00
	09.2024	\$ 2.161	MXN 40.490	27	0	27	0,00
CBK	07.2024	CHF 393	\$ 432	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	£ 91	116	1	0	1	0,00
	07.2024	KRW 123.663	91	1	0	1	0,00
	07.2024	SEK 146.438	13.814	0	(14)	(14)	0,00
	07.2024	\$ 788	BRL 4.293	0	(15)	(15)	0,00
	07.2024	622	PLN 2.467	0	(8)	(8)	0,00
	08.2024	BRL 4.308	\$ 788	15	0	15	0,00
	08.2024	PEN 954	252	3	0	3	0,00
	09.2024	TWD 21.710	674	3	0	3	0,00
	09.2024	\$ 2.018	INR 168.682	2	(1)	1	0,00
DUB	07.2024	KRW 902.056	\$ 656	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 649	PLN 2.549	0	(15)	(15)	0,00
	08.2024	BRL 1.565	\$ 304	23	0	23	0,00
FAR	07.2024	AUD 14.115	9.404	0	(22)	(22)	0,00
	07.2024	€ 191.664	208.752	3.335	0	3.335	0,41
	07.2024	¥ 9.337.503	59.794	1.747	0	1.747	0,22
	07.2024	NZD 3.358	2.069	23	0	23	0,00
	07.2024	\$ 519	NZD 851	0	0	0	0,00
	08.2024	NZD 851	\$ 519	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	MXN 4.105	221	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	\$ 400	PLN 1.580	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	1.177	ZAR 21.537	1	0	1	0,00
	08.2024	1.233	BRL 6.323	0	(98)	(98)	(0,01)
JPM	07.2024	CHF 238	\$ 263	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	KRW 1.113.262	807	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	SGD 1.919	1.426	10	0	10	0,00
	07.2024	\$ 3.309	CHF 2.969	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	2.666	DKK 18.582	4	0	4	0,00
	07.2024	1.035	€ 949	0	(18)	(18)	0,00
	07.2024	155	IDR 2.508.972	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	150	ILS 553	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	258	PLN 1.010	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	2.216	ZAR 40.795	15	0	15	0,00
	08.2024	CHF 2.958	\$ 3.309	4	0	4	0,00
	08.2024	DKK 18.549	2.666	0	(4)	(4)	0,00
	09.2024	TWD 36.937	1.147	6	0	6	0,00
	09.2024	\$ 230	INR 19.235	1	0	1	0,00
	10.2024	CNH 10.581	\$ 1.479	17	0	17	0,00
	10.2024	\$ 228	CNH 1.627	0	(3)	(3)	0,00
MBC	07.2024	AUD 200	\$ 133	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	CAD 7.644	5.614	28	0	28	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2024	¥	26.300	\$ 167	\$ 3	\$ 0	0,00	
	07.2024	\$	5.586	CAD 7.649	3	0	0,00	
	07.2024		288	NOK 3.072	0	0	0,00	
	08.2024	CAD	7.644	\$ 5.586	0	(4)	0,00	
	08.2024	NOK	3.070	288	0	0	0,00	
	10.2024	CNH	1	0	0	0	0,00	
MYI	07.2024	BRL	4.292	831	58	0	0,01	
	07.2024	€	662	709	0	(1)	0,00	
	07.2024	£	29	36	0	0	0,00	
	07.2024	SGD	340	251	0	(1)	0,00	
	07.2024	\$	1.827	DKK 12.753	6	0	0,00	
	07.2024		1	£ 1	0	0	0,00	
	07.2024		82	NOK 877	0	0	0,00	
	08.2024	DKK	12.731	\$ 1.827	0	(6)	0,00	
	08.2024	NOK	877	82	0	0	0,00	
	09.2024	TWD	14.694	458	4	0	0,00	
	09.2024	\$	154	INR 12.839	0	0	0,00	
RBC	07.2024		74.350	£ 58.631	0	(235)	(0,03)	
SCX	08.2024	£	58.631	\$ 74.362	234	0	0,03	
	07.2024	€	56	60	0	0	0,00	
	07.2024	KRW	837.512	614	6	0	0,00	
	07.2024	MXN	44	2	0	0	0,00	
	07.2024	\$	204.959	€ 191.300	67	0	0,01	
	07.2024		518	£ 410	0	0	0,00	
	08.2024	€	191.300	\$ 205.260	0	(65)	(0,01)	
	08.2024	PEN	1.107	293	4	0	0,00	
	09.2024	CNH	7.112	991	12	0	0,00	
	09.2024	TWD	21.358	662	3	0	0,00	
	09.2024	\$	1.853	INR 155.131	3	0	0,00	
SSB	07.2024	€	965	\$ 1.035	1	0	0,00	
TOR	07.2024	CHF	10	12	0	0	0,00	
	07.2024	\$	58.564	¥ 9.364.389	0	(349)	(0,04)	
	07.2024		395	NZD 645	0	(2)	0,00	
	08.2024	¥	9.320.478	\$ 58.564	349	0	0,04	
UAG	08.2024	NZD	645	395	2	0	0,00	
	07.2024	CHF	2.329	2.578	0	(15)	0,00	
	07.2024	DKK	19.060	2.768	29	0	0,00	
	07.2024	ILS	1.437	388	6	0	0,00	
					\$ 6.970	\$ (990)	\$ 5.980	0,74

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2024	€	13	\$ 14	\$ 0	\$ 0	0,00	
	07.2024	\$	69.593	€ 64.098	0	(896)	(0,11)	
BPS	07.2024	€	59.669	\$ 63.856	30	(124)	(0,01)	
	07.2024	\$	53.385	€ 49.312	0	(535)	(0,07)	
	08.2024		61.687	57.589	123	0	0,02	
BRC	07.2024	€	86	\$ 92	0	0	0,00	
CBK	07.2024		299	326	5	0	0,00	
	07.2024	\$	1.313	€ 1.223	0	(2)	0,00	
FAR	07.2024		65.806	60.419	0	(1.050)	(0,13)	
GLM	07.2024		5	4	0	0	0,00	
JPM	07.2024	€	472	\$ 505	0	(1)	0,00	
MBC	07.2024		57.937	61.952	1	(142)	(0,02)	
	07.2024	\$	106	€ 98	0	(1)	0,00	
	08.2024		61.860	57.767	141	0	0,02	
RBC	07.2024		69	63	0	(1)	0,00	
RYL	07.2024		187	175	0	0	0,00	
SCX	07.2024	€	58.811	\$ 63.012	1	(20)	0,00	
	08.2024	\$	62.620	€ 58.361	20	0	0,00	
SSB	07.2024	€	2.219	\$ 2.378	0	(1)	0,00	
	07.2024	\$	4.462	€ 4.113	0	(54)	(0,01)	
	08.2024		2.331	2.173	1	0	0,00	
UAG	08.2024		281	263	1	0	0,00	
					\$ 323	\$ (2.827)	\$ (2.504)	(0,31)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£	6.373	\$ 8.059	\$ 3	\$ 3	0,00
	07.2024	\$	15.350	£ 12.044	0	(125)	(0,02)
	08.2024		8.011	6.335	0	(3)	0,00
BRC	07.2024	£	0	\$ 0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2024	£ 344	\$ 437	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2024	\$ 641	£ 504	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	139	110	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	8.511	6.670	0	(79)	(79)	(0,01)
	07.2024	£ 6.242	\$ 7.898	7	0	7	0,00
MBC	08.2024	\$ 7.837	£ 6.193	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	£ 6.259	\$ 7.937	25	0	25	0,00
RBC	08.2024	\$ 7.939	£ 6.259	0	(25)	(25)	0,00
	07.2024	1	1	0	0	0	0,00
RYL	07.2024						
				\$ 38	\$ (243)	\$ (205)	(0,03)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse E Class SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 530	\$ 391	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2024	\$ 312	SGD 422	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	391	530	1	0	1	0,00
BPS	07.2024	SGD 404	\$ 298	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 488	SGD 661	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	22	29	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	SGD 8	\$ 6	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 21	SGD 28	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	309	416	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2024	SGD 63	\$ 47	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 292	SGD 397	1	0	1	0,00
MYI	07.2024	266	360	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 2	\$ (6)	\$ (4)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (2.533)	(0,32)
Summe Anlagen						\$ 1.172.743	146,86
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (374.178)	(46,86)
Nettovermögen						\$ 798.565	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Mit dem Fonds verbunden.

(c) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 320.086 USD (31. Dezember 2023: 397.126 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 777 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2023: 935 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 9.405 USD (31. Dezember 2023: 10.174 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.700 USD (31. Dezember 2023: 5.750 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.155.604	\$ 182	\$ 1.155.786
Investmentfonds	29	0	0	29
Pensionsgeschäfte	0	20.333	0	20.333
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	50	(3.455)	0	(3.405)
Summen	\$ 79	\$ 1.172.482	\$ 182	\$ 1.172.743

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.293.241	\$ 186	\$ 1.293.427
Investmentfonds	127	0	0	127
Pensionsgeschäfte	0	83.018	0	83.018
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	83	(14.437)	0	(14.354)
Summen	\$ 210	\$ 1.361.822	\$ 186	\$ 1.362.218

- (1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.  
(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.  
(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,500 %	27.06.2024	05.07.2024	\$ (6.707)	\$ (6.711)	(0,84)
STR	5,450	28.06.2024	01.07.2024	(279.303)	(279.430)	(34,99)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (286.141)</b>	<b>(35,83)</b>

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (13)	\$ 0	\$ (13)	\$ (110)	\$ 0	\$ (110)
BOA	(912)	930	18	(1.708)	1.650	(58)
BPS	(1.132)	700	(432)	(1.871)	690	(1.181)
BRC	(210)	130	(80)	(994)	1.770	776
CBK	(2.304)	1.200	(1.104)	(1.028)	(1.270)	(2.298)
CIB	k. A.	k. A.	k. A.	(27)	0	(27)
CKL	(16)	0	(16)	(9)	0	(9)
DUB	(71)	0	(71)	1	0	1
FAR	4.033	(4.200)	(167)	(416)	400	(16)
GLM	(301)	260	(41)	(853)	690	(163)
GST	(1.701)	1.150	(551)	(1.244)	(1.480)	(2.724)
HUS	(11)	0	(11)	(6)	0	(6)
JPM	(272)	50	(222)	(784)	(390)	(1.174)
MAC	937	(1.130)	(193)	(422)	(10)	(432)
MBC	29	0	29	90	0	90
MEI	(121)	0	(121)	(33)	0	(33)
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(56)	0	(56)
MYI	59	(60)	(1)	3	(530)	(527)
RBC	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	31	0	31	(494)	550	56
SOG	(524)	280	(244)	(7)	0	(7)
SSB	(53)	0	(53)	55	0	55
UAG	21	0	21	(187)	0	(187)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	124,11	128,93
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	17,38	21,67
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,25	k. A.
Investmentfonds	0,00	0,01
Pensionsgeschäfte	2,55	9,67
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,13)	(0,54)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,02	0,04
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,32)	(1,18)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(35,83)	(46,11)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	0,92	0,88
Kanada	0,30	0,29
Kaimaninseln	2,62	4,88
Dänemark	0,56	1,33
Frankreich	4,77	4,65
Irland	5,47	6,06
Italien	11,08	10,15
Japan	7,27	7,70
Neuseeland	0,25	0,24
Peru	0,01	0,01
Spanien	4,09	3,94
Schweden	1,73	1,68
Schweiz	0,13	0,12

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Großbritannien	9,41	10,95
USA	95,60	97,58
Kurzfristige Instrumente	0,53	0,14
Investmentfonds	0,00	0,01
Pensionsgeschäfte	2,55	9,67
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,13)	(0,51)
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,02	0,04
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,09)	(0,28)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,01)	(0,01)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,61)	(0,37)
Devisenterminkontrakte	0,74	(0,65)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,34)	0,14
Sonstige Aktiva und Passiva	(46,86)	(58,60)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>ARGENTINIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Argentina Government International Bond			
1,000 % fällig am 09.07.2029	\$ 13	\$ 8	0,01
3,500 % fällig am 09.07.2041	800	315	0,26
Summe Argentinien		323	0,27
<b>AUSTRALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Santos Finance Ltd.			
3,649 % fällig am 29.04.2031	1.170	1.024	0,85
Virgin Australia Holdings Pty. Ltd			
8,125 % fällig am 15.11.2024 ^	373	3	0,00
Woodside Finance Ltd.			
3,700 % fällig am 15.03.2028	200	189	0,16
4,500 % fällig am 04.03.2029	600	579	0,48
Summe Australien		1.795	1,49
<b>BERMUDA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Aircastle Ltd.			
6,500 % fällig am 18.07.2028	725	739	0,61
NCL Finance Ltd.			
6,125 % fällig am 15.03.2028 (h)	500	494	0,41
Summe Bermuda		1.233	1,02
<b>KANADA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Air Canada Pass-Through Trust			
3,300 % fällig am 15.07.2031	36	33	0,03
Bombardier, Inc.			
7,250 % fällig am 01.07.2031	325	334	0,28
Fairfax Financial Holdings Ltd.			
6,000 % fällig am 07.12.2033	50	51	0,04
Garda World Security Corp.			
6,000 % fällig am 01.06.2029	400	365	0,30
Summe Kanada		783	0,65
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
B.C. Unlimited Liability Co.			
7,094 % fällig am 20.09.2030	900	899	0,75
Bausch & Lomb Corp.			
9,344 % fällig am 29.09.2028	496	496	0,41
GFL Environmental, Inc.			
TBD % fällig am 27.06.2031	300	301	0,25
Ontario Gaming GTA LP			
9,585 % fällig am 01.08.2030	199	200	0,16
Summe Kanada		1.896	1,57
<b>KAIMANINSELN</b>			
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
Sunac China Holdings Ltd.			
1,000 % fällig am 30.09.2032	28	2	0,00
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2,528 % fällig am 18.11.2027	925	832	0,69
GGAM Finance Ltd.			
8,000 % fällig am 15.02.2027	200	207	0,17
Kaisa Group Holdings Ltd.			
11,500 % fällig am 30.01.2023 ^	600	21	0,02
Melco Resorts Finance Ltd.			
5,625 % fällig am 17.07.2027	300	287	0,24
MGM China Holdings Ltd.			
4,750 % fällig am 01.02.2027	900	858	0,71
Sands China Ltd.			
3,250 % fällig am 08.08.2031	700	590	0,49
4,050 % fällig am 08.01.2026	600	581	0,48
5,400 % fällig am 08.08.2028	100	98	0,08
Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % Bargeld oder 6,000 % PIK)			
5,000 % fällig am 30.09.2026 (a)	33	4	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>SUNAC CHINA HOLDINGS LTD.</b>			
Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % Bargeld oder 6,250 % PIK)			
5,250 % fällig am 30.09.2027 (a)	\$ 33	\$ 3	0,00
Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % Bargeld oder 6,500 % PIK)			
5,500 % fällig am 30.09.2027 (a)	66	6	0,01
Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % Bargeld oder 6,750 % PIK)			
5,750 % fällig am 30.09.2028 (a)	100	9	0,01
Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % Bargeld oder 7,000 % PIK)			
6,000 % fällig am 30.09.2029 (a)	100	8	0,01
Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % Bargeld oder 7,250 % PIK)			
6,250 % fällig am 30.09.2030 (a)	47	3	0,00
Wynn Macau Ltd.			
5,125 % fällig am 15.12.2029	375	340	0,28
5,500 % fällig am 01.10.2027	100	95	0,08
Summe Kaimaninseln		3.942	3,27
<b>CHINA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Yangjo Justice International Ltd.			
7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	200	1	0,00
9,250 % fällig am 15.04.2023 ^	200	1	0,00
Summe China		2	0,00
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
EP Infrastructure A/S			
1,698 % fällig am 30.07.2026	€ 200	199	0,16
1,816 % fällig am 02.03.2031	400	346	0,29
2,045 % fällig am 09.10.2028	200	188	0,16
Summe Tschechische Republik		733	0,61
<b>FRANKREICH</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Altice France S.A.			
5,125 % fällig am 15.07.2029	\$ 365	240	0,20
BNP Paribas S.A.			
7,750 % fällig am 16.08.2029 (d)(f)	200	202	0,17
CAB SELAS			
3,375 % fällig am 01.02.2028	€ 375	360	0,30
Cerba Healthcare SACA			
3,500 % fällig am 31.05.2028	100	89	0,07
Ubisoft Entertainment S.A.			
0,878 % fällig am 24.11.2027	300	278	0,23
Summe Frankreich		1.169	0,97
<b>IRLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AerCap Ireland Capital DAC			
3,300 % fällig am 30.01.2032	\$ 1.200	1.031	0,86
<b>ITALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA			
6,750 % fällig am 05.09.2027	€ 500	558	0,46
Intesa Sanpaolo SpA			
4,950 % fällig am 01.06.2042	\$ 200	149	0,13
6,625 % fällig am 20.06.2033	500	516	0,43
7,200 % fällig am 28.11.2033	600	642	0,53
Nexi SpA			
2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 525	510	0,42
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA			
3,500 % fällig am 09.10.2025	200	213	0,18
Summe Italien		2.588	2,15
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Aston Martin Capital Holdings Ltd.			
10,000 % fällig am 31.03.2029	\$ 100	99	0,08
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			
3,250 % fällig am 12.11.2025	€ 300	306	0,26
Summe Jersey, Kanalinseln		405	0,34

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>LIBERIA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Royal Caribbean Cruises Ltd.			
4,250 % fällig am 01.07.2026	\$ 500	\$ 484	0,40
5,500 % fällig am 01.04.2028	500	494	0,41
Summe Liberia		978	0,81
<b>AKTIEN</b>			
<b>LUXEMBURG</b>			
<b>STAMMAKTIEN</b>			
Intelsat Emergence S.A. (g)	7.496	279	0,23
<b>PARI (000S)</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)			
3,000 % fällig am 31.12.2026 (a)	\$ 515	424	0,35
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
6,500 % fällig am 15.03.2030	562	524	0,44
Summe Luxemburg		948	0,79
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
Motion Finco SARL			
8,835 % fällig am 12.11.2029	200	200	0,16
Summe Luxemburg		1.427	1,18
<b>MEXIKO</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Petroleos Mexicanos			
10,000 % fällig am 07.02.2033	100	100	0,08
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Mexico Government International Bond			
2,750 % fällig am 27.11.2031 (c)	MXN 6.421	296	0,25
3,000 % fällig am 03.12.2026 (c)	406	20	0,02
4,000 % fällig am 30.11.2028 (c)	813	42	0,03
4,000 % fällig am 24.08.2034 (c)	732	36	0,03
Summe Mexiko		394	0,33
Summe Mexiko		494	0,41
<b>MULTINATIONAL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Delta Air Lines, Inc.			
4,750 % fällig am 20.10.2028	\$ 400	390	0,32
<b>NIEDERLANDE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Akelius Residential Property Financing BV			
1,125 % fällig am 11.01.2029	€ 300	278	0,23
Citycon Treasury BV			
1,250 % fällig am 08.09.2026	100	98	0,08
1,625 % fällig am 12.03.2028	100	92	0,08
NE Property BV			
2,000 % fällig am 20.01.2030	300	280	0,23
Prosus NV			
3,832 % fällig am 08.02.2051	\$ 300	195	0,16
Sagax Euro MTN NL BV			
1,000 % fällig am 17.05.2029	€ 300	278	0,23
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV			
3,150 % fällig am 01.10.2026	\$ 600	564	0,47
Wintershall Dea Finance BV			
2,499 % fällig am 20.04.2026 (d)	€ 100	100	0,08
ZF Europe Finance BV			
3,000 % fällig am 23.10.2029	300	298	0,25
Summe Niederlande		2.183	1,81
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
Pegasus BidCo BV			
9,072 % fällig am 12.07.2029	\$ 199	201	0,17
Summe Niederlande		2.384	1,98

## Aufstellung der Wertpaperanlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>NORWEGEN</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				First Franklin Mortgage Loan Trust 6,885 % fällig am 25.10.2034 \$ 249 \$ 247 0,21				Becton Dickinson & Co. 3,828 % fällig am 07.06.2032 € 100 \$ 108 0,09			
Var Energi ASA 8,000 % fällig am 15.11.2032 \$ 500 \$ 561 0,47				GSAMP Trust 5,550 % fällig am 25.01.2037 350 207 0,17 5,580 % fällig am 25.12.2036 507 239 0,20 5,920 % fällig am 25.12.2046 620 301 0,25				BGC Group, Inc. 8,000 % fällig am 25.05.2028 \$ 50 53 0,04 Blackstone Holdings Finance Co. LLC 1,600 % fällig am 30.03.2031 350 276 0,23 Block, Inc. 3,500 % fällig am 01.06.2031 600 518 0,43 Blue Owl Finance LLC 3,125 % fällig am 10.06.2031 600 500 0,42			
<b>PANAMA</b>				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 4,692 % fällig am 25.11.2037 66 23 0,02				Boeing Co. 3,950 % fällig am 01.08.2059 600 383 0,32 5,705 % fällig am 01.05.2040 600 553 0,46 5,805 % fällig am 01.05.2050 100 90 0,07 6,298 % fällig am 01.05.2029 1.700 1.724 1,43			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,590 % fällig am 25.01.2037 329 150 0,13 5,600 % fällig am 25.10.2036 259 113 0,09 5,760 % fällig am 25.09.2036 1.720 588 0,49 5,920 % fällig am 25.09.2036 57 24 0,02				Boost Newco Borrower LLC 7,500 % fällig am 15.01.2031 200 209 0,17 Booz Allen Hamilton, Inc. 3,875 % fällig am 01.09.2028 300 283 0,23 Boston Scientific Corp. 2,650 % fällig am 01.06.2030 1.100 966 0,80 4,700 % fällig am 01.03.2049 200 178 0,15			
Carnival Corp. 4,000 % fällig am 01.08.2028 1.300 1.222 1,01				Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 5,560 % fällig am 25.04.2037 58 30 0,03				Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % fällig am 15.11.2027 250 227 0,19 British Airways Pass-Through Trust 3,300 % fällig am 15.06.2034 81 73 0,06			
<b>PERU</b>				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 6,465 % fällig am 25.09.2046 606 197 0,16				Cantor Fitzgerald LP 7,200 % fällig am 12.12.2028 100 103 0,09 Centene Corp. 2,450 % fällig am 15.07.2028 625 555 0,46			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				New Century Home Equity Loan Trust 8,460 % fällig am 25.01.2033 50 41 0,03				Charles Schwab Corp. 6,196 % fällig am 17.11.2029 100 104 0,09 Charter Communications Operating LLC 3,950 % fällig am 30.06.2062 375 222 0,18 6,100 % fällig am 01.06.2029 100 100 0,08			
Peru Government International Bond 6,950 % fällig am 12.08.2031 PEN 300 80 0,07				NovaStar Mortgage Funding Trust 5,760 % fällig am 25.06.2036 496 354 0,29 5,760 % fällig am 25.09.2036 811 334 0,28				Cheniery Energy Partners LP 3,250 % fällig am 31.01.2032 (h) 600 512 0,42 4,500 % fällig am 01.10.2029 700 667 0,55 5,750 % fällig am 15.08.2034 300 301 0,25			
<b>SPANIEN</b>				Option One Mortgage Loan Trust 5,710 % fällig am 25.03.2037 472 232 0,19				Chesapeake Energy Corp. 5,500 % fällig am 01.02.2026 100 99 0,08 Choice Hotels International, Inc. 3,700 % fällig am 01.12.2029 700 629 0,52 3,700 % fällig am 15.01.2031 150 132 0,11			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Residential Asset Mortgage Products Trust 5,920 % fällig am 25.12.2035 1.061 845 0,70				Clearway Energy Operating LLC 4,750 % fällig am 15.03.2028 275 263 0,22 Constellation Brands, Inc. 2,250 % fällig am 01.08.2031 600 493 0,41			
Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % fällig am 08.06.2028 € 400 394 0,33				Residential Asset Securities Corp. Trust 6,340 % fällig am 25.08.2034 292 0,24				Constellation Energy Generation LLC 6,125 % fällig am 15.01.2034 600 626 0,52			
<b>SCHWEIZ</b>				Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 6,420 % fällig am 25.01.2036 97 89 0,07				Continental Resources, Inc. 5,750 % fällig am 15.01.2031 200 197 0,16 Crowdstrike Holdings, Inc. 3,000 % fällig am 15.02.2029 650 587 0,49			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Soundview Home Loan Trust 5,640 % fällig am 25.07.2037 221 195 0,16				Crown Castle, Inc. 5,600 % fällig am 01.06.2029 800 807 0,67 Directv Financing LLC 5,875 % fällig am 15.08.2027 300 282 0,23 8,875 % fällig am 01.02.2030 200 196 0,16			
UBS Group AG 4,988 % fällig am 05.08.2033 \$ 500 477 0,39 6,442 % fällig am 11.08.2028 400 410 0,34 6,537 % fällig am 12.08.2033 250 263 0,22				Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 5,760 % fällig am 25.09.2037 327 219 0,18				Energry Corp. 3,750 % fällig am 15.06.2050 100 71 0,06 EPR Properties 3,600 % fällig am 15.11.2031 300 250 0,21 4,500 % fällig am 01.06.2027 50 48 0,04 4,950 % fällig am 15.04.2028 100 96 0,08			
Summe Schweiz 1.150 0,95				6.414 5,32				Eversource Energy 5,950 % fällig am 15.07.2034 600 606 0,50 Exelon Corp. 5,450 % fällig am 15.03.2034 600 596 0,49			
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>AKTIEN</b>				FirstEnergy Corp. 2,250 % fällig am 01.09.2030 600 503 0,42			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ENERGIE</b>							
Barclays PLC 5,746 % fällig am 09.08.2033 500 499 0,42				Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (b)(g) 580.149 63 0,05							
Berkeley Group PLC 2,500 % fällig am 11.08.2031 £ 300 296 0,25											
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029 \$ 500 270 0,23				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030 £ 200 214 0,18				Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029 \$ 290 285 0,24							
HSBC Holdings PLC 4,600 % fällig am 17.12.2030 (d)(f) \$ 300 258 0,21				Allstate Corp. 8,522 % fällig am 15.08.2053 100 100 0,08							
John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034 £ 300 292 0,24				Ally Financial, Inc. 4,750 % fällig am 09.06.2027 600 585 0,49							
Lloyds Banking Group PLC 5,679 % fällig am 05.01.2035 \$ 1.200 1.196 0,99				American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % fällig am 01.11.2028 330 312 0,26							
Royalty Pharma PLC 1,750 % fällig am 02.09.2027 600 539 0,45				American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 4,000 % fällig am 15.01.2028 500 467 0,39							
Santander UK Group Holdings PLC 3,823 % fällig am 03.11.2028 300 284 0,24				American Homes 4 Rent LP 3,375 % fällig am 15.07.2051 600 391 0,32							
Smith & Nephew PLC 5,400 % fällig am 20.03.2034 600 591 0,49				American Tower Corp. 2,700 % fällig am 15.04.2031 300 254 0,21 2,950 % fällig am 15.01.2051 1.125 704 0,58 5,800 % fällig am 15.11.2028 100 102 0,08							
Thames Water Utilities Finance PLC 1,250 % fällig am 31.01.2032 € 300 232 0,19 7,125 % fällig am 30.04.2031 £ 100 112 0,09				Ares Capital Corp. 5,950 % fällig am 15.07.2029 200 197 0,16 7,000 % fällig am 15.01.2027 100 102 0,08							
Virgin Media Secured Finance PLC 4,125 % fällig am 15.08.2030 300 316 0,26 4,500 % fällig am 15.08.2030 \$ 200 170 0,14				Ashtead Capital, Inc. 4,375 % fällig am 15.08.2027 800 771 0,64							
Summe Großbritannien 5.269 4,38				Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc. 6,125 % fällig am 15.09.2028 100 103 0,09							
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				Athene Global Funding 5,583 % fällig am 09.01.2029 100 100 0,08							
Fleet Midco Ltd. 8,571 % fällig am 21.02.2031 300 302 0,25				Aviation Capital Group LLC 1,950 % fällig am 20.09.2026 200 184 0,15 3,500 % fällig am 01.11.2027 600 562 0,47							
Summe Großbritannien 5.571 4,63				Bank of America Corp. 5,819 % fällig am 15.09.2029 600 613 0,51							
<b>USA</b>											
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>											
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 6,285 % fällig am 25.12.2045 260 195 0,16											
Argent Securities Trust 5,610 % fällig am 25.09.2036 744 226 0,19											
5,820 % fällig am 25.04.2036 261 82 0,07											
6,020 % fällig am 25.04.2036 638 200 0,17											
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,780 % fällig am 25.12.2036 1.527 822 0,68											

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Ford Motor Credit Co. LLC 5,850 % fällig am 17.05.2027	\$ 200	\$ 200	0,17	3,950 % fällig am 01.12.2047 4,550 % fällig am 01.07.2030	\$ 425	\$ 305	0,25 0,08	Caesars Entertainment, Inc. 8,097 % fällig am 06.02.2031	\$ 200	\$ 200	0,17
Freedom Mortgage Holdings LLC 9,250 % fällig am 01.02.2029	100	100	0,08	PennyMac Financial Services, Inc. 7,875 % fällig am 15.12.2029	200	206	0,17	Cedar Fair LP 7,329 % fällig am 01.05.2031	500	500	0,41
Glencore Funding LLC 5,400 % fällig am 08.05.2028	500	500	0,42	Piedmont Operating Partnership LP 9,250 % fällig am 20.07.2028	500	534	0,44	Cloud Software Group, Inc. 9,345 % fällig am 30.03.2029	499	499	0,41
Global Atlantic Fin Co. 3,125 % fällig am 15.06.2031	300	248	0,21	PRA Health Sciences, Inc. 2,875 % fällig am 15.07.2026	300	285	0,24	CNT Holdings Corp. 8,830 % fällig am 08.11.2027	249	250	0,21
Global Payments, Inc. 5,400 % fällig am 15.08.2032 5,950 % fällig am 15.08.2052 (h)	300 400	294 386	0,24 0,32	Qorvo, Inc. 3,375 % fällig am 01.04.2031	600	515	0,43	Concentra, Inc. TBD % fällig am 26.06.2031	100	100	0,08
GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2030 4,000 % fällig am 15.01.2031 6,750 % fällig am 01.12.2033	600 100 100	550 90 105	0,46 0,07 0,09	Rexford Industrial Realty LP 2,125 % fällig am 01.12.2030	200	164	0,14	Cotiviti Corp. 8,579 % fällig am 01.05.2031	299	299	0,25
HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026 8,000 % fällig am 15.06.2027	400 300	378 312	0,31 0,26	RGF Global Funding 6,000 % fällig am 21.11.2028	100	103	0,09	Crown Subsea Communications Holding, Inc. 10,080 % fällig am 30.01.2031	175	176	0,15
HCA, Inc. 3,500 % fällig am 01.09.2030 (h)	850	767	0,64	Rocket Mortgage LLC 2,875 % fällig am 15.10.2026	550	514	0,43	Fiesta Purchaser, Inc. 9,344 % fällig am 12.02.2031	200	202	0,17
Highwoods Realty LP 4,200 % fällig am 15.04.2029	400	367	0,30	SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	200	178	0,15	Genesee & Wyoming, Inc. 7,335 % fällig am 10.04.2031	100	100	0,08
Host Hotels & Resorts LP 2,900 % fällig am 15.12.2031 3,375 % fällig am 15.12.2029 3,500 % fällig am 15.09.2030 (h)	500 100 925	418 89 818	0,35 0,07 0,68	Sealed Air Corp. 1,573 % fällig am 15.10.2026	450	410	0,34	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 7,089 % - 7,095 % fällig am 08.11.2030	400	401	0,33
Howard Midstream Energy Partners LLC 8,875 % fällig am 15.07.2028	300	318	0,26	Silgan Holdings, Inc. 1,400 % fällig am 01.04.2026	300	278	0,23	LifePoint Health, Inc. 10,056 % fällig am 16.11.2028	499	502	0,42
Hudson Pacific Properties LP 3,950 % fällig am 01.11.2027 5,950 % fällig am 15.02.2028	300 100	251 85	0,21 0,07	SLM Corp. 3,125 % fällig am 02.11.2026	725	676	0,56	Mauser Packaging Solutions Holding Co. 8,829 % fällig am 15.04.2027	298	299	0,25
IHG Finance LLC 4,375 % fällig am 28.11.2029	€ 100	110	0,09	Stryker Corp. 1,000 % fällig am 03.12.2031	€ 400	358	0,30	Olympus Water U.S. Holding Corp. 9,595 % fällig am 09.11.2028	460	463	0,38
Invitation Homes Operating Partnership LP 5,450 % fällig am 15.08.2030 5,500 % fällig am 15.08.2033	\$ 50 725	50 715	0,04 0,59	Sysco Corp. 5,750 % fällig am 17.01.2029 6,000 % fällig am 17.01.2034	\$ 200 300	205 315	0,17 0,26	Station Casinos LLC 7,594 % fällig am 14.03.2031	499	499	0,41
JPMorgan Chase & Co. 3,540 % fällig am 01.05.2028 5,000 % fällig am 01.08.2024 (d)	1.900 100	1.814 100	1,51 0,08	Tallgrass Energy Partners LP 6,000 % fällig am 31.12.2030 7,375 % fällig am 15.02.2029	100 100	93 101	0,08 0,08	TransUnion LLC TBD % fällig am 16.11.2026 TBD % fällig am 24.06.2031	321 304	321 304	0,27 0,25
Kilroy Realty LP 3,050 % fällig am 15.02.2030	400	338	0,28	Time Warner Cable Enterprises LLC 8,375 % fällig am 15.07.2033	100	111	0,09	Triton Water Holdings, Inc. 8,595 % fällig am 31.03.2028 9,345 % fällig am 31.03.2028	299 100	300 100	0,25 0,08
Las Vegas Sands Corp. 5,900 % fällig am 01.06.2027	200	201	0,17	Travel + Leisure Co. 6,625 % fällig am 31.07.2026	75	76	0,06	UKG, Inc. 8,576 % fällig am 10.02.2031	300	301	0,25
Leidos, Inc. 2,300 % fällig am 15.02.2031	1.200	989	0,82	UKG, Inc. 6,875 % fällig am 01.02.2031	200	203	0,17	United Airlines, Inc. 8,094 % fällig am 22.02.2031	299	300	0,25
Live Nation Entertainment, Inc. 3,750 % fällig am 15.01.2028 6,500 % fällig am 15.05.2027	800 200	745 201	0,62 0,17	United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029	55	55	0,05	Wrench Group LLC 9,596 % fällig am 30.10.2028	0	0	0,00
Marvell Technology, Inc. 5,750 % fällig am 15.02.2029	20	20	0,02	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 15.08.2029 3,875 % fällig am 01.11.2033 4,125 % fällig am 15.08.2031	1.675 300 300	1.527 256 269	1,27 0,21 0,22	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Mattel, Inc. 3,375 % fällig am 01.04.2026	900	866	0,72	VICR Properties LP 3,875 % fällig am 15.02.2029 4,500 % fällig am 15.01.2028	700 125	648 120	0,54 0,10	Banc of America Funding Trust 6,000 % fällig am 25.07.2037	172	135	0,11
Moody's Corp. 3,100 % fällig am 29.11.2061	475	292	0,24	Vistra Operations Co. LLC 3,550 % fällig am 15.07.2024 3,700 % fällig am 30.01.2027 6,950 % fällig am 15.10.2033	300 500 625	300 478 669	0,25 0,40 0,56	BCAP LLC Trust 5,900 % fällig am 25.05.2047	144	140	0,12
Morgan Stanley 4,889 % fällig am 20.07.2033	1.300	1.254	1,04	Vornado Realty LP 2,150 % fällig am 01.06.2026	275	254	0,21	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 4,912 % fällig am 25.07.2036	42	35	0,03
MSCI, Inc. 3,625 % fällig am 01.11.2031 4,000 % fällig am 15.11.2029	1.100 100	966 94	0,80 0,08	Wells Fargo & Co. 3,526 % fällig am 24.03.2028 4,897 % fällig am 25.07.2033	100 1.100	95 1.058	0,08 0,88	Countrywide Alternative Loan Trust 4,786 % fällig am 25.07.2035 5,500 % fällig am 25.12.2035 5,643 % fällig am 20.09.2046 5,840 % fällig am 25.09.2046 6,000 % fällig am 25.10.2035 6,000 % fällig am 25.08.2037 6,500 % fällig am 25.08.2037 6,553 % fällig am 25.08.2035 6,561 % fällig am 25.09.2037	130 268 5 4 11 107 1.888 10 283	112 142 5 4 8 77 758 9 216	0,09 0,12 0,00 0,00 0,01 0,06 0,63 0,01 0,18
Mutual of Omaha Cos. Global Funding 5,800 % fällig am 27.07.2026	50	50	0,04	Weyerhaeuser Co. 4,000 % fällig am 15.04.2030 4,000 % fällig am 09.03.2052 7,375 % fällig am 15.03.2032	500 1.125 99	467 850 111	0,39 0,71 0,09	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,860 % fällig am 25.09.2037 5,750 % fällig am 25.07.2037	35 7	31 4	0,03 0,00
Newfold Digital Holdings Group, Inc. 11,750 % fällig am 15.10.2028	100	104	0,09	Wynn Resorts Finance LLC 7,125 % fällig am 15.02.2031	500	519	0,43	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 6,000 % fällig am 25.09.2035	229	63	0,05
Newmark Group, Inc. 7,500 % fällig am 12.01.2029	400	412	0,34	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 3,888 % fällig am 29.12.2037	629	327	0,27
NextEra Energy Operating Partners LP 7,250 % fällig am 15.01.2029	100	103	0,09	AI Aqua Merger Sub, Inc. 4,250 % - 9,595 % fällig am 31.07.2028	500	501	0,42	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust 6,000 % fällig am 25.07.2036 6,500 % fällig am 25.10.2021	140 160	65 26	0,05 0,02
Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,450 % fällig am 15.09.2028	500	434	0,36	Applied Systems, Inc. 8,835 % fällig am 24.02.2031	250	252	0,21	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust 4,182 % fällig am 25.08.2035 5,600 % fällig am 25.07.2047 5,610 % fällig am 25.02.2047 5,840 % fällig am 25.10.2036	11 12 2.981 163	9 11 1.661 46	0,01 0,01 1,38 0,04
Olympus Water U.S. Holding Corp. 4,250 % fällig am 01.10.2028 7,250 % fällig am 15.06.2031	200 200	182 199	0,15 0,17	Asplundh Tree Expert LLC 7,096 % fällig am 23.05.2031	200	200	0,17	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 4,783 % fällig am 25.08.2035	4	4	0,00
OneMain Finance Corp. 7,875 % fällig am 15.03.2030	300	310	0,26	BCPE Empire Holdings, Inc. 9,344 % fällig am 11.12.2028	597	598	0,50				
Pacific Gas & Electric Co. 2,500 % fällig am 01.02.2031	200	165	0,14	Broadcom, Inc. TBD % fällig am 15.08.2025 TBD % fällig am 14.08.2026	100 100	99 100	0,08 0,08				

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>			
3,768 % fällig am 25.12.2034	\$ 225	\$ 191	0,16	Freddie Mac	\$ 626	\$ 386	0,32	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,158 % fällig am 25.05.2037	55	43	0,04	5,992 % fällig am 25.11.2055				Studio City Finance Ltd.	\$ 75	\$ 66	0,06
5,960 % fällig am 25.02.2037	21	13	0,01	Uniform Mortgage-Backed Security				5,000 % fällig am 15.01.2029			
<b>JPMorgan Mortgage Trust</b>				3,000 % fällig am 01.05.2052	92	79	0,07	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>	<b>\$ 135.260</b>	<b>112,30</b>	
6,500 % fällig am 25.07.2036	234	82	0,07	4,000 % fällig am 01.08.2052	385	352	0,29				
<b>Lehman XS Trust</b>				4,500 % fällig am 01.09.2052	964	910	0,75	<b>AKTIEN</b>			
5,820 % fällig am 25.07.2037	251	228	0,19	5,000 % fällig am 01.09.2053	962	935	0,78	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
6,360 % fällig am 25.08.2047	164	135	0,11	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>				4,500 % fällig am 01.08.2054	1.700	1.603	1,33	PIMCO Select Funds plc -			
3,370 % fällig am 25.11.2037	189	128	0,11	5,000 % fällig am 01.07.2054	200	193	0,16	PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	307.088	3.061	2,54
<b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>				5,500 % fällig am 01.08.2054	3.600	3.550	2,95	PIMCO Specialty Funds			
5,345 % fällig am 25.12.2035	15	12	0,01	6,000 % fällig am 01.08.2054	5.200	5.213	4,33	Ireland p.l.c. - PIMCO			
5,500 % fällig am 25.08.2035	18	14	0,01	6,500 % fällig am 01.08.2054	8.100	8.240	6,84	China Bond Fund (e)	9.239	127	0,11
5,744 % fällig am 25.07.2035	2	2	0,00								
6,210 % fällig am 25.11.2036	474	337	0,28								
<b>Residential Asset Securitization Trust</b>				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>							
5,750 % fällig am 25.03.2037	227	66	0,06	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)							
6,000 % fällig am 25.02.2036	323	128	0,11	0,125 % fällig am 15.04.2025	121	118	0,10				
6,250 % fällig am 25.11.2036	481	173	0,14	0,250 % fällig am 15.01.2025	132	130	0,11				
<b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>				2,125 % fällig am 15.04.2029	9.923	9.937	8,25				
5,940 % fällig am 25.05.2037	70	59	0,05								
<b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>											
5,500 % fällig am 25.05.2035	1.123	904	0,75	Summe USA	104.641	86,88		<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
		6.403	5,32					PIMCO ETFs plc - PIMCO			
								US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	4.000	400	0,33
								<b>Summe Investmentfonds</b>	<b>\$ 3.588</b>	<b>2,98</b>	

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
SSB	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 103	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	\$ (105)	\$ 103	\$ 103	0,09
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (105)</b>	<b>\$ 103</b>	<b>\$ 103</b>	<b>0,09</b>

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	3	\$ (6)	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	1	0	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	89	14	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	4	0	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	70	(60)	(0,05)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	94	(35)	(0,03)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	13	0	0,00
				<b>\$ (87)</b>	<b>(0,07)</b>
<b>Summe der an einem gereglten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (87)</b>	<b>(0,07)</b>

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
ConocoPhillips	(1,000) %	20.12.2024	\$ 100	\$ (1)	0,00
Johnson Controls International PLC	(1,000)	20.12.2024	1.500	48	0,04
				<b>\$ 47</b>	<b>0,04</b>

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2027	\$ 100	\$ 3	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	100	2	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	100	(1)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 100	21	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	200	20	0,02
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	\$ 300	(1)	0,00
Toll Brothers Finance Corp.	1,000	20.06.2026	200	4	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2024	100	0	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	100	2	0,00
				\$ 50	0,04

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000 %	20.06.2029	\$ 28.900	\$ (67)	(0,06)

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	18.09.2054	£ 100	\$ 6	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	400	(1)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.09.2027	¥ 46.300	5	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,060	27.10.2053	\$ 1.500	441	0,37
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	2.800	56	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	05.06.2034	1.500	16	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,815	04.01.2027	BRL 2.300	(16)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,832	04.01.2027	2.100	(15)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,835	04.01.2027	3.700	(26)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Year BRL-CDI	9,842	04.01.2027	500	(3)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	AUD 1.000	8	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	100	3	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 440	200	0,17
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	800	29	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	800	(6)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	100	(3)	0,00
					\$ 694	0,58
					\$ 724	0,60

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**OPTIONSKAUF****ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,725 %	14.11.2024	1.800	\$ 0	\$ 1	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,749	13.11.2024	2.700	0	1	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,754	15.11.2024	900	0	0	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,765	18.11.2024	900	0	1	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	20.11.2024	900	0	1	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	17.12.2024	900	0	1	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,820	21.11.2024	900	0	1	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,840	05.12.2024	1.800	0	1	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,850	22.11.2024	900	0	1	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900 %	09.12.2024	1.800	\$ 0	\$ 2	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	13.12.2024	1.800	0	2	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,920	25.11.2024	1.800	0	2	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,920	03.12.2024	900	0	1	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	29.11.2024	2.700	0	3	0,01
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	11.12.2024	1.800	0	2	0,01
							\$ 0	\$ 20	0,02

### VERKAUFSOPTIENEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	100	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	100	(1)	0	0,00
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700	04.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,700	05.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	100	0	0	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	100	0	(1)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,586	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,885	10.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,986	15.07.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,235	10.07.2024	100	0	0	0,00
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689	15.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,300	14.11.2024	200	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	13.11.2024	300	0	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	15.11.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.11.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,350	20.11.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,353	17.12.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,357	21.11.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,360	22.11.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,363	05.12.2024	200	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,395	09.12.2024	200	0	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,400	25.11.2024	200	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,425	13.12.2024	200	0	(2)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	03.12.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,465	29.11.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,468	29.11.2024	200	0	(2)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,468	11.12.2024	200	0	(2)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	18.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	18.07.2024	100	0	0	0,00
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,850	05.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	05.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,610	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,640	23.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,990	23.07.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,800	03.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,150	03.07.2024	100	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	100	(1)	0	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	17.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	22.07.2024	100	0	0	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
ULO	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740 %	15.07.2024	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	22.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,970	17.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	100	0	0	0,00
							\$ (22)	\$ (32)	(0,03)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
JPM	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	\$ 97,266	08.07.2024	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	95,594	06.08.2024	100	0	(1)	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	98,594	06.08.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,969	08.07.2024	100	(1)	0	0,00
					\$ (1)	\$ (1)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BRC	Pertamina Persero PT	1,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	1,144 %	\$ 4.800	20.09.2024	\$ 60	\$ (131)	\$ (71)	(0,06)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	07.2024	\$ 69	€ 64	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2024	CAD 1.250	\$ 916	2	0	2	0,00
	07.2024	£ 1.216	1.553	16	0	16	0,01
	07.2024	IDR 4.439.793	271	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 14	AUD 21	0	0	0	0,00
	07.2024	632	€ 587	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	AUD 21	\$ 14	0	0	0	0,00
BRC	10.2024	CNH 2.258	314	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 173	TRY 6.003	8	0	8	0,01
	08.2024	124	4.323	1	0	1	0,00
	09.2024	MXN 1.651	\$ 88	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2024	\$ 12	TRY 418	0	0	0	0,00
	09.2024	PEN 182	\$ 48	1	0	1	0,00
	09.2024	\$ 161	INR 13.466	0	0	0	0,00
	07.2024	AUD 21	\$ 14	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	€ 7.874	8.576	137	0	137	0,11
	07.2024	\$ 461	€ 426	0	(5)	(5)	0,00
	08.2024	191	BRL 979	0	(15)	(15)	(0,01)
	07.2024	277	IDR 4.491.911	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	95	TRY 3.229	3	0	3	0,00
	08.2024	234	8.161	3	0	3	0,00
MBC	09.2024	22	INR 1.837	0	0	0	0,00
	07.2024	914	CAD 1.251	1	0	1	0,00
	07.2024	76	€ 70	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	1.538	£ 1.216	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	CAD 1.250	\$ 914	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	£ 1.216	1.539	1	0	1	0,00
MYI	09.2024	\$ 15	INR 1.226	0	0	0	0,00
	09.2024	117	MXN 2.190	2	0	2	0,00
RYL	07.2024	205	€ 192	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	7.001	6.535	2	0	2	0,00
	07.2024	0	MXN 2	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	08.2024	€ 6.535	\$ 7.012	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	09.2024	\$ 99	INR 8.323	0	0	0	0,00
				\$ 179	\$ (31)	\$ 148	0,12

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 3.577	CHF 3.217	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
CBK	07.2024	354	322	4	0	4	0,00
JPM	07.2024	CHF 3.754	\$ 4.183	6	0	6	0,01
	08.2024	\$ 4.183	CHF 3.740	0	(6)	(6)	0,00
MBC	07.2024	90	80	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2024	CHF 5	\$ 5	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	\$ 4.136	CHF 3.736	22	0	22	0,02
UAG	07.2024	CHF 3.748	\$ 4.178	6	0	6	0,01
	07.2024	\$ 4.089	CHF 3.695	23	0	23	0,02
	08.2024	4.178	3.735	0	(6)	(6)	(0,01)
				\$ 65	\$ (13)	\$ 52	0,05

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 2	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 16.157	€ 14.881	0	(208)	(208)	(0,17)
BPS	07.2024	€ 10.289	\$ 11.005	0	(22)	(22)	(0,02)
	07.2024	\$ 14.289	€ 13.198	0	(143)	(143)	(0,12)
	08.2024	11.021	10.289	22	0	22	0,02
CBK	07.2024	€ 24	\$ 25	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	5.802	6.208	0	(10)	(10)	(0,01)
FAR	07.2024	\$ 15.672	€ 14.389	0	(251)	(251)	(0,21)
GLM	07.2024	69	63	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2024	213	199	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	€ 12.283	\$ 13.134	0	(30)	(30)	(0,03)
	08.2024	\$ 13.140	€ 12.270	31	0	31	0,03
RBC	07.2024	€ 26	\$ 28	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	14.256	15.274	0	(5)	(5)	0,00
	08.2024	\$ 15.292	€ 14.252	5	0	5	0,00
SSB	07.2024	€ 51	\$ 54	0	0	0	0,00
				\$ 58	\$ (670)	\$ (612)	(0,51)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (496) (0,41)

Summe Anlagen

\$ 139.092 115,49

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (18.651) (15,49)

Nettovermögen

\$ 120.441 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,47 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 63	\$ 63	0,05
Intelsat Emergence S.A.	12.11.2019	750	279	0,23
		\$ 813	\$ 342	0,28

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 2.978 USD (31. Dezember 2023: 2.971 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.470 USD (31. Dezember 2023: 1.360 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2023: 270 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfa- ktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 132.540	\$ 2.720	\$ 135.260
Investmentfonds	3.588	0	0	3.588
Pensionsgeschäfte	0	103	0	103
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(6)	147	0	141
<b>Summen</b>	<b>\$ 3.582</b>	<b>\$ 132.790</b>	<b>\$ 2.720</b>	<b>\$ 139.092</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfa- ktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 118.444	\$ 1.861	\$ 120.305
Investmentfonds	3.208	399	0	3.607
Pensionsgeschäfte	0	737	0	737
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(24)	176	0	152
<b>Summen</b>	<b>\$ 3.184</b>	<b>\$ 119.756</b>	<b>\$ 1.861</b>	<b>\$ 124.801</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,250 %	14.06.2024	11.07.2024	\$ (787)	\$ (789)	(0,65)
		14.06.2024	11.07.2024	(1.114)	(1.117)	(0,93)
		14.06.2024	11.07.2024	(375)	(375)	(0,31)
		14.06.2024	11.07.2024	(493)	(494)	(0,41)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (2.775)</b>	<b>(2,30)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (204)	\$ 0	\$ (204)	\$ (2)	\$ 0	\$ (2)
BPS	(197)	0	(197)	(349)	270	(79)
BRC	8	0	8	5	0	5
CBK	4	0	4	(23)	0	(23)
DUB	(10)	0	(10)	(49)	0	(49)
FAR	(115)	0	(115)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(28)	0	(28)	196	0	196
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
JPM	1	0	1	(5)	0	(5)
MBC	(1)	0	(1)	26	0	26
MYC	(1)	0	(1)	(3)	0	(3)
MYI	2	0	2	207	(260)	(53)
TOR	22	0	22	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
UAG	23	0	23	207	(260)	(53)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	47,33	52,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	64,14	66,59
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,83	1,10
Investmentfonds	2,98	3,60
Pensionsgeschäfte	0,09	0,74
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,07)	(0,72)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,60	0,66
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,41)	0,21
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,30)	(2,94)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Argentinien	0,27	0,28
Australien	1,49	0,96
Bermuda	1,02	0,67
Kanada	2,22	0,58
Kaimaninseln	3,27	4,87
China	0,00	0,00
Tschechische Republik	0,61	0,53
Frankreich	0,97	1,40
Irland	0,86	1,13
Italien	2,15	2,41
Jersey, Kanalinseln	0,34	k. A.
Liberia	0,81	0,48
Luxemburg	1,18	1,13
Mexiko	0,41	0,50
Multinational	0,32	0,39
Niederlande	1,98	0,93
Norwegen	0,47	k. A.
Panama	1,01	1,02
Peru	0,07	k. A.
Südafrika	k. A.	1,53
Spanien	0,33	0,41
Schweiz	0,95	1,61
Großbritannien	4,63	4,11
USA	86,88	95,23
Jungferninseln (Britisch)	0,06	0,06
Investmentfonds	2,98	3,60
Pensionsgeschäfte	0,09	0,74
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,07)	(0,72)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,04	0,11
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,05
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,06)	k. A.
Zinsswaps	0,58	0,52
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,02	0,00
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,03)	(0,02)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Total Return Swaps auf Indizes	(0,06)	(0,37)
Devisenterminkontrakte	0,12	(0,08)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,46)	0,68
Sonstige Aktiva und Passiva	(15,49)	(24,72)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>ALBANIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Albania Government International Bond 3,500 % fällig am 16.06.2027	€ 3.330	\$ 3.462	0,04
<b>ANGOLA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Angola Government International Bond 8,000 % fällig am 26.11.2029	\$ 7.600	6.852	0,09
9,125 % fällig am 26.11.2049	9.900	8.143	0,10
Summe Angola		14.995	0,19
<b>ARGENTINIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Argentina Government International Bond 3,500 % fällig am 09.07.2041	133.299	52.520	0,68
3,625 % fällig am 09.07.2035	16.928	7.141	0,09
Summe Argentinien		59.661	0,77
<b>AUSTRALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
CIMIC Finance Ltd. 1,500 % fällig am 28.05.2029	€ 100	94	0,00
Pacific National Finance Pty. Ltd. 4,750 % fällig am 22.03.2028	\$ 1.000	954	0,01
Santos Finance Ltd. 3,649 % fällig am 29.04.2031	3.200	2.800	0,04
6,875 % fällig am 19.09.2033	2.200	2.329	0,03
Woodside Finance Ltd. 3,700 % fällig am 15.09.2026	700	674	0,01
4,500 % fällig am 04.03.2029	2.200	2.124	0,03
Summe Australien		8.975	0,12
<b>ASERBAIDSCHE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Southern Gas Corridor CJSC 6,875 % fällig am 24.03.2026	8.000	8.054	0,10
<b>BERMUDA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Aircastle Ltd. 2,850 % fällig am 26.01.2028	9.900	8.961	0,11
4,250 % fällig am 15.06.2026	1.600	1.559	0,02
5,250 % fällig am 11.08.2025	30.300	30.077	0,39
Alamo Re Ltd. 16,605 % fällig am 07.06.2026	1.500	1.483	0,02
Bacardi Ltd. 4,700 % fällig am 15.05.2028	22.840	22.216	0,29
NCL Corp. Ltd. 8,125 % fällig am 15.01.2029	4.300	4.509	0,06
Palm RE Ltd. 14,855 % fällig am 09.06.2031	1.500	1.483	0,02
Purple Re Ltd. 14,355 % fällig am 06.06.2031	1.500	1.493	0,02
Sabine Re Ltd. 13,605 % fällig am 07.04.2031	1.500	1.493	0,02
Seadrill Finance Ltd. 8,375 % fällig am 01.08.2030	7.400	7.741	0,10
Valaris Ltd. 8,375 % fällig am 30.04.2030	7.800	8.081	0,10
Summe Bermuda		89.096	1,15
<b>BRASILIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco do Brasil S.A. 8,500 % fällig am 29.07.2026	MXN 89.000	4.611	0,06
Vale Overseas Ltd. 6,400 % fällig am 28.06.2054	\$ 3.375	3.340	0,04
XP, Inc. 6,750 % fällig am 02.07.2029 (a)	4.000	3.975	0,05
		11.926	0,15

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Brazil Government International Bond 7,125 % fällig am 13.05.2054	\$ 21.700	\$ 21.011	0,27
Summe Brasilien		32.937	0,42
<b>KANADA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Air Canada Pass-Through Trust 3,300 % fällig am 15.07.2031	718	658	0,01
4,125 % fällig am 15.11.2026	998	978	0,01
5,250 % fällig am 01.10.2030	2.577	2.546	0,03
B.C. Unlimited Liability Co. 3,875 % fällig am 15.01.2028	7.900	7.406	0,09
4,000 % fällig am 15.10.2030	5.075	4.471	0,06
4,375 % fällig am 15.01.2028	9.070	8.562	0,11
Bausch & Lomb Corp. 8,375 % fällig am 01.10.2028	2.750	2.819	0,04
CI Financial Corp. 7,500 % fällig am 30.05.2029	6.500	6.442	0,08
Enbridge, Inc. 5,700 % fällig am 08.03.2033	2.000	2.016	0,03
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 21.750	22.269	0,29
4,850 % fällig am 17.04.2028	\$ 200	196	0,00
geosy Ltd. 9,250 % fällig am 01.12.2028	3.450	3.665	0,05
Northriver Midstream Finance LP 6,750 % fällig am 15.07.2032 (a)	1.000	1.002	0,01
Open Text Corp. 3,875 % fällig am 15.02.2028	3.000	2.780	0,04
Summe Kanada		65.810	0,85
<b>KAYMAN INSELN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 6,739 % fällig am 16.01.2030	451	451	0,01
Catamaran CLO Ltd. 6,686 % fällig am 22.04.2030	2.089	2.092	0,03
CIFC Funding Ltd. 6,635 % fällig am 24.04.2030	13.052	13.066	0,17
Trinitas CLO Ltd. 6,876 % fällig am 25.04.2037	10.120	10.135	0,13
Venture CLO Ltd. 6,574 % fällig am 07.09.2030	5.732	5.733	0,07
6,686 % fällig am 20.01.2029	1.724	1.727	0,02
Vibrant CLO Ltd. 6,626 % fällig am 15.09.2030	652	653	0,01
		33.857	0,44
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
Sunac China Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 30.09.2032	5.406	351	0,00
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Avolon Holdings Funding Ltd. 5,228 % fällig am 18.11.2027	10.810	9.728	0,13
2,875 % fällig am 15.02.2025	6.800	6.663	0,09
3,250 % fällig am 15.02.2027	4.900	4.587	0,06
4,250 % fällig am 15.04.2026	3.600	3.498	0,05
5,500 % fällig am 15.01.2026	10.500	10.421	0,14
Gaci First Investment Co. 4,875 % fällig am 14.02.2035	5.000	4.730	0,06
5,000 % fällig am 29.01.2029	5.000	4.938	0,06
5,125 % fällig am 14.02.2053	12.300	10.658	0,14
5,250 % fällig am 29.01.2034	5.000	4.928	0,06
5,375 % fällig am 29.01.2054	8.100	7.198	0,09
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	9.850	357	0,01
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	22.900	773	0,01
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^	21.600	783	0,01
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^	5.800	210	0,00
11,250 % fällig am 16.04.2025 ^	17.000	616	0,01
11,500 % fällig am 30.01.2023 ^	900	31	0,00
11,650 % fällig am 01.06.2026 ^	9.300	337	0,00
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	5.750	202	0,00
11,950 % fällig am 12.11.2023 ^	4.400	160	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Lima Metro Line Finance Ltd. 5,875 % fällig am 05.07.2034 (k)	\$ 2.532	\$ 2.496	0,03
Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	3.400	3.333	0,04
5,375 % fällig am 04.12.2029	8.900	7.992	0,10
5,750 % fällig am 21.07.2028	1.000	938	0,01
MGM China Holdings Ltd. 4,750 % fällig am 01.02.2027	400	381	0,01
Sands China Ltd. 2,850 % fällig am 08.03.2029	500	440	0,01
Seagate HDD Cayman 4,125 % fällig am 15.01.2031	5.318	4.755	0,06
9,625 % fällig am 01.12.2032	8.386	9.572	0,12
Spirit Loyalty Cayman Ltd. 8,000 % fällig am 20.09.2025	4.653	3.400	0,04
Suci Second Investment Co. 5,171 % fällig am 05.03.2031	6.000	5.939	0,08
6,000 % fällig am 25.10.2028	13.300	13.668	0,18
Trafford Centre Finance Ltd. 6,077 % fällig am 28.07.2038	£ 3.700	3.730	0,05
Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024	\$ 300	299	0,00
5,500 % fällig am 15.01.2026	3.900	3.821	0,05
5,625 % fällig am 26.08.2028	1.700	1.595	0,02
		133.177	1,72
Summe Cayman Inseln		167.385	2,16
<b>CHILE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A. 3,650 % fällig am 07.05.2030	3.800	3.481	0,05
GNL Quintero S.A. 4,634 % fällig am 31.07.2029	2.718	2.656	0,03
		6.137	0,08
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Chile Government International Bond 4,850 % fällig am 22.01.2029	33.000	32.656	0,42
Summe Chile		38.793	0,50
<b>CHINA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	28.200	154	0,00
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^	19.100	99	0,00
7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	19.800	101	0,00
Summe China		354	0,00
<b>KOLUMBIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Ecopetrol S.A. 5,875 % fällig am 28.05.2045	200	143	0,00
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Colombia Government International Bond 4,500 % fällig am 15.03.2029	12.100	11.068	0,14
5,000 % fällig am 15.06.2045	49.920	35.212	0,46
5,625 % fällig am 26.02.2044	3.100	2.384	0,03
8,000 % fällig am 14.11.2035	8.500	8.760	0,11
		57.424	0,74
Summe Kolumbien		57.567	0,74
<b>COSTA RICA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Costa Rica Government International Bond 7,300 % fällig am 13.11.2054	5.100	5.361	0,07
<b>ZYPERN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Atrium Finance PLC 2,625 % fällig am 05.09.2027	€ 9.900	9.010	0,12

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ERAMET S.A.</b>				<b>HONGKONG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
EPH Financing International A/S 5,875 % fällig am 30.11.2029	€ 2.100	\$ 2.258	0,03	6,500 % fällig am 30.11.2029	€ 7.500	\$ 8.087	0,10	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 8.300	\$ 8.099	0,10
<b>DÄNEMARK UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>La Mondiale SAM</b>				<b>UNGARN STAATSEMISSIONEN</b>			
TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	12.000	13.120	0,17	5,050 % fällig am 17.12.2025 (g)	12.665	13.570	0,18	Hungary Government International Bond 4,000 % fällig am 25.07.2029	17.675	18.801	0,24
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Loxam S.A.S.</b>				<b>Perusahaan Perseroan PT Perusahaan Listrik Negara</b>			
Dominican Republic Government International Bond 6,500 % fällig am 15.02.2048 (k)	\$ 30.900	29.333	0,38	2,875 % fällig am 15.04.2026	1.600	1.674	0,02	5,375 % fällig am 12.09.2033	20.675	23.038	0,30
<b>ECUADOR STAATSEMISSIONEN</b>				<b>New Immo Holding S.A.</b>				<b>Magyar Export-Import Bank</b>			
Ecuador Government International Bond 0,000 % fällig am 31.07.2030 (d)	21.275	10.239	0,13	4,500 % fällig am 15.02.2027	5.500	5.871	0,08	6,000 % fällig am 16.05.2029	€ 6.000	6.772	0,09
2,500 % fällig am 31.07.2040	14.324	6.531	0,08	2,750 % fällig am 26.11.2026	200	205	0,00	Summe Ungarn		53.420	0,69
3,500 % fällig am 31.07.2035	12.238	6.138	0,08	<b>Renault S.A.</b>				<b>INDONESIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,000 % fällig am 31.07.2030	12.797	8.138	0,11	2,375 % fällig am 25.05.2026	18.200	18.902	0,24	Pertamina Persero PT 6,500 % fällig am 07.11.2048	\$ 33.400	35.664	0,46
Summe Ecuador		31.046	0,40	<b>TDF Infrastructure SASU</b>				<b>Perusahaan Perseroan PT Perusahaan Listrik Negara</b>			
<b>AGYPTEN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Ubisoft Entertainment S.A.</b>				<b>3,000 % fällig am 30.06.2030</b>			
Egypt Government International Bond 6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 20.150	17.163	0,22	0,878 % fällig am 24.11.2027 (k)	6.000	5.558	0,07	6,150 % fällig am 21.05.2048	20.000	19.759	0,26
7,500 % fällig am 16.02.2061	\$ 36.675	24.669	0,32	<b>Verallia S.A.</b>				<b>Summe Indonesien</b>			
8,500 % fällig am 31.01.2047	9.500	7.064	0,09	1,875 % fällig am 10.11.2031	8.100	7.511	0,10			75.077	0,97
Summe Ägypten		48.896	0,63	<b>Viridien</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>EL SALVADOR STAATSEMISSIONEN</b>				<b>IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)</b>				<b>Indonesia Government International Bond</b>			
El Salvador Government International Bond 0,250 % fällig am 17.04.2030	13.000	395	0,01	2,500 % fällig am 25.01.2027	€ 1.200	1.189	0,02	1,400 % fällig am 30.10.2031	€ 4.960	4.499	0,06
6,375 % fällig am 18.01.2027	1.181	1.056	0,01	<b>INEOS Styrolution Ludwigshafen GmbH</b>				<b>4,850 % fällig am 11.01.2033</b>			
7,650 % fällig am 15.06.2035	2.000	1.456	0,02	2,250 % fällig am 16.01.2027 (k)	19.900	19.142	0,25	5,650 % fällig am 11.01.2053	1.100	1.118	0,01
8,250 % fällig am 10.04.2032	4.000	3.165	0,04	<b>Schaeffler AG</b>				<b>Summe Indonesien</b>			
9,250 % fällig am 17.04.2030	13.000	11.586	0,15	4,500 % fällig am 14.08.2026	3.700	3.998	0,05			83.433	1,08
Summe El Salvador		17.658	0,23	4,750 % fällig am 14.08.2029	1.700	1.838	0,03	<b>INTERNATIONAL KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN</b>			
<b>FINNLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Volkswagen Bank GmbH</b>				<b>Project Mercury</b>			
Balder Finland Oyj 1,000 % fällig am 18.01.2027	€ 200	195	0,00	2,500 % fällig am 31.07.2026	15.800	16.498	0,21	0,400 % - 8,088 % fällig am 11.08.2030	€ 8.000	8.776	0,11
1,000 % fällig am 20.01.2029	300	265	0,00	<b>Volkswagen Leasing GmbH</b>				<b>IRLAND FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
1,375 % fällig am 24.05.2030	4.900	4.185	0,06	3,875 % fällig am 11.10.2028	2.000	2.153	0,03	Accunia European CLO DAC 4,836 % fällig am 15.10.2030	312	335	0,00
2,000 % fällig am 18.01.2031	300	260	0,00	4,000 % fällig am 11.04.2031	800	863	0,01	Adagio CLO DAC 4,626 % fällig am 15.10.2031	5.632	6.008	0,08
Summe Finnland		4.905	0,06	<b>ZF Finance GmbH</b>				<b>Ares European CLO DAC</b>			
<b>FRANKREICH UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>3,750 % fällig am 21.09.2028</b>				<b>4,516 % fällig am 15.04.2030</b>			
Altarea S.C.A. 1,750 % fällig am 16.01.2030	500	448	0,01	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN</b>				<b>4,566 % fällig am 15.10.2030</b>			
1,875 % fällig am 17.01.2028	600	583	0,01	<b>SCUR-Alpha 1503 GmbH</b>				<b>4,686 % fällig am 15.10.2031</b>			
Altareit S.C.A. 2,875 % fällig am 02.07.2025	100	105	0,00	10,830 % fällig am 29.03.2030	\$ 2.469	2.340	0,03	4,747 % fällig am 20.04.2032	500	536	0,01
Altice France S.A. 4,000 % fällig am 15.07.2029	4.075	2.911	0,04	<b>Summe Deutschland</b>				<b>Armada Euro CLO DAC</b>			
4,250 % fällig am 15.10.2029	10.300	7.361	0,10			152.438	1,97	4,626 % fällig am 15.07.2031	9.784	10.479	0,14
11,500 % fällig am 01.02.2027 (j)	4.870	4.278	0,06	<b>GHANA STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Aurium CLO DAC</b>			
<b>BNP Paribas S.A.</b>				<b>Ghana Government International Bond</b>				<b>4,630 % fällig am 22.06.2034</b>			
5,497 % fällig am 20.05.2030	\$ 5.200	5.181	0,07	7,750 % fällig am 07.04.2029 ^ (k)	14.200	7.272	0,10	4,653 % fällig am 16.01.2031	5.000	5.355	0,07
5,738 % fällig am 20.02.2035	5.000	4.977	0,06	8,125 % fällig am 26.03.2032 ^	4.200	2.166	0,03	4,750 % fällig am 23.03.2032	10.393	11.179	0,14
<b>BPCE S.A.</b>				<b>8,750 % fällig am 11.03.2061 ^</b>				<b>Avoca CLO DAC</b>			
6,714 % fällig am 19.10.2029	7.000	7.260	0,09	8,950 % fällig am 26.03.2051 ^	12.400	6.384	0,08	4,726 % fällig am 15.10.2032	2.900	3.114	0,04
7,003 % fällig am 19.10.2034 (k)	5.000	5.349	0,07	<b>Summe Ghana</b>				<b>Bain Capital Euro CLO DAC</b>			
<b>Electricite de France S.A.</b>				<b>18,449 % fällig am 26.03.2051 ^</b>				<b>4,637 % fällig am 20.01.2032</b>			
4,500 % fällig am 21.09.2028	5.700	5.500	0,07	<b>GUATEMALA STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Black Diamond CLO DAC</b>			
6,000 % fällig am 22.04.2064	6.700	6.235	0,08	<b>Guatemala Government International Bond</b>				<b>4,757 % fällig am 20.01.2032</b>			
6,900 % fällig am 23.05.2053	1.700	1.807	0,02	7,050 % fällig am 04.10.2032	14.600	15.353	0,20	4,808 % fällig am 15.05.2032	3.858	4.137	0,05
9,125 % fällig am 15.03.2033 (g)	12.400	13.517	0,17	<b>GUERNSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Blackrock European CLO DAC</b>			
<b>Sirius Real Estate Ltd.</b>				<b>1,125 % fällig am 22.06.2026</b>				<b>4,526 % fällig am 15.10.2031</b>			
<b>1,125 % fällig am 22.06.2026</b>				<b>€ 200</b>				<b>BlueMountain Fuji EUR CLO DAC</b>			
<b>1,750 % fällig am 24.11.2028</b>				<b>500</b>				<b>1,050 % fällig am 15.01.2031</b>			
<b>Summe Guernsey, Kanalinseln</b>				<b>667 % fällig am 24.11.2028</b>				<b>4,626 % fällig am 15.01.2031</b>			
								<b>BNPP AM Euro CLO DAC</b>			
								<b>4,506 % fällig am 15.04.2031</b>			
								<b>1,000 % fällig am 15.04.2031</b>			
								<b>Bridgepoint CLO DAC</b>			
								<b>5,116 % fällig am 15.01.2034</b>			
								<b>Cairn CLO DAC</b>			
								<b>4,686 % fällig am 15.10.2031</b>			



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>			
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^ \$	3.900	234	0,00	Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033 €	23.500	20.410	0,26	<b>PERU</b>			
Tierra Mojada Luxembourg SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040	20.514	18.522	0,24	ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026 (g)(i) \$	9.000	8.659	0,11	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
		101.850	1,31	6,500 % fällig am 16.04.2025 (g)(i)(k)	18.702	18.558	0,24	Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. 10,100 % fällig am 15.12.2043 PEN	68.400	18.301	0,24
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN</b>				NE Property BV 3,375 % fällig am 14.07.2027 €	25.250	26.322	0,34	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Albion Financing SARL 9,147 % fällig am 17.08.2026 €	6.946	7.475	0,10	NN Group NV 4,500 % fällig am 15.01.2026 (g)	17.900	19.181	0,25	Peru Government International Bond 5,350 % fällig am 12.08.2040	5.500	1.165	0,01
Summe Luxemburg		126.554	1,63	Q-Park Holding BV 3,500 % fällig am 01.02.2025	33.350	35.698	0,46	5,400 % fällig am 12.08.2034	16.500	3.800	0,05
<b>MAZEDONIEN</b>				Sandoz Finance BV 4,220 % fällig am 17.04.2030	1.225	1.341	0,02	6,150 % fällig am 12.08.2032	13.200	3.326	0,04
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				4,500 % fällig am 17.11.2033	2.300	2.560	0,03	6,900 % fällig am 12.08.2037	20.900	5.244	0,07
North Macedonia Government International Bond 2,750 % fällig am 18.01.2025	1.600	1.690	0,02	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 4,375 % fällig am 09.05.2030	100	104	0,00	6,950 % fällig am 12.08.2031	12.000	3.218	0,04
3,675 % fällig am 03.06.2026	5.200	5.412	0,07	4,500 % fällig am 01.03.2025	1.808	1.937	0,03	7,300 % fällig am 12.08.2033	11.000	2.951	0,04
Summe Mazedonien		7.102	0,09	United Group BV 3,625 % fällig am 15.02.2028	300	303	0,00	8,750 % fällig am 21.11.2033 \$	15.000	18.313	0,24
				Upfild BV 6,875 % fällig am 02.07.2029 (a)	5.500	5.874	0,08			38.017	0,49
<b>MEXIKO</b>				Yinson Boronia Production BV 8,947 % fällig am 31.07.2042 \$	10.400	10.509	0,14	Summe Peru		56.318	0,73
<b>STAMMAKTIE</b>						171.926	2,22	<b>PHILIPPINEN</b>			
Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. (c)	28.925	0	0,00	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				Domi BV 4,419 % fällig am 15.06.2056 €	11.000	11.802	0,15	Philippines Government International Bond 5,000 % fällig am 17.07.2033	2.000	1.976	0,02
				EMF-NL Prime BV 4,688 % fällig am 17.04.2041	14	15	0,00	<b>POLEN</b>			
				Jubilee Place BV 4,519 % fällig am 17.09.2060	19.014	20.455	0,27	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
						32.272	0,42	Bank Gospodarstwa Krajowego 4,000 % fällig am 13.03.2032 €	2.000	2.147	0,03
				Summe Niederlande		206.780	2,67	4,375 % fällig am 13.03.2039	5.000	5.335	0,07
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>NIGERIA</b>				Republic of Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 18.03.2054 \$	3.250	3.159	0,04
Petroleos Mexicanos 6,350 % fällig am 12.02.2048 \$	3.800	2.428	0,03	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Polen		10.641	0,14
6,625 % fällig am 15.06.2035	72.500	55.168	0,71	Nigeria Government International Bond 7,625 % fällig am 28.11.2047 \$	17.700	12.881	0,17	<b>PORTUGAL</b>			
6,625 % fällig am 15.06.2038	3.900	2.774	0,04	7,875 % fällig am 16.02.2032	23.600	20.437	0,26	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,700 % fällig am 16.02.2032	21.387	17.920	0,23	Summe Nigeria		33.318	0,43	Banco Espírito Santo S.A. 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ €	200	62	0,00
6,750 % fällig am 21.09.2047	20.900	13.761	0,18	<b>OMAN</b>				Galp Energia SGPS S.A. 2,000 % fällig am 15.01.2026	12.300	12.812	0,17
7,690 % fällig am 23.01.2050	8.400	6.079	0,08	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Portugal		12.874	0,17
		98.130	1,27	Oman Government International Bond 6,750 % fällig am 17.01.2048	21.300	21.735	0,28	<b>RUMÄNIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>PAKISTAN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031 (f) MXN	168.335	7.752	0,10	Pakistan Government International Bond 6,000 % fällig am 08.04.2026	3.700	3.344	0,05	ALROSA Finance S.A. 3,100 % fällig am 25.06.2027 ^ \$	22.400	1.344	0,02
3,771 % fällig am 24.05.2061 \$	7.360	4.528	0,06	6,875 % fällig am 05.12.2027	1.800	1.561	0,02	4,650 % fällig am 09.04.2024 ^	3.200	192	0,00
4,000 % fällig am 24.08.2034 (f) MXN	149.640	7.324	0,09	7,375 % fällig am 08.04.2031	1.200	949	0,01	MMK International Capital DAC 4,375 % fällig am 13.06.2024 ^	8.600	516	0,01
4,490 % fällig am 25.05.2032 €	11.200	11.874	0,15	Summe Pakistan		5.854	0,08	Summe Rumänien		66.983	0,86
4,500 % fällig am 31.01.2050 \$	26.100	19.647	0,25	<b>PANAMA</b>				<b>RUSSLAND</b>			
5,750 % fällig am 12.10.2110	10.000	8.281	0,11	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,000 % fällig am 07.05.2036	11.750	11.469	0,15	Panama Government International Bond 3,750 % fällig am 16.03.2025	7.700	7.586	0,10	ALROSA Finance S.A. 3,100 % fällig am 25.06.2027 ^ \$	22.400	1.344	0,02
6,350 % fällig am 09.02.2035	15.300	15.422	0,20	3,875 % fällig am 17.03.2028	15.250	14.093	0,18	4,650 % fällig am 09.04.2024 ^	3.200	192	0,00
6,400 % fällig am 07.05.2054	4.000	3.819	0,05	4,500 % fällig am 16.04.2050	2.600	1.754	0,02	MMK International Capital DAC 4,375 % fällig am 13.06.2024 ^	8.600	516	0,01
		90.116	1,16	6,700 % fällig am 26.01.2036	20.600	20.041	0,26	Summe Russland		2.052	0,03
Summe Mexiko		188.246	2,43	6,853 % fällig am 28.03.2054	13.450	12.347	0,16	<b>SAUDI-ARABIEN</b>			
<b>MULTINATIONAL</b>				6,875 % fällig am 31.01.2036	5.700	5.580	0,07	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,875 % fällig am 01.03.2057 (k)	7.500	7.826	0,10	Saudi Arabia Government International Bond 3,450 % fällig am 02.02.2061	34.500	22.655	0,29
Connect Finco SARL 6,750 % fällig am 01.10.2026	9.550	9.225	0,12	8,000 % fällig am 01.03.2038	1.000	1.056	0,02	4,875 % fällig am 18.07.2033	20.000	19.542	0,25
<b>NIEDERLANDE</b>				Summe Panama		70.283	0,91	5,000 % fällig am 18.01.2053	20.000	17.648	0,23
<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>PARAGUAY</b>				Summe Saudi-Arabien		59.845	0,77
Mila BV 4,379 % fällig am 16.09.2041 €	2.400	2.582	0,03	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>SENEGAL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
ASR Nederland NV 7,000 % fällig am 07.12.2043	1.400	1.698	0,02	Panama Government International Bond 3,750 % fällig am 16.03.2025	7.700	7.586	0,10	Senegal Government International Bond 4,750 % fällig am 13.03.2028 €	3.100	3.073	0,04
Athora Netherlands NV 7,000 % fällig am 19.06.2025 (g)(i)	4.300	4.631	0,06	3,875 % fällig am 17.03.2028	15.250	14.093	0,18	5,375 % fällig am 08.06.2037	7.800	6.104	0,08
Boels Topholding BV 5,750 % fällig am 15.05.2030	5.100	5.564	0,07	4,500 % fällig am 16.04.2050	2.600	1.754	0,02				
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	3.400	3.122	0,04	6,700 % fällig am 26.01.2036	20.600	20.041	0,26				
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	678	702	0,01	6,853 % fällig am 28.03.2054	13.450	12.347	0,16				
Enel Finance International NV 5,000 % fällig am 15.06.2032 \$	5.000	4.753	0,06	6,875 % fällig am 31.01.2036	5.700	5.580	0,07				
				7,875 % fällig am 01.03.2057 (k)	7.500	7.826	0,10				
				8,000 % fällig am 01.03.2038	1.000	1.056	0,02				
				Summe Panama		70.283	0,91				
				<b>PARAGUAY</b>							
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
				Paraguay Government International Bond 6,000 % fällig am 09.02.2036	20.500	20.655	0,27				







## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Exelon Corp. 5,450 % fällig am 15.03.2034	\$ 7.000	\$ 6.954	0,09	LABL, Inc. 6,750 % fällig am 15.07.2026	\$ 4.500	\$ 4.448	0,06	4,250 % fällig am 15.03.2046	\$ 2.000	\$ 1.512	0,02
Fidelity National Financial, Inc. 3,400 % fällig am 15.06.2030	200	178	0,00	Ladder Capital Finance Holdings LLLP 7,000 % fällig am 15.07.2031 (a)	1.400	1.413	0,02	4,450 % fällig am 15.04.2042	3.500	2.779	0,04
First Student Bidco, Inc. 4,000 % fällig am 31.07.2029	2.000	1.804	0,02	Las Vegas Sands Corp. 3,500 % fällig am 18.08.2026	6.500	6.206	0,08	4,500 % fällig am 01.07.2040	9.396	7.747	0,10
Ford Motor Credit Co. LLC 2,386 % fällig am 17.02.2026	€ 4.200	4.396	0,06	5,900 % fällig am 01.06.2027	8.250	8.297	0,11	4,600 % fällig am 15.06.2043	3.600	2.928	0,04
2,700 % fällig am 10.08.2026	\$ 11.600	10.899	0,14	6,000 % fällig am 15.08.2029	1.875	1.885	0,02	4,650 % fällig am 01.08.2028	100	97	0,00
3,250 % fällig am 15.09.2025	€ 4.000	4.253	0,06	Level 3 Financing, Inc. 11,000 % fällig am 15.11.2029	5.635	5.774	0,07	PacifiCorp 5,300 % fällig am 15.02.2031	3.300	3.291	0,04
3,815 % fällig am 02.11.2027	\$ 1.200	1.126	0,01	LifePoint Health, Inc. 11,000 % fällig am 15.10.2030	13.350	14.725	0,19	5,450 % fällig am 15.02.2034	9.000	8.894	0,11
4,125 % fällig am 17.08.2027	6.100	5.799	0,08	Live Nation Entertainment, Inc. 3,750 % fällig am 15.01.2028	5.500	5.123	0,07	5,800 % fällig am 15.01.2055	3.450	3.343	0,04
4,271 % fällig am 09.01.2027	1.700	1.639	0,02	Marriott International, Inc. 4,625 % fällig am 15.06.2030	900	874	0,01	Panther Escrow Issuer LLC 7,125 % fällig am 01.06.2031	11.000	11.134	0,14
4,389 % fällig am 08.01.2026	1.800	1.763	0,02	Marvell Technology, Inc. 5,750 % fällig am 15.02.2029	2.200	2.247	0,03	PennyMac Financial Services, Inc. 7,125 % fällig am 15.11.2030	11.050	11.024	0,14
4,535 % fällig am 06.03.2025	£ 2.800	3.513	0,05	Matador Resources Co. 6,500 % fällig am 15.04.2032	5.600	5.605	0,07	Plains All American Pipeline LP 5,150 % fällig am 01.06.2042	12.177	10.799	0,14
4,542 % fällig am 01.08.2026	\$ 1.900	1.850	0,02	Mattel, Inc. 3,375 % fällig am 01.04.2026	2.800	2.694	0,03	6,650 % fällig am 15.01.2037	6.790	7.147	0,09
5,125 % fällig am 16.06.2025	1.525	1.514	0,02	McAfee Corp. 7,375 % fällig am 15.02.2030	2.000	1.849	0,02	Raising Cane's Restaurants LLC 9,375 % fällig am 01.05.2029	4.300	4.649	0,06
7,350 % fällig am 04.11.2027	1.100	1.147	0,01	Medline Borrower LP 3,875 % fällig am 01.04.2029	6.000	5.530	0,07	Rand Parent LLC 8,500 % fällig am 15.02.2030	325	329	0,00
Fortress Intermediate, Inc. 7,500 % fällig am 01.06.2031	5.750	5.898	0,08	5,250 % fällig am 01.10.2029	4.650	4.441	0,06	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	139	141	0,00
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 5,500 % fällig am 01.05.2028	19.600	19.022	0,25	6,250 % fällig am 01.04.2029	4.200	4.253	0,06	9,750 % fällig am 06.01.2027	1.624	1.679	0,02
7,000 % fällig am 01.05.2031	10.075	10.304	0,13	Morgan Stanley 3,955 % fällig am 21.03.2035	€ 7.700	€ 8.209	0,11	Rivian Holdings LLC 11,310 % fällig am 15.10.2026	12.200	12.368	0,16
Freedom Mortgage Corp. 7,625 % fällig am 01.05.2026	22.600	22.460	0,29	5,250 % fällig am 21.04.2034	\$ 5.000	4.924	0,06	RLJ Lodging Trust LP 3,750 % fällig am 01.07.2026	1.600	1.523	0,02
Frontier Communications Holdings LLC 5,875 % fällig am 15.10.2027	2.125	2.077	0,03	MPH Acquisition Holdings LLC 5,500 % fällig am 01.09.2028	875	662	0,01	Rockies Express Pipeline LLC 3,600 % fällig am 15.05.2025	100	98	0,00
Genesis Energy LP 8,875 % fällig am 15.04.2030	1.400	1.474	0,02	National Fuel Gas Co. 2,950 % fällig am 01.03.2031	1.017	854	0,01	4,800 % fällig am 15.05.2030	15.450	14.277	0,18
Georgia Power Co. 5,250 % fällig am 15.03.2034	6.600	6.582	0,09	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 7,125 % fällig am 01.02.2032	5.300	5.337	0,07	4,950 % fällig am 15.07.2029	5.000	4.711	0,06
Global Atlantic Fin Co. 4,400 % fällig am 15.10.2029	11.620	10.830	0,14	Netflix, Inc. 4,875 % fällig am 15.06.2030 (k)	21.000	20.677	0,27	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % fällig am 01.03.2025	16.250	16.220	0,21
Global Medical Response, Inc. 0,000 % fällig am 31.10.2028	1.717	1.677	0,02	New Fortress Energy, Inc. 8,750 % fällig am 15.03.2029	1.800	1.645	0,02	Sammons Financial Group, Inc. 6,875 % fällig am 15.04.2034	6.550	6.720	0,09
GLP Capital LP 5,750 % fällig am 01.06.2028	3.720	3.725	0,05	NextEra Energy Operating Partners LP 7,250 % fällig am 15.01.2029	2.650	2.719	0,04	Santander Holdings USA, Inc. 3,450 % fällig am 02.06.2025	7.900	7.731	0,10
GN Bondco LLC 9,500 % fällig am 15.10.2031	7.700	7.184	0,09	NGPL PipeCo LLC 7,768 % fällig am 15.12.2037	21.356	24.668	0,32	Sirius XM Radio, Inc. 3,125 % fällig am 01.09.2026	4.300	4.049	0,05
Goldman Sachs Group, Inc. 2,615 % fällig am 22.04.2032	5.000	4.206	0,05	Noble Finance LLC 8,000 % fällig am 15.04.2030	3.650	3.801	0,05	4,125 % fällig am 01.07.2030	3.000	2.565	0,03
5,727 % fällig am 25.04.2030	7.950	8.093	0,10	NuStar Logistics LP 5,625 % fällig am 28.04.2027	20.400	20.241	0,26	Sitio Royalties Operating Partnership LP 7,875 % fällig am 01.11.2028	2.000	2.069	0,03
Gray Oak Pipeline LLC 3,450 % fällig am 15.10.2027	6.900	6.496	0,08	Occidental Petroleum Corp. 6,625 % fällig am 01.09.2030	20.900	21.931	0,28	Southern California Edison Co. 5,200 % fällig am 01.06.2034	7.700	7.522	0,10
Gray Television, Inc. 4,750 % fällig am 15.10.2030	4.550	2.734	0,04	8,875 % fällig am 15.07.2030	2.915	3.360	0,04	Spirit AeroSystems, Inc. 9,375 % fällig am 30.11.2029	900	970	0,01
Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital, Inc. 6,375 % fällig am 01.07.2034 (a)	5.700	5.585	0,07	Olympus Water U.S. Holding Corp. 7,250 % fällig am 15.06.2031	7.000	6.964	0,09	9,750 % fällig am 15.11.2030	3.100	3.424	0,04
HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	1.675	1.581	0,02	Omega Healthcare Investors, Inc. 4,750 % fällig am 15.01.2028	200	194	0,00	Spirit Airlines Operating Partnership Trust 3,375 % fällig am 15.08.2031	673	594	0,01
3,750 % fällig am 15.09.2030	2.085	1.820	0,02	OneMain Finance Corp. 7,125 % fällig am 15.03.2026	3.458	3.517	0,05	4,100 % fällig am 01.10.2029	270	253	0,00
8,000 % fällig am 15.06.2027	5.300	5.517	0,07	Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 26.850	€ 27.129	0,35	Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	12.000	14.444	0,19
HCA, Inc. 3,500 % fällig am 15.07.2051	5.000	3.345	0,04	4,125 % fällig am 30.04.2028	\$ 6.750	6.275	0,08	Sprint LLC 7,625 % fällig am 01.03.2026	1.125	1.157	0,01
5,500 % fällig am 01.06.2033	1.600	1.587	0,02	Pacific Gas & Electric Co. 2,100 % fällig am 01.08.2027	300	271	0,00	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 37.000	€ 37.560	0,48
5,900 % fällig am 01.06.2053	1.775	1.730	0,02	2,850 % fällig am 01.02.2031	1.300	1.072	0,01	4,750 % fällig am 15.01.2028	\$ 3.450	\$ 3.286	0,04
Howard Midstream Energy Partners LLC 7,375 % fällig am 15.07.2032	5.275	5.360	0,07	3,150 % fällig am 01.01.2026	8.400	8.095	0,10	Station Casinos LLC 6,625 % fällig am 15.03.2032	2.250	2.241	0,03
Imola Merger Corp. 4,750 % fällig am 15.05.2029	8.000	7.485	0,10	3,300 % fällig am 15.03.2027	3.100	2.938	0,04	Synchrony Financial 5,150 % fällig am 19.03.2029	300	288	0,00
IQVIA, Inc. 5,700 % fällig am 15.05.2028	2.000	2.024	0,03	3,300 % fällig am 01.12.2027	2.900	2.705	0,04	T-Mobile USA, Inc. 4,950 % fällig am 15.03.2028	1.000	994	0,01
Jane Street Group 7,125 % fällig am 30.04.2031	13.900	14.265	0,18	3,300 % fällig am 01.08.2040	25.900	18.467	0,24	5,650 % fällig am 15.01.2053	2.000	1.972	0,03
JetBlue Pass-Through Trust 2,750 % fällig am 15.11.2033	793	686	0,01	3,400 % fällig am 15.08.2024	1.900	1.894	0,02	Tallgrass Energy Partners LP 5,500 % fällig am 15.01.2028	3.400	3.256	0,04
4,000 % fällig am 15.05.2034	8.812	8.266	0,11	3,400 % fällig am 01.07.2025	2.250	2.196	0,03	6,000 % fällig am 31.12.2030	6.315	5.888	0,08
JPMorgan Chase & Co. 4,586 % fällig am 26.04.2033	5.000	4.772	0,06	3,500 % fällig am 15.06.2025	2.000	1.957	0,03	Tennessee Gas Pipeline Co. LLC 8,375 % fällig am 15.06.2032	1.351	1.562	0,02
5,040 % fällig am 23.01.2028	5.000	4.974	0,06	3,750 % fällig am 01.07.2028	2.350	2.208	0,03	TransDigm, Inc. 6,375 % fällig am 01.03.2029	3.400	3.421	0,04
5,581 % fällig am 22.04.2030	1.700	1.727	0,02	3,950 % fällig am 01.12.2047	800	574	0,01	7,125 % fällig am 01.12.2031	7.125	7.350	0,10
6,559 % fällig am 23.01.2028	5.000	5.061	0,07	4,200 % fällig am 01.06.2041	1.100	863	0,01	Triton Water Holdings, Inc. 6,250 % fällig am 01.04.2029	5.400	5.213	0,07
Kennedy-Wilson, Inc. 4,750 % fällig am 01.02.2030	24.300	20.194	0,26					U.S. Airways Pass-Through Trust 3,950 % fällig am 15.05.2027	1.672	1.634	0,02





BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
4,422 % fällig am 25.09.2036	\$ 22	\$ 18	0,00	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
4,422 % fällig am 25.09.2036	435	347	0,01	Uniform Mortgage-Backed Security				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITTEL</b>			
4,448 % fällig am 27.02.2034	103	96	0,00	5,500 % fällig am 01.12.2052	\$ 14.558	\$ 14.396	0,18	Gateway Re Ltd.			
4,483 % fällig am 25.08.2036	41	36	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				5,355 % fällig am 23.12.2028	\$ 1.500	\$ 1.378	0,02
4,580 % fällig am 25.03.2036	105	95	0,00	4,500 % fällig am 01.07.2054	33.800	31.868	0,41	TER Finance Jersey Ltd.			
4,694 % fällig am 25.04.2035	9	8	0,00	5,000 % fällig am 01.07.2054 -				7,020 % fällig am			
4,824 % fällig am 25.12.2035	56	49	0,00	01.09.2054	185.800	179.584	2,32	02.01.2025 (d)(e)	3.900	3.761	0,05
4,923 % fällig am 25.05.2046	64	53	0,00	5,500 % fällig am 01.08.2054	255.800	252.273	3,26	Summe kurzfristige Instrumente		5.139	0,07
5,014 % fällig am 25.01.2036	2.038	1.896	0,03	6,000 % fällig am 01.08.2054	209.900	210.416	2,72				
5,542 % fällig am 25.02.2033	7	7	0,00	6,500 % fällig am 01.07.2054 -				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 7.034.936		90,81
5,963 % fällig am 25.07.2047	413	324	0,01	01.08.2054	415.650	422.901	5,46				
6,040 % fällig am 25.10.2045	21	20	0,00			1.111.438	14,35				
6,100 % fällig am 25.01.2045	461	438	0,01	<b>US-SCHATZOBBLIGATIONEN</b>				<b>AKTIEN</b>			
6,153 % fällig am 25.08.2046	247	225	0,00	U.S. Treasury Bonds				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
6,200 % fällig am 25.11.2034	235	219	0,00	4,000 % fällig am 15.11.2042	98.500	90.801	1,17	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
6,292 % fällig am 25.06.2033	26	25	0,00	Summe USA		3.207.764	41,41	PIMCO Funds: Global Investors			
6,300 % fällig am 25.06.2044	227	208	0,00					Series plc - PIMCO Asia High	3.514.066	35.598	0,46
6,353 % fällig am 25.11.2042	3	2	0,00	<b>USBEKISTAN</b>				Yield Bond Fund (h)			
6,553 % fällig am 25.04.2044	1	1	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				PIMCO Funds: Global Investors			
6,653 % fällig am 25.10.2046	16	14	0,00	Republic of Uzbekistan International Bond				Series plc - US Short-Term	35.003.844	356.689	4,60
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				5,375 % fällig am 29.05.2027	€ 5.100	5.458	0,07	Fund (h)			
5,500 % fällig am 25.05.2035	187	151	0,00					PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
5,500 % fällig am 25.07.2035	371	322	0,01	<b>VENEZUELA</b>				US Dollar Short-Term Floating	10.428.428	103.925	1,34
5,500 % fällig am 25.11.2035	110	94	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				NAV Fund (h)		496.212	6,40
5,780 % fällig am 25.02.2037	516	380	0,01	Petroleos de Venezuela S.A.							
6,000 % fällig am 25.06.2037	445	386	0,01	6,000 % fällig am 16.05.2024	\$ 8.400	1.050	0,01	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
Wells Fargo Alternative Loan Trust								PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar	2.698.640	270.012	3,49
5,750 % fällig am 25.07.2037	47	39	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Short Maturity UCITS ETF (h)			
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				Venezuela Government International Bond				Summe Investmentfonds	\$ 766.224		9,89
5,930 % fällig am 25.11.2037	61	52	0,00	6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	2.651	379	0,01				
6,000 % fällig am 25.06.2037	1.689	1.479	0,02	7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	16.792	2.514	0,03				
6,347 % fällig am 25.04.2036	7	6	0,00	9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	7.813	1.348	0,02				
6,356 % fällig am 25.12.2036	52	49	0,00			4.241	0,06				
6,578 % fällig am 25.04.2036	119	110	0,00	Summe Venezuela		5.291	0,07				
		87.210	1,13								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
CEW	4,720 %	24.06.2024	02.07.2024	CAD 570.000	Province of Alberta 3,100 % - 3,300 % fällig am 01.12.2046 - 01.06.2050	\$ (297.263)	\$ 416.561	\$ 416.937	5,38
					Province of British Columbia 3,200 % fällig am 18.06.2044	(91.994)			
					Province of Ontario 2,150 % fällig am 02.06.2031	(13.056)			
					Province of Quebec 1,500 % fällig am 01.09.2031	(16.429)			
	4,720	25.06.2024	03.07.2024	430.000	Province of British Columbia 4,250 % fällig am 18.12.2053	(107.849)	314.247	314.491	4,06
					Province of Ontario 2,250 % - 2,600 % fällig am 02.06.2027 - 02.12.2031	(210.053)			
	4,720	27.06.2024	05.07.2024	170.000	Province of British Columbia 2,800 % fällig am 18.06.2048	(111.579)	124.237	124.301	1,60
					Province of Ontario 3,500 % fällig am 02.06.2043	(14.183)			
	4,720	28.06.2024	08.07.2024	50.000	Province of Ontario 3,750 % fällig am 02.12.2053	(33.201)	36.540	36.555	0,47
					Province of Quebec 4,250 % fällig am 01.12.2043	(3.927)			
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	\$ 8.177	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(8.341)	8.177	8.177	0,11
MEI	4,710	26.06.2024	03.07.2024	CAD 10.000	Canada Government International Bond 4,500 % fällig am 01.11.2025	(7.462)	7.308	7.313	0,09
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (915.337)	\$ 907.070	\$ 907.774	11,71

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	156	\$ (27)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	793	(760)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	72	(103)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	303	508	0,01
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	285	(142)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	3.590	1.112	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	4.830	2.416	0,03
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	1.995	1.677	0,02
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	730	858	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	38	24	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	1.459	1.209	0,02
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	74	(32)	0,00
				\$ 6.740	0,09

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 109,000	26.07.2024	13	\$ (4)	\$ (5)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	112,000	26.07.2024	13	(4)	(2)	0,00
				\$ (8)	\$ (7)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate						\$ 6.733 0,09

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 12.800	\$ (82)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	4.400	94	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	3	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	1.200	(4)	0,00
Carnival Corp.	1,000	20.12.2028	6.200	1.197	0,02
Cellnex Telecom S.A.	5,000	20.12.2030	€ 12.400	1.124	0,02
Charter Communications, Inc.	5,000	20.12.2027	\$ 21.000	396	0,01
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2024	600	(11)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	1.300	8	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	800	31	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	6.900	251	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	35.000	333	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	4.300	37	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2026	4.200	(414)	(0,01)
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2031	€ 10.000	(122)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	18.600	999	0,01
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2028	11.000	922	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	40.600	137	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	\$ 1.400	(3)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2027	€ 6.400	303	0,00
				\$ 5.199	0,07

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.EM-40 5-Year Index	1,000 %	20.12.2028	\$ 29.900	\$ 61	0,00
CDX.EM-41 5-Year Index	1,000	20.06.2029	18.500	91	0,00
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	207.900	6.019	0,08
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000	20.06.2029	418.000	(1.752)	(0,02)
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	425.900	(524)	(0,01)
				\$ 3.895	0,05

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2025	£ 21.100	\$ 2.339	0,03
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	5.000	(294)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	71.800	(653)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 12.250.000	1.779	0,02
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,284	04.01.2027	BRL 387.600	(2.016)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	2,500	19.06.2029	CAD 91.700	352	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	115.100	212	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	AUD 103.000	1.193	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,520	07.07.2027	€ 127.500	(3.683)	(0,05)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	40.200	1.931	0,03
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	85.800	(2.175)	(0,03)
					\$ (1.015)	(0,02)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 8.079</b>	<b>0,10</b>

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	4.800	\$ (22)	\$ (6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	4.800	(22)	0	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	3.800	(14)	(11)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	3.800	(14)	(19)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,586	15.07.2024	5.600	(21)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,986	15.07.2024	5.600	(21)	(31)	0,00
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689	15.07.2024	8.500	(17)	(4)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	8.500	(17)	(20)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	4.500	(19)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	9.900	(38)	(11)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	10.000	(36)	(18)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	5.100	(20)	(10)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	7.300	(25)	(12)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	9.900	(38)	(64)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	10.000	(36)	(65)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	4.500	(19)	(29)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	5.100	(20)	(26)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	7.300	(25)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,640	23.07.2024	2.600	(10)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	5.200	(20)	(10)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	2.800	(11)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,990	23.07.2024	2.600	(10)	(17)	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	5.200	(20)	(28)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	2.800	(11)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	5.100	(13)	(10)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	5.100	(19)	(14)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	5.200	(22)	(16)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	5.100	(19)	(29)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	5.100	(13)	(22)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	5.200	(22)	(6)	0,00
							\$ (614)	\$ (495)	(0,01)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzzeit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2028	\$ 23.600	\$ (467)	\$ (41)	\$ (508)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	22.000	(1.915)	1.369	(546)	(0,01)
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2028	23.700	(458)	(52)	(510)	(0,01)
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	61.600	(2.646)	2.568	(78)	0,00
CBK	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2027	9.000	(45)	6	(39)	0,01
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	5.000	0	386	386	0,01
GLM	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2029	9.400	(962)	271	(691)	(0,01)
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20.12.2026	€ 7.400	(47)	(198)	(245)	0,00
JPM	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2029	\$ 200	(2)	(2)	(4)	0,00
	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2029	200	(2)	(2)	(4)	0,00
MYC	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	22.400	(1.303)	747	(556)	(0,01)
					\$ (7.847)	\$ 5.052	\$ (2.795)	(0,03)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD 6.414	\$ 3.928	\$ 20	\$ 0	\$ 20	0,00
	08.2024	\$ 3.928	NZD 6.414	0	(20)	(20)	0,00
	10.2024	10.982	CNH 78.601	0	(124)	(124)	0,00
BOA	07.2024	€ 922.376	\$ 1.001.423	12.866	0	12.866	0,17
	07.2024	KRW 15.467.452	11.306	72	0	72	0,00
	07.2024	SGD 356	262	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07.2024	\$ 2.469	PLN 9.840	0	(22)	(22)	0,00
	07.2024	24.715	SGD 33.519	32	(14)	18	0,00
	08.2024	SGD 28.766	\$ 21.225	0	(32)	(32)	0,00
BRC	08.2024	\$ 3.574	TRY 125.156	41	0	41	0,00
	07.2024	BRL 13.686	\$ 2.721	257	0	257	0,00
	07.2024	CAD 14.069	10.293	12	0	12	0,00
CBK	07.2024	€ 643.202	696.221	6.869	0	6.869	0,09
	07.2024	£ 206.751	264.102	2.748	0	2.748	0,04
	07.2024	KRW 15.561.136	11.337	35	0	35	0,00
BOA	07.2024	\$ 30.112	AUD 45.193	70	0	70	0,00
	07.2024	100	BRL 535	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	884.188	€ 826.653	1.778	0	1.778	0,02
BPS	07.2024	3.150	IDR 51.613.454	5	0	5	0,00
	07.2024	852	ILS 3.160	0	(13)	(13)	0,00
	07.2024	8.365	NZD 13.617	0	(68)	(68)	0,00
BRC	07.2024	6.643	PLN 26.446	6	(72)	(66)	0,00
	08.2024	AUD 45.193	\$ 30.138	0	(69)	(69)	0,00
	08.2024	€ 826.653	885.479	0	(1.778)	(1.778)	(0,02)
BOA	08.2024	TRY 866	25	0	0	0	0,00
	09.2024	CNH 176.636	24.648	313	0	313	0,00
	09.2024	TWD 507.143	15.761	96	0	96	0,00
BRC	09.2024	\$ 27.455	INR 2.300.663	74	0	74	0,00
	10.2024	CNH 60.887	\$ 8.504	93	0	93	0,00
	10.2024	\$ 2.177	CNH 15.590	0	(23)	(23)	0,00
BOA	07.2024	AUD 1.050	\$ 695	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	CAD 7.183	5.228	0	(21)	(21)	0,00
	07.2024	MXN 66.201	3.584	0	(30)	(30)	0,00
BRC	07.2024	NOK 3.817	363	4	0	4	0,00
	07.2024	PLN 71	18	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 7.990	5.917	21	0	21	0,00
BOA	07.2024	THB 5.505	150	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 6.424	CAD 8.782	5	(11)	(6)	0,00
	07.2024	5.419	PLN 21.648	0	(35)	(35)	0,00
BOA	07.2024	12.160	TRY 414.609	181	0	181	0,00
	08.2024	3.360	115.890	12	0	12	0,00
	09.2024	MXN 102.525	\$ 5.424	0	(116)	(116)	0,00
BOA	09.2024	\$ 10.550	MXN 197.662	131	0	131	0,00
	09.2024	4.593	TRY 169.620	236	0	236	0,00
	10.2024	CNH 168.070	\$ 23.451	234	0	234	0,00
CBK	07.2024	CAD 1.086.844	794.291	493	(487)	6	0,00
	07.2024	CHF 5.500	6.044	0	(77)	(77)	0,00
	07.2024	£ 2.591	3.302	27	0	27	0,00
BOA	07.2024	KRW 1.133.556	831	8	0	8	0,00
	07.2024	SEK 2.170	204	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 10.396	BRL 56.645	0	(197)	(197)	0,00
BOA	07.2024	9.045	£ 7.073	0	(104)	(104)	0,00
	07.2024	6.935	PLN 27.508	0	(94)	(94)	0,00
	07.2024	51	ZAR 927	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	BRL	56.836	\$ 10.396	\$ 200	\$ 0	0,00
	09.2024	PEN	48.015	12.819	286	0	0,00
	09.2024	TWD	193.357	5.999	27	0	0,00
DUB	09.2024	\$	18.599	INR 1.554.976	13	(6)	0,00
	07.2024	AUD	1.970	\$ 1.304	0	(12)	0,00
	07.2024	BRL	528	100	5	0	0,00
	07.2024	IDR	815.550	50	0	0	0,00
	07.2024	KRW	8.390.482	6.099	4	0	0,00
	07.2024	\$	16.020	PLN 62.958	0	(362)	0,00
	08.2024	BRL	14.510	\$ 2.819	216	0	0,00
	09.2024	PEN	39.364	10.579	303	0	0,00
FAR	07.2024	AUD	45.976	30.632	0	(73)	0,00
	07.2024	CAD	85.088	62.108	0	(79)	0,00
	07.2024	NZD	12.325	7.517	7	0	0,00
	07.2024	\$	5.462	¥ 870.226	0	(52)	0,00
	07.2024		330	NZD 535	0	(4)	0,00
	08.2024	¥	866.143	\$ 5.462	52	0	0,00
	08.2024	\$	7.517	NZD 12.325	0	(7)	0,00
GLM	07.2024	KRW	19.247	\$ 14	0	0	0,00
	07.2024	MXN	62.496	3.365	0	(46)	0,00
	07.2024	TRY	1.445	42	0	0	0,00
	07.2024	\$	5.084	CAD 6.986	22	0	0,00
	07.2024		200	KRW 274.759	0	(1)	0,00
	07.2024		5.878	PLN 23.220	0	(103)	0,00
	07.2024		10.939	ZAR 200.140	8	0	0,00
	08.2024		12.273	BRL 64.919	0	(628)	(0,01)
JPM	07.2024	BRL	3.928	\$ 781	74	0	0,00
	07.2024	CHF	3.303	3.652	0	(24)	0,00
	07.2024	CNY	5.902	828	9	0	0,00
	07.2024	IDR	19.653.939	1.212	11	0	0,00
	07.2024	KRW	41.854.947	30.377	0	(22)	0,00
	07.2024	SGD	24.513	18.212	125	0	0,00
	07.2024	\$	46.423	CHF 41.660	0	(62)	0,00
	07.2024		15	CNY 108	0	0	0,00
	07.2024		30.750	€ 28.724	45	(10)	0,00
	07.2024		2.245	ILS 8.304	0	(40)	0,00
	07.2024		14	KRW 19.668	0	0	0,00
	07.2024		3.672	PLN 14.362	0	(100)	0,00
	07.2024		20.594	ZAR 379.109	142	0	0,00
	08.2024	CHF	41.506	\$ 46.423	61	0	0,00
	08.2024	\$	828	CNY 5.906	0	0	0,00
	08.2024		7.454	TRY 259.115	116	0	0,00
	09.2024	TWD	328.966	\$ 10.218	57	0	0,00
	09.2024	\$	2.098	INR 175.752	5	0	0,00
	10.2024	CNH	104.963	\$ 14.668	169	0	0,00
MBC	10.2024	\$	2.176	CNH 15.544	0	(29)	0,00
	07.2024	CAD	127.312	\$ 93.292	280	(34)	0,00
	07.2024	€	40.711	43.977	345	0	0,01
	07.2024	£	18.838	23.983	170	0	0,00
	07.2024	¥	870.968	5.560	146	0	0,00
	07.2024	SGD	541	400	1	0	0,00
	07.2024	\$	57.091	CAD 78.208	64	0	0,00
	07.2024		847.060	€ 792.093	1.903	(37)	0,03
	07.2024		15.664	£ 12.382	0	(12)	0,00
	07.2024		109	HUF 40.454	1	0	0,00
	07.2024		279	NOK 2.969	0	0	0,00
	08.2024	CAD	70.248	\$ 51.342	0	(32)	0,00
	08.2024	€	776.632	831.667	0	(1.902)	(0,02)
MYI	08.2024	NOK	2.967	279	0	0	0,00
	07.2024	AUD	18	12	0	0	0,00
	07.2024	BRL	39.023	7.555	529	0	0,01
	07.2024	€	18.597	19.941	9	0	0,00
	07.2024	£	167	212	0	0	0,00
	07.2024	MXN	2.110	115	0	(1)	0,00
	07.2024	SGD	413	304	0	0	0,00
	07.2024	\$	8	AUD 12	0	0	0,00
	07.2024		2.256	€ 2.108	3	0	0,00
	07.2024		3.858	£ 3.050	0	(3)	0,00
	07.2024		80	NOK 848	0	0	0,00
	07.2024		8.543	NZD 13.929	0	(55)	0,00
	07.2024		206	SEK 2.173	0	(1)	0,00
	08.2024	NOK	847	\$ 80	0	0	0,00
	08.2024	SEK	2.170	206	1	0	0,00
	09.2024	TWD	130.864	4.079	37	0	0,00
RBC	09.2024	\$	1.403	INR 117.313	1	0	0,00
	07.2024		4.246	CAD 5.835	18	0	0,00
	07.2024		3.557	€ 3.275	0	(47)	0,00
	07.2024		264.684	£ 208.725	0	(835)	(0,01)
	08.2024	£	208.725	\$ 264.730	832	0	0,01
RYL	07.2024	€	18.344	19.624	0	(36)	0,00
	07.2024	\$	2.537	AUD 3.803	3	0	0,00
SCX	07.2024	€	7.516	\$ 8.075	19	0	0,00
	07.2024	IDR	1.148.840	70	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2024	KRW	7.886.543	\$ 5.783	\$ 55	\$ 0	0,00	
	07.2024	MXN	212	11	0	0	0,00	
	07.2024	PEN	61.466	16.395	349	0	0,01	
	07.2024	\$	814	CNY 5.790	0	(11)	0,00	
	07.2024		15.388	ZAR 283.567	122	0	0,00	
	09.2024	CNH	72.488	\$ 10.104	117	0	0,00	
	09.2024	TWD	935.194	29.024	138	0	0,00	
	09.2024	\$	17.337	INR 1.451.074	26	0	0,00	
TOR	07.2024	CHF	146	\$ 162	0	(1)	0,00	
	07.2024	NZD	9.342	5.722	29	0	0,00	
	08.2024	\$	5.722	NZD 9.342	0	(29)	0,00	
UAG	07.2024	CAD	10.009	\$ 7.332	17	0	0,00	
	07.2024	CHF	32.733	36.223	0	(204)	0,00	
	07.2024	ILS	11.291	3.047	48	0	0,00	
	07.2024	\$	26	CHF 23	0	0	0,00	
	08.2024	CHF	23	\$ 26	0	0	0,00	
					\$ 33.959	\$ (8.319)	\$ 25.640	0,33

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2024	AUD	15.015	\$ 10.002	\$ 0	\$ (26)	0,00	
	07.2024	\$	13.185	AUD 19.797	37	0	0,00	
	08.2024		10.010	15.015	26	0	0,00	
BOA	07.2024		43	65	0	0	0,00	
BPS	07.2024	AUD	15.045	\$ 10.025	0	(23)	0,00	
	07.2024	\$	65	AUD 98	1	0	0,00	
	08.2024		10.013	15.015	23	0	0,00	
BRC	07.2024	AUD	9	\$ 6	0	0	0,00	
CBK	07.2024		339	226	0	(1)	0,00	
	07.2024	\$	144	AUD 218	1	0	0,00	
DUB	07.2024		6	9	0	0	0,00	
FAR	07.2024	AUD	13.767	\$ 9.183	0	(12)	0,00	
	07.2024	\$	9.955	AUD 14.942	24	0	0,00	
	08.2024		9.191	13.767	11	0	0,00	
GLM	07.2024	AUD	4	\$ 3	0	0	0,00	
JPM	07.2024	\$	7	AUD 10	0	0	0,00	
	08.2024	AUD	263	\$ 175	0	0	0,00	
MBC	07.2024		162	108	0	(1)	0,00	
	07.2024	\$	233	AUD 350	1	0	0,00	
MYI	07.2024	AUD	2	\$ 1	0	0	0,00	
RBC	07.2024	\$	101	AUD 152	0	0	0,00	
RYL	07.2024	AUD	161	\$ 106	0	(1)	0,00	
TOR	07.2024	\$	5.895	AUD 8.864	25	0	0,00	
					\$ 149	\$ (64)	\$ 85	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BPS	07.2024	CAD	1.689	\$ 1.232	\$ 0	\$ (3)	0,00	
	07.2024	\$	80.014	CAD 109.502	12	(1)	0,00	
CBK	07.2024	CAD	159.777	\$ 116.769	3	0	0,00	
	07.2024	\$	70.683	CAD 96.283	0	(318)	0,00	
	08.2024		116.769	159.668	0	0	0,00	
GLM	07.2024	CAD	181	\$ 132	0	0	0,00	
MBC	07.2024		329.161	240.425	0	(128)	0,00	
	07.2024	\$	94.467	CAD 128.628	0	(465)	(0,01)	
	08.2024		240.425	328.938	136	0	0,00	
MYI	07.2024		4.641	6.384	24	0	0,00	
RBC	07.2024		109.548	150.067	122	0	0,00	
					\$ 297	\$ (915)	\$ (618)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$	6.778	CHF 6.097	\$ 7	\$ 7	0,00
BRC	07.2024	CHF	37	\$ 42	0	0	0,00
CBK	07.2024	\$	691	CHF 629	9	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
JPM	07.2024	CHF	\$	7.301	8.136	\$ 11	0,00
	07.2024	\$	CHF	7	6	0	0,00
	08.2024			8.136	7.274	(11)	0,00
MYI	07.2024	CHF	\$	53	59	0	0,00
SCX	07.2024	\$	CHF	73	66	0	0,00
TOR	07.2024			8.022	7.246	42	0,00
UAG	07.2024	CHF	\$	7.258	8.090	12	0,00
	07.2024	\$	CHF	7.935	7.170	45	0,00
	08.2024			8.090	7.231	(12)	0,00
				\$ 126	\$ (23)	\$ 103	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) ausschüttend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€	\$	3.663	3.965	\$ 39	0,00
	07.2024	\$	€	996.961	918.266	(12.809)	(0,16)
BPS	07.2024	€	\$	848.198	907.281	(1.775)	(0,02)
	07.2024	\$	€	853.915	788.764	(8.557)	(0,11)
	08.2024			903.625	843.593	1.814	0,02
BRC	07.2024	€	\$	1.221	1.307	(2)	0,00
CBK	07.2024			2.665	2.872	16	0,00
FAR	07.2024	\$	€	969.922	890.528	(15.498)	(0,20)
GLM	07.2024	€	\$	953	1.032	10	0,00
JPM	07.2024			8.456	9.049	(14)	0,00
MBC	07.2024			874.630	935.280	(2.105)	(0,03)
	07.2024	\$	€	237	220	0	0,00
	08.2024			932.674	870.956	2.133	0,03
MYI	07.2024	€	\$	1.318	1.414	1	0,00
RBC	07.2024			1.275	1.385	18	0,00
RYL	07.2024			1.193	1.276	(2)	0,00
SCX	07.2024			872.099	934.370	(302)	0,00
	08.2024	\$	€	934.370	870.822	294	0,00
SSB	07.2024			19.410	17.893	(233)	0,00
UAG	08.2024	€	\$	576	616	(2)	0,00
				\$ 4.396	\$ (41.370)	\$ (36.974)	(0,47)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£	\$	253.866	321.016	\$ 104	0,00
	07.2024	\$	£	653.191	512.572	(5.249)	(0,07)
	08.2024			321.050	253.851	(98)	0,00
BRC	07.2024			0	0	0	0,00
CBK	07.2024	£	\$	5.788	7.341	25	0,00
	07.2024	\$	£	10.654	8.372	(70)	0,00
	08.2024	£	\$	78	99	0	0,00
DUB	07.2024	\$	£	340.972	267.223	(3.175)	(0,04)
MBC	07.2024	£	\$	264.017	334.037	294	0,00
	07.2024	\$	£	4	3	0	0,00
	08.2024			333.236	263.342	(285)	0,00
RBC	07.2024	£	\$	264.502	335.415	1.058	0,01
	08.2024	\$	£	335.473	264.502	(1.055)	(0,01)
RYL	07.2024			1	1	0	0,00
				\$ 1.481	\$ (9.932)	\$ (8.451)	(0,11)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Administrative JPY (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	\$	¥	816	127.614	\$ (23)	0,00
MBC	07.2024	¥	\$	133.110	829	2	0,00
	07.2024	\$	¥	785	122.726	(22)	0,00
	08.2024			829	132.487	(2)	0,00
RBC	07.2024			724	113.312	(20)	0,00
SCX	08.2024			152	24.328	0	0,00
				\$ 2	\$ (67)	\$ (65)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional MXN (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	07.2024	\$	12.604	MXN	211.342	\$	(1.046)	(0,01)		
BRC	07.2024	MXN	213.385	\$	11.703		34	0,00		
	08.2024	\$	11.405	MXN	209.137		(21)	0,00		
CBK	07.2024	MXN	209.135	\$	11.470		33	0,00		
	07.2024	\$	12.643	MXN	211.931		(1.053)	(0,02)		
	08.2024		11.413		209.135		(30)	0,00		
GLM	08.2024		270		4.893		(4)	0,00		
MYI	08.2024		318		5.762		(5)	0,00		
SCX	07.2024	MXN	210.302	\$	11.550		49	0,00		
	08.2024	\$	11.492	MXN	210.302		(45)	0,00		
SSB	07.2024		12.608		211.342		(1.050)	(0,01)		
UAG	07.2024	MXN	1.792	\$	105		7	0,00		
						\$	123	(3.254)	(3.131)	(0,04)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BRC	07.2024	SEK	63.410	\$	5.983	\$	(5)	0,00		
	08.2024	\$	5.983	SEK	63.313		5	0,00		
CBK	07.2024		5.939		63.051		15	0,00		
DUB	07.2024	SEK	56.928	\$	5.379		3	0,00		
	08.2024	\$	5.379	SEK	56.841		(3)	0,00		
MBC	07.2024		5.759		60.478		(48)	0,00		
MYI	07.2024	SEK	63.637	\$	6.025		16	0,00		
	08.2024	\$	6.025	SEK	63.539		(16)	0,00		
RYL	07.2024		5.750		60.463		(41)	0,00		
						\$	39	(113)	(74)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	07.2024	SGD	36.161	\$	26.642	\$	(40)	0,00		
	07.2024	\$	24.015	SGD	32.414		(98)	0,00		
	08.2024		26.754		36.259		41	0,00		
BPS	07.2024	SGD	36.291	\$	26.759		(20)	0,00		
	07.2024	\$	425	SGD	574		(1)	0,00		
	08.2024		26.759		36.239		20	0,00		
BRC	07.2024		310		419		(1)	0,00		
CBK	07.2024	SGD	495	\$	367		2	0,00		
GLM	07.2024	\$	1.016	SGD	1.372		(4)	0,00		
JPM	07.2024	SGD	183	\$	136		1	0,00		
	07.2024	\$	25.763	SGD	34.676		(176)	(0,01)		
MBC	07.2024		988		1.334		(3)	0,00		
MYI	07.2024		14		19		0	0,00		
SCX	07.2024		26.084		35.147		(150)	0,00		
UAG	07.2024		280		379		(1)	0,00		
						\$	64	(494)	(430)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (27.205) (0,35)

Summe Anlagen

\$ 8.695.837 112,25

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (949.019) (12,25)

Nettovermögen

\$ 7.746.818 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(h) Mit dem Fonds verbunden.

(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,41 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Altice France S.A, 11,500 % fällig am 01.02.2027	20.12.2023	\$ 5.205	\$ 4.278	0,06
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	92	92	0,00
Corestate Capital Holding S.A.	22.08.2023	0	0	0,00
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	8.869	10.365	0,13
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2020 - 29.10.2021	16.083	6.863	0,09
		\$ 30.249	\$ 21.598	0,28

(k) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 74.318 USD (31. Dezember 2023: 51.497 USD) und Barmittel in Höhe von 8.466 USD (31. Dezember 2023: 35.459 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 29 USD (31. Dezember 2023: 2.346 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 141.889 USD (31. Dezember 2023: 146.278 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 30.042 USD (31. Dezember 2023: 29.812 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.974.052	\$ 60.884	\$ 7.034.936
Investmentfonds	766.224	0	0	766.224
Pensionsgeschäfte	0	907.070	0	907.070
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(556)	(12.223)	386	(12.393)
<b>Summen</b>	<b>\$ 765.668</b>	<b>\$ 7.868.899</b>	<b>\$ 61.270</b>	<b>\$ 8.695.837</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.229.045	\$ 51.448	\$ 6.280.493
Investmentfonds	470.418	269.108	0	739.526
Pensionsgeschäfte	0	1.221.471	0	1.221.471
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	5.332	83.997	434	89.763
<b>Summen</b>	<b>\$ 475.750</b>	<b>\$ 7.803.621</b>	<b>\$ 51.882</b>	<b>\$ 8.331.253</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,500 %	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (5.007)	\$ (5.367)	(0,07)
	3,000	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.778)	(2.982)	(0,04)
	5,300	26.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (9.520)	(9.697)	(0,13)
JML	0,500	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (8.193)	(8.783)	(0,11)
	2,750	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(1.704)	(1.829)	(0,02)
	3,000	11.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (888)	(894)	(0,01)
JPS	5,300	14.06.2024	02.08.2024	(11.803)	(11.832)	(0,15)
MEI	0,500	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (3.550)	(3.806)	(0,05)
MYI	0,250	18.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(7.831)	(8.394)	(0,11)
NOM	5,000	06.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (1.946)	(1.953)	(0,03)
	5,200	12.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(3.032)	(3.081)	(0,04)
	5,200	28.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(1.437)	(1.457)	(0,02)
SCX	5,300	04.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(3.722)	(3.737)	(0,05)
	5,300	27.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(6.418)	(6.421)	(0,08)
	5,200	08.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.315)	(2.332)	(0,03)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (72.565)</b>	<b>(0,94)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (87)	\$ 0	\$ (87)	\$ 576	\$ (650)	\$ (74)
BOA	(2.024)	2.110	86	(539)	420	(119)
BPS	(3.957)	3.830	(127)	(23.811)	26.170	2.359
BRC	537	(320)	217	7.734	(12.990)	(5.256)
CBK	(1.349)	1.240	(109)	104	0	104
DUB	(2.635)	2.450	(185)	(490)	280	(210)
FAR	(15.665)	16.590	925	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(1.702)	1.510	(192)	3.394	(3.020)	374
GST	(249)	182	(67)	(1.620)	1.522	(98)
JPM	271	(160)	111	(185)	0	(185)
MBC	400	(340)	60	10.556	(15.430)	(4.874)
MYC	(653)	600	(53)	(802)	790	(12)
MYI	540	(390)	150	(595)	630	35
RBC	91	0	91	23	0	23
RYL	(77)	0	(77)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	661	(590)	71	4.558	(5.960)	(1.402)
SSB	(1.283)	1.380	97	(1)	0	(1)
TOR	66	0	66	(41)	0	(41)
UAG	(90)	150	60	4.291	(3.950)	341

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	51,18	53,89
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	37,60	30,36
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,03	0,16
Investmentfonds	9,89	9,94
Pensionsgeschäfte	11,71	16,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,09	0,92
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,10	0,25
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,35)	0,04
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,94)	(0,67)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Albanien	0,04	0,24
Angola	0,19	0,20
Argentinien	0,77	0,69
Australien	0,12	0,12
Aserbaidschan	0,10	k. A.
Bermuda	1,15	1,14
Brasilien	0,42	0,07
Kanada	0,85	0,67
Cayman-Inseln	2,16	2,20
Chile	0,50	0,09
China	0,00	0,01
Kolumbien	0,74	0,78
Costa Rica	0,07	0,07
Zypern	0,12	0,11
Tschechische Republik	0,03	k. A.
Dänemark	0,17	0,19
Dominikanische Republik	0,38	0,52
Ecuador	0,40	0,39
Ägypten	0,63	0,56
El Salvador	0,23	k. A.
Finnland	0,06	0,06
Frankreich	2,24	2,38
Deutschland	1,97	2,31
Ghana	0,24	0,17
Guatemala	0,20	0,21
Guernsey, Kanalinseln	0,01	0,23
Hongkong	0,10	0,08
Ungarn	0,69	0,42
Indonesien	1,08	1,04
International	0,11	0,12
Irland	7,21	6,81
Insel Man	0,02	k. A.
Israel	0,21	0,09
Italien	3,18	3,37
Elfenbeinküste	0,20	0,17

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Japan	0,40	0,30
Jersey, Kanalinseln	0,48	1,16
Jordanien	0,05	0,05
Kasachstan	0,13	0,14
Kenia	0,12	k. A.
Luxemburg	1,63	2,73
Mazedonien	0,09	0,10
Mexiko	2,43	2,20
Multinational	0,12	0,18
Niederlande	2,67	2,79
Nigeria	0,43	0,48
Oman	0,28	0,30
Pakistan	0,08	k. A.
Panama	0,91	0,38
Paraguay	0,27	k. A.
Peru	0,73	0,51
Philippinen	0,02	0,03
Polen	0,14	k. A.
Portugal	0,17	0,18
Rumänien	0,86	0,69
Russland	0,03	0,10
Saudi-Arabien	0,77	0,86
Senegal	0,29	0,04
Serbien	0,27	0,23
Singapur	0,21	0,18
Slowenien	k. A.	0,21
Südafrika	0,32	0,36
Spanien	0,72	0,64
Sri Lanka	0,17	0,15
Supranational	0,82	k. A.
Schweden	0,03	0,46
Schweiz	0,40	0,36
Türkei	0,98	0,94
Ukraine	0,36	0,31
Vereinigte Arabische Emirate	0,26	0,15
Großbritannien	4,96	4,88
USA	41,41	36,27
Usbekistan	0,07	k. A.
Venezuela	0,07	0,07
Kurzfristige Instrumente	0,07	0,47
Investmentfonds	9,89	9,94
Pensionsgeschäfte	11,71	16,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,09	0,92
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,07	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,05	0,42
Zinsswaps	(0,02)	(0,16)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,03)	(0,06)
Devisenterminkontrakte	0,33	(0,42)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,64)	0,52
Sonstige Aktiva und Passiva	(12,25)	(11,98)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>ANGOLA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Angola Government International Bond			
8,000 % fällig am 26.11.2029	\$ 500	\$ 451	0,12
9,125 % fällig am 26.11.2049	400	329	0,09
Summe Angola		780	0,21
<b>ARGENTINIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Argentina Government International Bond			
3,500 % fällig am 09.07.2041	7.247	2.855	0,75
<b>AUSTRALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Santos Finance Ltd.			
6,875 % fällig am 19.09.2033	500	529	0,14
<b>ASERBAIDISCHAN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Southern Gas Corridor CJSC			
6,875 % fällig am 24.03.2026	400	403	0,11
<b>BERMUDA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Aircastle Ltd.			
2,850 % fällig am 26.01.2028	1.100	995	0,26
5,250 % fällig am 11.08.2025	1.250	1.241	0,33
Valaris Ltd.			
8,375 % fällig am 30.04.2030	300	311	0,08
Summe Bermuda		2.547	0,67
<b>BRASILIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco BTG Pactual S.A.			
6,250 % fällig am 08.04.2029	800	804	0,21
Banco do Brasil S.A.			
6,000 % fällig am 18.03.2031	400	392	0,10
		1.196	0,31
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Brazil Government International Bond			
7,125 % fällig am 13.05.2054	825	799	0,21
Summe Brasilien		1.995	0,52
<b>KANADA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Air Canada Pass-Through Trust			
5,250 % fällig am 01.10.2030	401	396	0,11
B.C. Unlimited Liability Co.			
4,375 % fällig am 15.01.2028	700	661	0,17
Bausch & Lomb Corp.			
8,375 % fällig am 01.10.2028	300	307	0,08
CI Financial Corp.			
7,500 % fällig am 30.05.2029	300	297	0,08
Fairfax Financial Holdings Ltd.			
2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 2.000	2.048	0,54
goeasy Ltd.			
9,250 % fällig am 01.12.2028	\$ 400	425	0,11
Open Text Corp.			
3,875 % fällig am 15.02.2028	700	649	0,17
Summe Kanada		4.783	1,26
<b>CAYMAN INSELN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
CIFC Funding Ltd.			
6,565 % fällig am 24.04.2031	819	820	0,22
6,635 % fällig am 24.04.2030	1.275	1.277	0,34
Golub Capital Partners CLO Ltd.			
6,641 % fällig am 25.10.2034	1.000	1.000	0,26

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Vibrant CLO Ltd.			
6,626 % fällig am 15.09.2030	\$ 93	\$ 93	0,02
		3.190	0,84
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
Sunac China Holdings Ltd.			
1,000 % fällig am 30.09.2032	512	33	0,01
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2,125 % fällig am 21.02.2026	500	470	0,12
2,528 % fällig am 18.11.2027	1.627	1.464	0,39
Gaci First Investment Co.			
4,750 % fällig am 14.02.2030	2.000	1.947	0,51
5,125 % fällig am 14.02.2053	800	693	0,18
Kaisa Group Holdings Ltd.			
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	1.100	40	0,01
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	3.000	101	0,03
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^	2.200	80	0,02
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^	400	15	0,00
11,250 % fällig am 16.04.2025 ^	1.500	54	0,02
11,650 % fällig am 01.06.2026 ^	1.000	36	0,01
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	400	14	0,00
Lima Metro Line Finance Ltd.			
5,875 % fällig am 05.07.2034	386	381	0,10
Melco Resorts Finance Ltd.			
4,875 % fällig am 06.06.2025	700	686	0,18
Sands China Ltd.			
3,250 % fällig am 08.08.2031	425	358	0,09
Seagate HDD Cayman			
4,125 % fällig am 15.01.2031	325	291	0,08
9,625 % fällig am 01.12.2032	460	525	0,14
Spirit Loyalty Cayman Ltd.			
8,000 % fällig am 20.09.2025	300	220	0,06
Trafford Centre Finance Ltd.			
6,077 % fällig am 28.07.2038	£ 300	302	0,08
		7.677	2,02
Summe Cayman Inseln		10.900	2,87
<b>CHILE</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Chile Government International Bond			
4,850 % fällig am 22.01.2029	\$ 1.000	990	0,26
<b>CHINA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Yango Justice International Ltd.			
7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	2.600	14	0,01
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^	1.900	10	0,00
7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	1.900	10	0,00
Summe China		34	0,01
<b>KOLUMBIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Colombia Government International Bond			
5,000 % fällig am 15.06.2045	2.475	1.746	0,46
8,000 % fällig am 14.11.2035	400	412	0,11
Summe Kolumbien		2.158	0,57
<b>COSTA RICA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Costa Rica Government International Bond			
7,300 % fällig am 13.11.2054	300	315	0,08
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
EPH Financing International A/S			
5,875 % fällig am 30.11.2029	€ 300	323	0,08
<b>DÄNEMARK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
TDC Net A/S			
5,056 % fällig am 31.05.2028	800	875	0,23

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Dominican Republic Government International Bond			
6,500 % fällig am 15.02.2048	\$ 1.500	\$ 1.424	0,37
<b>ECUADOR</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ecuador Government International Bond			
0,000 % fällig am 31.07.2030 (d)	1.416	681	0,18
6,000 % fällig am 31.07.2030	989	629	0,16
Summe Ecuador		1.310	0,34
<b>ÄGYPTEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Egypt Government International Bond			
6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 850	724	0,19
7,500 % fällig am 16.02.2061	\$ 2.400	1.614	0,42
Summe Ägypten		2.338	0,61
<b>EL SALVADOR</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
El Salvador Government International Bond			
0,250 % fällig am 17.04.2030	500	15	0,00
7,650 % fällig am 15.06.2035	500	364	0,10
9,250 % fällig am 17.04.2030	500	446	0,12
Summe El Salvador		825	0,22
<b>FINNLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Balder Finland Oyj			
1,375 % fällig am 24.05.2030	€ 200	171	0,05
2,000 % fällig am 18.01.2031	100	87	0,02
Summe Finnland		258	0,07
<b>FRANKREICH</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Altice France S.A.			
4,000 % fällig am 15.07.2029	800	571	0,15
4,250 % fällig am 15.10.2029	600	429	0,11
BNP Paribas S.A.			
1,904 % fällig am 30.09.2028	\$ 1.725	1.541	0,40
BPCE S.A.			
5,936 % fällig am 30.05.2035	600	598	0,16
Electricite de France S.A.			
6,000 % fällig am 22.04.2064	300	279	0,07
9,125 % fällig am 15.03.2033 (g)	900	981	0,26
Eramet S.A.			
6,500 % fällig am 30.11.2029	€ 400	431	0,11
TDF Infrastructure SASU			
1,750 % fällig am 01.12.2029	1.800	1.697	0,45
Ubisoft Entertainment S.A.			
0,878 % fällig am 24.11.2027	400	371	0,10
Summe Frankreich		6.898	1,81
<b>DEUTSCHLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Deutsche Bank AG			
5,882 % fällig am 08.07.2031	\$ 1.100	1.079	0,29
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)			
3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	€ 1.550	1.639	0,43
INEOS Styrolution Ludwigshafen GmbH			
2,250 % fällig am 16.01.2027	1.350	1.360	0,36
ZF Finance GmbH			
2,750 % fällig am 25.05.2027	1.200	1.225	0,32
		5.303	1,40
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN</b>			
SCUR-Alpha 1503 GmbH			
10,830 % fällig am 29.03.2030	\$ 494	468	0,12
Summe Deutschland		5.771	1,52

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>GHANA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ghana Government International Bond 7,750 % fällig am 07.04.2029 ^ (k)	\$ 800	\$ 410	0,11
8,125 % fällig am 26.03.2032 ^	400	206	0,05
8,950 % fällig am 26.03.2051 ^	500	257	0,07
Summe Ghana		873	0,23

<b>GUATEMALA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Guatemala Government International Bond 7,050 % fällig am 04.10.2032	800	841	0,22

<b>HONGKONG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 600	585	0,15

<b>UNGARN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Hungary Government International Bond 4,000 % fällig am 25.07.2029	800	851	0,22
5,375 % fällig am 12.09.2033	1.400	1.560	0,41
Magyar Export-Import Bank 6,000 % fällig am 16.05.2029	500	564	0,15
Summe Ungarn		2.975	0,78

<b>INDONESIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Pertamina Persero PT 6,500 % fällig am 07.11.2048	\$ 1.700	1.815	0,47
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 1,875 % fällig am 05.11.2031	€ 500	448	0,12
6,150 % fällig am 21.05.2048	\$ 1.000	988	0,26
Summe Indonesien		3.251	0,85

<b>IRLAND</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Aurium CLO DAC 4,630 % fällig am 22.06.2034	€ 2.000	2.142	0,56
4,653 % fällig am 16.01.2031	299	320	0,09
Bain Capital Euro CLO DAC 4,637 % fällig am 20.01.2032	1.884	2.010	0,53
Barings Euro CLO DAC 4,862 % fällig am 25.07.2035	1.000	1.070	0,28
Cumulus Static CLO DAC 5,025 % fällig am 15.11.2033	2.000	2.142	0,56
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,797 % fällig am 20.01.2032	182	195	0,05
Harvest CLO DAC 4,756 % fällig am 15.01.2032	2.500	2.674	0,70
Laurelin DAC 4,617 % fällig am 20.10.2031	634	680	0,18
Rockford Tower Europe CLO DAC 5,220 % fällig am 24.04.2037	2.000	2.145	0,56
SCF Rahoituspalvelut DAC 4,364 % fällig am 25.06.2034	300	322	0,09
Sculptor European CLO DAC 4,696 % fällig am 14.01.2032	787	844	0,22
Toro European CLO DAC 4,638 % fällig am 15.02.2034	750	805	0,21
4,832 % fällig am 12.01.2032	300	321	0,09
		15.670	4,12

<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC 2,700 % fällig am 11.06.2023 ^	2.800	450	0,12
Iridium Capital PLC 9,250 % fällig am 18.06.2029	900	973	0,26
		1.423	0,38

<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN</b>			
Beschreibung	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Setanta Aircraft Leasing DAC 7,346 % fällig am 05.11.2028	\$ 800	\$ 806	0,21
Summe Irland		17.899	4,71

<b>INSEL MAN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AngloGold Ashanti Holdings PLC 3,750 % fällig am 01.10.2030	200	175	0,05

<b>ISRAEL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 400	436	0,11
5,375 % fällig am 12.03.2029	\$ 600	589	0,16
Summe Israel		1.025	0,27

<b>ITALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % fällig am 28.04.2025	€ 900	949	0,25
8,000 % fällig am 22.01.2030	1.450	1.572	0,41
Eni SpA 5,950 % fällig am 15.05.2054	\$ 400	393	0,10
Intesa Sanpaolo SpA 5,148 % fällig am 10.06.2030	€ 100	117	0,03
5,500 % fällig am 01.03.2028 (g)(i)	€ 750	770	0,20
Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	3.375	3.323	0,88
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	2.600	2.524	0,67
Telecom Italia SpA 7,875 % fällig am 31.07.2028	400	468	0,12
UniCredit SpA 7,296 % fällig am 02.04.2034	\$ 625	638	0,17
Summe Italien		10.754	2,83

<b>ELFENBEINKÜSTE</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ivory Coast Government International Bond 5,750 % fällig am 31.12.2032	1.826	1.704	0,45
7,625 % fällig am 30.01.2033	450	438	0,11
Summe Elfenbeinküste		2.142	0,56

<b>JAPAN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	1.500	1.433	0,38
SoftBank Group Corp. 5,375 % fällig am 08.01.2029 (a)	€ 300	320	0,08
Summe Japan		1.753	0,46

<b>JERSEY, KANALINSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AA Bond Co. Ltd. 5,500 % fällig am 31.07.2050	£ 1.575	1.944	0,51
Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 15.08.2024	€ 45	48	0,01
Summe Jersey, Kanalinseln		1.992	0,52

<b>KASACHSTAN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
KazMunayGas National Co. JSC 5,375 % fällig am 24.04.2030	\$ 200	195	0,05
5,750 % fällig am 19.04.2047	200	175	0,05
6,375 % fällig am 24.10.2048	400	377	0,10
Summe Kasachstan		747	0,20

<b>KENIA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Republic of Kenya Government International Bond 9,750 % fällig am 16.02.2031	500	480	0,13

<b>LUXEMBURG</b>			
<b>STAMMAKTIVEN</b>			
ADLER Group S.A. (c)	1.725	\$ 0	0,00
Corestate Capital Holding S.A. (c)(j)	210.984	0	0,00
DrillCo Holding Lux S.A. (c)(j)	61.666	1.442	0,38
Foresea Holding S.A. 'A' (c)	130	3	0,00
Intelsat Emergence S.A. (j)	14.429	537	0,14
Summe Stammaktien	\$ 1.982	0,52	

<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 800	713	0,19
Chile Electricity Lux MPC SARL 6,010 % fällig am 20.01.2033	1.000	1.013	0,27
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)	145	120	0,03
3,000 % fällig am 31.12.2026 (b)			
Corestate Capital Holding S.A. (10,000% Cash or 11,000% PIK) 10,000 % fällig am 31.12.2026 (b)	€ 105	101	0,03
Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	400	412	0,11
FORESEA Holding S.A. 7,500 % fällig am 15.06.2030	\$ 638	594	0,15
Greensaif Pipelines Bidco SARL 6,129 % fällig am 23.02.2038	725	738	0,19
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	1.072	1.000	0,26
Logicor Financing SARL 3,250 % fällig am 13.11.2028	€ 1.000	1.018	0,27
Tierra Mojada Luxembourg SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040	\$ 1.227	1.108	0,29
		6.817	1,79

<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN</b>			
Albion Financing SARL 9,147 % fällig am 17.08.2026	€ 1.000	1.076	0,29
Summe Luxemburg		9.875	2,60

<b>MAZEDONIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
North Macedonia Government International Bond 2,750 % fällig am 18.01.2025	300	317	0,08

<b>MEXIKO</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Petroleos Mexicanos 5,625 % fällig am 23.01.2046	\$ 1.416	856	0,22
6,750 % fällig am 21.09.2047	3.700	2.436	0,64
7,690 % fällig am 23.01.2050	934	676	0,18
		3.968	1,04

<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031 (f) MXN	1.951	90	0,02
3,771 % fällig am 24.05.2061	\$ 1.600	984	0,26
4,000 % fällig am 24.08.2034 (f) MXN	22.759	1.114	0,29
4,490 % fällig am 25.05.2032	€ 400	424	0,11
4,500 % fällig am 31.01.2050	\$ 600	452	0,12
5,400 % fällig am 09.02.2028	1.850	1.848	0,49
6,000 % fällig am 07.05.2036	1.600	1.562	0,41
6,400 % fällig am 07.05.2054	300	286	0,08
		6.760	1,78
Summe Mexiko		10.728	2,82

<b>NIEDERLANDE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
ASR Nederland NV 7,000 % fällig am 07.12.2043	€ 100	121	0,03

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>			
Athora Netherlands NV				Republic of Poland Government International Bond				<b>SUPRANATIONAL</b>			
7,000 % fällig am 19.06.2025 (g)(i) €	200	\$ 215	0,06	5,125 % fällig am 18.09.2034	\$ 600	\$ 591	0,16	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Boels Topholding BV				5,500 % fällig am 18.03.2054	400	389	0,10	Europäische Union			
5,750 % fällig am 15.05.2030	400	437	0,11	Summe Polen		1.624	0,43	3,000 % fällig am 04.12.2034	€ 2.100	\$ 2.219	0,59
Imperial Brands Finance Netherlands BV								3,375 % fällig am 04.10.2039	900	960	0,25
1,750 % fällig am 18.03.2033	400	347	0,09					Summe Supranational		3.179	0,84
ING Groep NV				<b>RUMÄNIEN</b>				<b>SCHWEIZ</b>			
7,086 % fällig am 16.04.2025 (g)(i) \$	1.300	1.290	0,34	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
IPD BV				Romania Government International Bond				UBS Group AG			
3,375 % fällig am 15.06.2031	€ 450	482	0,13	2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 600	483	0,13	4,282 % fällig am 09.01.2028	\$ 700	671	0,18
NE Property BV				2,875 % fällig am 13.04.2042	600	419	0,11	5,617 % fällig am 13.09.2030	800	804	0,21
3,375 % fällig am 14.07.2027	1.500	1.564	0,41	5,000 % fällig am 27.09.2026	600	657	0,17	Summe Schweiz		1.475	0,39
NN Group NV				5,250 % fällig am 30.05.2032	700	731	0,19				
4,500 % fällig am 15.01.2026 (g)	1.100	1.179	0,31	5,375 % fällig am 22.03.2031	600	639	0,17				
Q-Park Holding BV				6,375 % fällig am 18.09.2033	600	669	0,18				
3,500 % fällig am 01.02.2025	1.600	1.713	0,45	Summe Rumänien		3.598	0,95				
Sandoz Finance BV				<b>SAUDI-ARABIEN</b>				<b>TÜRKEI</b>			
4,220 % fällig am 17.04.2030	400	438	0,12	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Yinson Boronia Production BV				Saudi Arabia Government International Bond				Türkiye Varlik Fonu Yonetimi A/S			
8,947 % fällig am 31.07.2042	\$ 500	505	0,13	3,450 % fällig am 02.02.2061	\$ 1.400	919	0,24	8,250 % fällig am 14.02.2029	300	305	0,08
ZF Europe Finance BV				4,500 % fällig am 26.10.2046	1.200	1.018	0,27	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
2,000 % fällig am 23.02.2026	€ 100	103	0,03	4,875 % fällig am 18.07.2033	1.500	1.466	0,38	Turkey Government International Bond			
Summe Niederlande		8.394	2,21	Summe Saudi-Arabien		3.403	0,89	4,875 % fällig am 16.04.2043	1.200	852	0,22
								5,750 % fällig am 11.05.2047	3.000	2.308	0,61
				<b>SENEGAL</b>				5,875 % fällig am 21.05.2030	€ 800	859	0,23
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Türkei		4.019	1,06
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Senegal Government International Bond						4.324	1,14
Domi BV				4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 200	198	0,05	<b>UKRAINE</b>			
4,419 % fällig am 15.06.2056	500	537	0,14	5,375 % fällig am 08.06.2037	400	313	0,08	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Summe Niederlande		8.931	2,35	7,750 % fällig am 10.06.2031	\$ 600	572	0,15	NPC Ukrenergo			
				Summe Senegal		1.083	0,28	6,875 % fällig am 09.11.2028	\$ 800	294	0,08
<b>NIGERIA</b>				<b>SERBIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Ukraine Government International Bond			
Nigeria Government International Bond				Serbia Government International Bond				4,375 % fällig am 27.01.2032	€ 4.400	1.231	0,32
7,696 % fällig am 23.02.2038	\$ 400	311	0,08	6,500 % fällig am 26.09.2033 (k)	1.000	1.016	0,27	6,750 % fällig am 20.06.2028	200	61	0,02
7,875 % fällig am 16.02.2032	1.400	1.212	0,32	<b>SINGAPUR</b>				8,994 % fällig am 01.02.2026	\$ 300	99	0,02
Summe Nigeria		1.523	0,40	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Ukraine		1.391	0,36
				Yinson Production Financial Services Pte Ltd.						1.685	0,44
<b>OMAN</b>				9,625 % fällig am 03.05.2029	200	200	0,05	<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>SÜDAFRIKA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Oman Government International Bond				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC			
6,750 % fällig am 17.01.2048	1.000	1.020	0,27	Sasol Financing USA LLC				5,500 % fällig am 08.05.2034	600	617	0,16
				6,500 % fällig am 27.09.2028	600	573	0,15	DAE Sukuk Dfc Ltd.			
<b>PAKISTAN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				3,750 % fällig am 15.02.2026	900	868	0,23
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				South Africa Government International Bond				Summe Vereinigte Arabische Emirate		1.485	0,39
Pakistan Government International Bond				5,650 % fällig am 27.09.2047	550	416	0,11	<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
6,000 % fällig am 08.04.2026	200	181	0,05	Summe Südafrika		989	0,26	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
7,375 % fällig am 08.04.2031	200	158	0,04	<b>SPANIEN</b>				AGPS BondCo PLC			
Summe Pakistan		339	0,09	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,625 % fällig am 14.01.2026	€ 100	35	0,01
				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				5,000 % fällig am 27.04.2027	500	175	0,05
<b>PANAMA</b>				6,000 % fällig am 15.01.2026 (g)(i) €	800	855	0,22	5,500 % fällig am 13.11.2026	500	176	0,05
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				CaixaBank S.A.				Barclays PLC			
Panama Government International Bond				6,037 % fällig am 15.06.2035	\$ 300	301	0,08	5,690 % fällig am 12.03.2030	\$ 800	802	0,21
6,400 % fällig am 14.02.2035	600	570	0,15	Cellnex Finance Co. S.A.				Greene King Finance PLC			
6,853 % fällig am 28.03.2054	1.550	1.423	0,37	3,875 % fällig am 07.07.2041	700	553	0,15	5,106 % fällig am 15.03.2034	£ 247	300	0,08
7,500 % fällig am 01.03.2031	325	340	0,09	Lorca Telecom Bondco S.A.				HSBC Holdings PLC			
Summe Panama		2.333	0,61	4,000 % fällig am 18.09.2027	€ 300	314	0,08	2,804 % fällig am 24.05.2032	\$ 300	251	0,07
				5,750 % fällig am 30.04.2029	300	330	0,09	2,848 % fällig am 04.06.2031	200	173	0,05
<b>PERU</b>				Summe Spanien		2.353	0,62	3,973 % fällig am 22.05.2030	600	561	0,15
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>SRI LANKA</b>				4,041 % fällig am 13.03.2028	300	289	0,08
Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				5,210 % fällig am 11.08.2028	325	323	0,08
10,100 % fällig am 15.12.2043	PEN 3.900	1.043	0,28	Sri Lanka Government International Bond				John Lewis PLC			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	\$ 525	305	0,08	4,250 % fällig am 18.12.2034	£ 400	389	0,10
Peru Government International Bond				7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	600	357	0,09	6,125 % fällig am 21.01.2025	300	380	0,10
6,150 % fällig am 12.08.2032	2.600	655	0,17	Summe Sri Lanka		662	0,17	Lloyds Banking Group PLC			
8,750 % fällig am 21.11.2033	\$ 1.000	1.221	0,32					4,976 % fällig am 11.08.2033	\$ 400	382	0,10
Summe Peru		2.919	0,77					Market Bidco Finco PLC			
								4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 500	510	0,13
<b>POLEN</b>								Mitchells & Butlers Finance PLC			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								5,802 % fällig am 15.12.2030	£ 162	194	0,05
Bank Gospodarstwa Krajowego								6,084 % fällig am 15.12.2030	\$ 648	607	0,16
4,000 % fällig am 13.03.2032	€ 600	644	0,17								



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Elevance Health, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2033	\$ 600	\$ 580	0,15	NextEra Energy Operating Partners LP 7,250 % fällig am 15.01.2029	\$ 400	\$ 410	0,11	3,450 % fällig am 07.01.2030	\$	131	\$ 0,03
Encore Capital Group, Inc. 9,250 % fällig am 01.04.2029	400	417	0,11	NGPL PipeCo LLC 7,768 % fällig am 15.12.2037	1.400	1.617	0,43	3,500 % fällig am 01.09.2031	147	136	0,04
Energy Transfer LP 7,500 % fällig am 01.07.2038	1.325	1.510	0,40	Noble Finance LLC 8,000 % fällig am 15.04.2030	450	469	0,12	5,875 % fällig am 15.04.2029	1.818	1.825	0,48
EnLink Midstream LLC 5,375 % fällig am 01.06.2029	400	391	0,10	NuStar Logistics LP 5,625 % fällig am 28.04.2027	600	595	0,16	Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030	1.000	1.016	0,27
EQT Corp. 3,625 % fällig am 15.05.2031	400	353	0,09	Occidental Petroleum Corp. 7,875 % fällig am 15.09.2031	850	954	0,25	Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	1.800	1.856	0,49
Esab Corp. 6,250 % fällig am 15.04.2029	425	428	0,11	Olympus Water U.S. Holding Corp. 7,250 % fällig am 15.06.2031	400	398	0,10	Verizon Communications, Inc. 2,355 % fällig am 15.03.2032	1.500	1.227	0,32
Ford Motor Credit Co. LLC 2,330 % fällig am 25.11.2025	€ 500	524	0,14	OneMain Finance Corp. 7,500 % fällig am 15.05.2031	500	506	0,13	VFH Parent LLC 7,500 % fällig am 15.06.2031	200	201	0,05
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 5,500 % fällig am 01.05.2028	\$ 1.400	1.359	0,36	9,000 % fällig am 15.01.2029	500	528	0,14	VICI Properties LP 3,500 % fällig am 15.02.2025	200	197	0,05
7,000 % fällig am 01.05.2031	425	435	0,11	Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 1.400	1.415	0,37	3,875 % fällig am 15.02.2029	250	231	0,06
Freedom Mortgage Corp. 6,625 % fällig am 15.01.2027	1.100	1.063	0,28	4,125 % fällig am 30.04.2028	\$ 500	465	0,12	4,500 % fällig am 15.01.2028	250	241	0,06
Frontier Communications Holdings LLC 5,875 % fällig am 15.10.2027	100	98	0,03	Pacific Gas & Electric Co. 3,300 % fällig am 01.08.2040	1.800	1.283	0,34	Vital Energy, Inc. 7,875 % fällig am 15.04.2032	400	407	0,11
Global Atlantic Fin Co. 4,400 % fällig am 15.10.2029	1.000	932	0,25	3,750 % fällig am 01.07.2028	200	188	0,05	Walgreens Boots Alliance, Inc. 3,600 % fällig am 20.11.2025	€ 300	366	0,10
GLP Capital LP 5,750 % fällig am 01.06.2028	300	300	0,08	4,500 % fällig am 01.07.2040	850	701	0,18	Wand NewCo, Inc. 7,625 % fällig am 30.01.2032	\$ 400	413	0,11
GN Bondco LLC 9,500 % fällig am 15.10.2031	500	466	0,12	4,600 % fällig am 15.06.2043	200	163	0,04	Wells Fargo & Co. 5,574 % fällig am 25.07.2029	850	858	0,23
Goldman Sachs Group, Inc. 2,815 % fällig am 22.04.2032	700	589	0,15	4,650 % fällig am 01.08.2028	300	291	0,08	WMG Acquisition Corp. 3,000 % fällig am 15.02.2031	1.100	949	0,25
5,727 % fällig am 25.04.2030	100	102	0,03	Panther Escrow Issuer LLC 7,125 % fällig am 01.06.2031	600	607	0,16	Wynn Resorts Finance LLC 7,125 % fällig am 15.02.2031	300	311	0,08
Gray Television, Inc. 4,750 % fällig am 15.10.2030	200	120	0,03	Paramount Global 4,200 % fällig am 19.05.2032	300	245	0,06	XPO, Inc. 6,250 % fällig am 01.06.2028	500	502	0,13
HAT Holdings LLC 8,000 % fällig am 15.06.2027	500	520	0,14	PennyMac Financial Services, Inc. 7,125 % fällig am 15.11.2030	600	599	0,16			75.679	19,90
HCA, Inc. 5,500 % fällig am 01.06.2033	1.000	992	0,26	Phinia, Inc. 6,750 % fällig am 15.04.2029	425	432	0,11	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN</b>			
Howard Midstream Energy Partners LLC 7,375 % fällig am 15.07.2032	250	254	0,07	Plains All American Pipeline LP 5,150 % fällig am 01.06.2042	850	754	0,20	Broadcom, Inc. TBD % fällig am 15.08.2025	350	348	0,09
IQVIA, Inc. 5,700 % fällig am 15.05.2028	600	607	0,16	PRA Group, Inc. 8,375 % fällig am 01.02.2028	700	698	0,18	TBD % fällig am 14.08.2026	350	348	0,09
Jane Street Group 7,125 % fällig am 30.04.2031	650	667	0,18	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	416	422	0,11	Caesars Entertainment, Inc. 8,097 % fällig am 06.02.2031	400	401	0,11
JPMorgan Chase & Co. 4,586 % fällig am 26.04.2033	1.000	954	0,25	Rivian Holdings LLC 11,310 % fällig am 15.10.2026	500	507	0,13	Charter Communications Operating LLC 7,052 % fällig am 01.02.2027	2.305	2.305	0,61
Kinder Morgan Energy Partners LP 6,500 % fällig am 01.02.2037	400	420	0,11	RLJ Lodging Trust LP 3,750 % fällig am 01.07.2026	200	190	0,05	Cotiviti Corp. 8,579 % fällig am 01.05.2031	998	995	0,26
6,950 % fällig am 15.01.2038	200	217	0,06	Rockies Express Pipeline LLC 4,800 % fällig am 15.05.2030	700	647	0,17	DirecTV Financing LLC 10,708 % fällig am 02.08.2029	382	381	0,10
Las Vegas Sands Corp. 3,500 % fällig am 18.08.2026	600	573	0,15	4,950 % fällig am 15.07.2029	300	283	0,07	Fortress Intermediate, Inc. TBD % fällig am 27.06.2031	400	401	0,11
3,900 % fällig am 08.08.2029	300	275	0,07	Sammons Financial Group, Inc. 6,875 % fällig am 15.04.2034	500	513	0,13	Global Medical Response, Inc. TBD % fällig am 31.10.2028	100	97	0,03
LifePoint Health, Inc. 11,000 % fällig am 15.10.2030	600	662	0,17	San Diego Gas & Electric Co. 4,950 % fällig am 15.08.2028	600	597	0,16	Lumen Technologies, Inc. 7,808 % fällig am 15.04.2030	0	0	0,00
Marvell Technology, Inc. 5,750 % fällig am 15.02.2029	500	511	0,13	Sirius XM Radio, Inc. 4,125 % fällig am 01.07.2030	400	342	0,09	Modena Buyer LLC TBD % fällig am 18.04.2031	400	391	0,10
Medline Borrower LP 3,875 % fällig am 01.04.2029	500	461	0,12	Sitio Royalties Operating Partnership LP 7,875 % fällig am 01.11.2028	450	466	0,12	SS&C Technologies, Inc. 7,345 % fällig am 09.05.2031	600	602	0,16
5,250 % fällig am 01.10.2029	200	191	0,05	Southern California Edison Co. 4,000 % fällig am 01.04.2047	200	153	0,04	Standard Industries, Inc. 7,344 % fällig am 22.09.2028	545	547	0,14
Miter Brands Acquisition Holdco, Inc. 6,750 % fällig am 01.04.2032	400	403	0,11	Spirit AeroSystems, Inc. 9,375 % fällig am 30.11.2029	100	108	0,03	Station Casinos LLC 7,594 % fällig am 14.03.2031	399	399	0,10
Morgan Stanley 5,250 % fällig am 21.04.2034	700	689	0,18	9,750 % fällig am 15.11.2030	400	442	0,12	TransDigm, Inc. 8,595 % fällig am 28.02.2031	418	419	0,11
MPH Acquisition Holdings LLC 5,500 % fällig am 01.09.2028	100	76	0,02	Spirit Airlines Pass-Through Trust 3,375 % fällig am 15.08.2031	471	416	0,11	Triton Water Holdings, Inc. 9,345 % fällig am 31.03.2028	499	501	0,13
National Fuel Gas Co. 5,200 % fällig am 15.07.2025	200	199	0,05	Sprint Capital Corp. 6,875 % fällig am 15.11.2028	485	514	0,14			8.135	2,14
Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 7,125 % fällig am 01.02.2032	500	503	0,13	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 1.800	1.827	0,48	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
NCR Atleos Corp. 9,500 % fällig am 01.04.2029	100	108	0,03	T-Mobile USA, Inc. 2,550 % fällig am 15.02.2031	\$ 400	340	0,09	Banc of America Alternative Loan Trust 5,860 % fällig am 25.01.2037	75	56	0,01
Netflix, Inc. 4,875 % fällig am 15.06.2030	1.400	1.378	0,36	4,950 % fällig am 15.03.2028	500	497	0,13	Banc of America Funding Trust 5,020 % fällig am 20.01.2047	35	29	0,01
New Fortress Energy, Inc. 8,750 % fällig am 15.03.2029	300	274	0,07	Tallgrass Energy Partners LP 5,500 % fällig am 15.01.2028	500	479	0,13	BCAP LLC Trust 6,250 % fällig am 26.08.2036	1.896	784	0,21
Newmark Group, Inc. 7,500 % fällig am 12.01.2029	400	412	0,11	U.S. Airways Pass-Through Trust 3,950 % fällig am 15.05.2027	139	136	0,04	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 7,660 % fällig am 25.02.2036	82	69	0,02
				UKG, Inc. 6,875 % fällig am 01.02.2031	1.000	1.013	0,27	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 4,284 % fällig am 25.10.2046	18	16	0,00
				United Airlines Pass-Through Trust 2,900 % fällig am 01.11.2029	80	72	0,02	7,780 % fällig am 25.10.2035	56	54	0,01
				3,450 % fällig am 01.06.2029	123	116	0,03				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Countrywide Alternative Loan Trust				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				<b>VENEZUELA</b>			
5,860 % fällig am 25.07.2036	\$ 3	\$ 1	0,00	5,900 % fällig am 25.06.2037	\$ 169	\$ 134	0,04	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
5,873 % fällig am 20.05.2046	257	215	0,06	Structured Asset Mortgage Investments Trust				Petroleos de Venezuela S.A.			
5,960 % fällig am 25.04.2036	536	212	0,06	5,860 % fällig am 25.05.2036	403	312	0,08	6,000 % fällig am 16.05.2024	\$ 1.600	\$ 200	0,05
6,000 % fällig am 25.05.2036	132	67	0,02	5,880 % fällig am 25.09.2047	483	395	0,10	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
6,000 % fällig am 25.02.2037	850	339	0,09	SunTrust Alternative Loan Trust				Venezuela Government International Bond			
6,000 % fällig am 25.04.2037	192	102	0,03	5,750 % fällig am 25.12.2035	1	1	0,00	6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	241	35	0,01
6,633 % fällig am 25.01.2036	9	9	0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust				7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	1.528	229	0,06
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				6,710 % fällig am 25.06.2037	9	8	0,00	7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	1.900	289	0,08
4,483 % fällig am 25.03.2037	8	6	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				<b>Summe Venezuela</b>		<b>753</b>	<b>0,20</b>
6,000 % fällig am 25.12.2036	334	134	0,04	6,353 % fällig am 25.11.2042	5	4	0,00	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
6,000 % fällig am 25.07.2037	65	22	0,01	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
6,000 % fällig am 25.04.2046	1.715	493	0,13	4,048 % fällig am 25.09.2036	123	33	0,01	TER Finance Jersey Ltd.			
6,113 % fällig am 25.04.2046	17	5	0,00	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				7,020 % fällig am 02.01.2025 (d)(e)	200	193	0,05
6,500 % fällig am 25.11.2036	98	31	0,01	Uniform Mortgage-Backed Security				<b>Summe kurzfristige Instrumente</b>		<b>193</b>	<b>0,05</b>
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				5,500 % fällig am 01.12.2052	888	878	0,23	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>	<b>\$ 360.586</b>	<b>94,80</b>	
6,500 % fällig am 25.04.2033	0	0	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				<b>AKTIEN</b>			
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				4,500 % fällig am 01.08.2054	1.700	1.603	0,42	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
3,500 % fällig am 26.04.2038	72	69	0,02	5,000 % fällig am 01.08.2054	8.100	7.828	2,06	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
4,916 % fällig am 27.09.2035	85	72	0,02	5,500 % fällig am 01.08.2054	12.000	11.835	3,11	PIMCO Funds: Global Investors			
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				6,000 % fällig am 01.08.2054	12.000	12.029	3,17	Series plc - US Short-Term			
5,968 % fällig am 25.09.2035	11	10	0,00	6,500 % fällig am 01.08.2054	23.000	23.397	6,15	Fund (h)	2.761.254	28.137	7,40
HarborView Mortgage Loan Trust				<b>US-SCHATZOBBLIGATIONEN</b>				PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
5,893 % fällig am 19.05.2035	138	128	0,03	U.S. Treasury Bonds				US Dollar Short-Term			
5,933 % fällig am 19.06.2035	3	2	0,00	3,875 % fällig am 15.05.2043	4.100	3.700	0,97	Floating NAV Fund (h)	918.273	9.151	2,40
5,993 % fällig am 20.10.2045	270	236	0,06	4,375 % fällig am 15.08.2043	2.900	2.800	0,74	<b>Summe Investmentfonds</b>	<b>\$ 37.846</b>	<b>9,95</b>	
6,073 % fällig am 19.11.2035	3	2	0,00	4,750 % fällig am 15.11.2043	3.000	3.041	0,80	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
HSI Asset Securitization Corp. Trust				<b>US-BEKISTAN</b>				PIMCO ETFs plc - PIMCO			
5,900 % fällig am 25.11.2035	1.334	1.204	0,32	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				US Dollar Short Maturity			
IndyMac Mortgage Loan Trust				Republic of Uzbekistan International Bond				UCITS ETF (h)	5.570	558	0,15
3,285 % fällig am 25.06.2037	10	8	0,00	5,375 % fällig am 29.05.2027	€ 300	321	0,08	<b>Summe Investmentfonds</b>	<b>\$ 37.846</b>	<b>9,95</b>	
4,246 % fällig am 25.12.2036	2	1	0,00	<b>Summe USA</b>		<b>181.542</b>	<b>47,73</b>				
5,820 % fällig am 25.07.2047	52	33	0,01	<b>USBEKISTAN</b>							
Lehman Mortgage Trust				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
6,000 % fällig am 25.09.2037	78	71	0,02	Republic of Uzbekistan International Bond							
Luminent Mortgage Trust				5,375 % fällig am 29.05.2027	€ 300	321	0,08				
5,860 % fällig am 25.10.2046	628	543	0,14	<b>Summe</b>		<b>181.542</b>	<b>47,73</b>				
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust											
5,016 % fällig am 25.05.2036	3	2	0,00								
6,120 % fällig am 25.11.2029	1	1	0,00								
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust											
4,944 % fällig am 25.03.2036	28	16	0,00								
Residential Accredit Loans, Inc. Trust											
5,860 % fällig am 25.05.2047	58	50	0,01								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	5,390 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 17.500	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	\$ (17.477)	\$ 17.500	\$ 17.508	4,60
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	1.050	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(1.071)	1.050	1.050	0,28
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (18.548)</b>	<b>\$ 18.550</b>	<b>\$ 18.558</b>	<b>4,88</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2024	24	\$ 30	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	4	(6)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	23	39	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	6	20	0,01
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	87	43	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	117	40	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	236	197	0,05
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	2	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	40	4	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	8	(3)	0,00
<b>Summe</b>				<b>\$ 365</b>	<b>0,10</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURES-AHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens	
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 109,000	26.07.2024	1	\$ 0	\$ (1)	0,00	
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	112,000	26.07.2024	1	(1)	0	0,00	
				\$ (1)	\$ (1)	0,00	
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate						\$ 364	0,10

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 1.900	\$ (11)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	300	6	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	(1)	0,00
Carnival Corp.	1,000	20.12.2028	400	77	0,02
Charter Communications, Inc.	5,000	20.12.2027	575	12	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	1.000	42	0,01
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2031	€ 500	(6)	0,00
				\$ 119	0,03

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000 %	20.12.2028	\$ 6.732	\$ 297	0,08
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000	20.06.2029	21.800	(105)	(0,03)
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	16.900	(28)	(0,01)
				\$ 164	0,04

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermö- gens	
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	18.09.2034	£	900	\$ 23	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054		500	29	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029		2.500	(18)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	18.09.2026		4.100	20	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	¥	940.000	73	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	\$	33.300	(571)	(0,15)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2030		22.300	4.053	1,07
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032		10.100	182	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033		64.800	3.232	0,85
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028		74.900	1.078	0,28
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054		30.200	(672)	(0,18)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029		11.700	26	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.06.2026		8.900	153	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,284	04.01.2027	BRL	21.400	(111)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	CAD	1.100	2	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	AUD	7.600	89	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€	4.500	202	0,05
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029		23.400	341	0,09
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034		400	(2)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026		23.400	157	0,04
					\$ 8.286	2,18	
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 8.569	2,25

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	200	\$ (1)	\$ 0	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	200	(1)	0	0,00	
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	200	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	200	(1)	(1)	0,00	
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,586	15.07.2024	300	(1)	0	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,986	15.07.2024	300	(1)	(2)	0,00	
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689	15.07.2024	400	(1)	0	0,00	
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	400	(1)	(1)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	200	(1)	0	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	500	(2)	(1)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	500	(2)	(1)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	300	(1)	(1)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	400	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	500	(2)	(3)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	500	(2)	(3)	(0,01)	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	200	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	300	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	400	(1)	0	0,00	
	JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,640	23.07.2024	100	(1)	0	0,00
		Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	200	(1)	0	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	100	0	0	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,990	23.07.2024	100	0	(1)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	200	(1)	(1)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	100	0	0	0,00	
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	300	(1)	(1)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	300	(1)	(1)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	300	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	300	(1)	(2)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	300	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	300	(1)	0	0,00	
							\$ (31)	\$ (25)	(0,01)	

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2028	\$ 1.400	\$ (28)	\$ (2)	\$ (30)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	1.600	(139)	99	(40)	(0,01)
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2028	1.300	(25)	(3)	(28)	(0,01)
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	3.200	(137)	133	(4)	0,00
CBK	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2027	500	(3)	1	(2)	0,01
GLM	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2029	275	(28)	8	(20)	(0,01)
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20.12.2026	€ 700	(4)	(19)	(23)	(0,01)
MYC	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	\$ 2.200	(128)	73	(55)	(0,01)
					\$ (492)	\$ 290	\$ (202)	(0,05)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD 302	\$ 185	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	08.2024	\$ 185	NZD 302	0	(1)	(1)	0,00
	10.2024	540	CNH 3.864	0	(6)	(6)	0,00
BOA	07.2024	KRW 772.986	\$ 565	4	0	4	0,00
	07.2024	SGD 14	10	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 121	PLN 483	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	10	SGD 14	0	0	0	0,00
	08.2024	SGD 14	\$ 10	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	CAD 2.825	2.070	5	0	5	0,00
	07.2024	€ 865	931	4	0	4	0,00
	07.2024	£ 9.016	11.517	120	0	120	0,03
	07.2024	KRW 767.193	559	2	0	2	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
	07.2024	\$	1.658	AUD	2.488	\$ 4	0,00
	07.2024		150	IDR	2.457.959	0	0,00
	07.2024		561	NZD	913	(4)	0,00
	07.2024		286	PLN	1.138	(4)	0,00
	07.2024		1.045	SGD	1.417	0	0,00
	08.2024	AUD	2.488	\$	1.659	(4)	0,00
	08.2024	SGD	1.415		1.045	(1)	0,00
	09.2024	CNH	10.182		1.421	18	0,01
	09.2024	TWD	25.676		798	5	0,00
	09.2024	\$	1.348	INR	112.937	4	0,00
	10.2024	CNH	3.510	\$	490	5	0,00
	10.2024	\$	101	CNH	725	0	0,00
BRC	07.2024	MXN	3.036	\$	164	(1)	0,00
	07.2024	NOK	1.972		187	2	0,00
	07.2024	SGD	203		150	1	0,00
	07.2024	\$	251	PLN	1.001	(2)	0,00
	08.2024	TRY	7.368	\$	213	(1)	0,00
	08.2024	\$	881	TRY	30.518	7	0,00
	09.2024	MXN	5.037	\$	266	(6)	0,00
	09.2024	\$	529	MXN	9.914	7	0,00
	10.2024	CNH	8.331	\$	1.162	12	0,00
CBK	07.2024	CHF	268		295	(4)	0,00
	07.2024	£	49		62	0	0,00
	07.2024	KRW	61.833		45	0	0,00
	07.2024	\$	373	BRL	2.034	(7)	0,00
	07.2024		352	PLN	1.394	(5)	0,00
	08.2024	BRL	2.041	\$	373	7	0,00
	09.2024	PEN	2.759		739	19	0,01
	09.2024	TWD	9.790		304	1	0,00
	09.2024	\$	971	INR	81.161	0	0,00
DUB	07.2024	KRW	419.314	\$	305	0	0,00
	07.2024	\$	799	PLN	3.138	(18)	0,00
	08.2024	BRL	741	\$	144	11	0,00
FAR	07.2024	AUD	1.918		1.278	(3)	0,00
	07.2024	€	59.554		64.863	1.037	0,27
	07.2024	NZD	822		503	2	0,00
	07.2024	\$	83	¥	13.189	(1)	0,00
	08.2024	¥	13.127	\$	83	1	0,00
	08.2024	\$	355	NZD	581	0	0,00
GLM	07.2024	MXN	3.193	\$	172	(2)	0,00
	07.2024	\$	299	PLN	1.182	(5)	0,00
	07.2024		569	ZAR	10.417	0	0,00
	08.2024		310	BRL	1.589	(25)	(0,01)
JPM	07.2024	CHF	158	\$	175	(1)	0,00
	07.2024	CNY	2.720		381	4	0,00
	07.2024	IDR	572.496		35	0	0,00
	07.2024	KRW	2.077.962		1.508	(1)	0,00
	07.2024	SGD	1.214		902	6	0,00
	07.2024	\$	2.274	CHF	2.040	(3)	0,00
	07.2024		100	ILS	369	(2)	0,00
	07.2024		179	PLN	699	(5)	0,00
	07.2024		1.072	ZAR	19.733	7	0,00
	08.2024	CHF	2.033	\$	2.274	3	0,00
	08.2024	\$	381	CNY	2.722	0	0,00
	08.2024		926	TRY	32.252	16	0,01
	09.2024	TWD	16.655	\$	517	3	0,00
	09.2024	\$	111	INR	9.283	0	0,00
	10.2024	CNH	6.047	\$	845	10	0,00
MBC	10.2024	\$	101	CNH	723	(1)	0,00
	07.2024	AUD	570	\$	379	(2)	0,00
	07.2024	€	3.857		4.180	46	0,01
	07.2024	£	639		814	6	0,00
	07.2024	¥	13.200		84	2	0,00
	07.2024	\$	2.065	CAD	2.827	1	0,00
	07.2024		905	£	715	(1)	0,00
	07.2024		144	NOK	1.534	0	0,00
	08.2024	CAD	2.825	\$	2.065	(1)	0,00
	08.2024	NOK	1.533		144	0	0,00
MYI	07.2024	BRL	2.033		394	28	0,01
	07.2024	€	2.026		2.172	0	0,00
	07.2024	\$	43	€	40	0	0,00
	07.2024		77	£	61	0	0,00
	07.2024		41	NOK	438	0	0,00
	07.2024		400	NZD	652	(3)	0,00
	08.2024	NOK	438	\$	41	0	0,00
	09.2024	TWD	6.626		207	2	0,00
	09.2024	\$	74	INR	6.196	0	0,00
RBC	07.2024		11.399	£	8.989	(37)	(0,01)
	08.2024	£	8.989	\$	11.401	36	0,01
RYL	07.2024	€	936		1.001	(2)	0,00
SCX	07.2024		328		352	1	0,00
	07.2024	KRW	389.310		285	3	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	MXN		1	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	PEN		1.042	22	22	0,01
	07.2024	\$	CNY	2.718	0	(5)	0,00
	07.2024		€	67.526	24	0	0,01
	07.2024		ZAR	13.674	6	0	0,00
	08.2024	€	\$	72.453	0	(23)	(0,01)
	09.2024	CNH		582	7	0	0,00
	09.2024	TWD		46.558	1.445	0	0,00
	09.2024	\$	INR	74.261	1	0	0,00
SSB	07.2024	€	\$	603	7	0	0,00
TOR	07.2024	NZD		270	1	0	0,00
	08.2024	\$	NZD	441	0	(1)	0,00
UAG	07.2024	CHF	\$	1.788	0	(10)	0,00
	07.2024	ILS		93	2	0	0,00
				\$ 1.531	\$ (200)	\$ 1.331	0,35

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$	€	35.124	32.353	\$ 0	(0,12)
BPS	07.2024	€	\$	30.621	32.753	0	(0,02)
	07.2024	\$	€	31.816	29.383	0	(0,09)
	08.2024			32.800	30.621	66	0,02
BRC	07.2024	€	\$	29	31	0	0,00
CBK	07.2024			174	188	1	0,00
FAR	07.2024	\$	€	33.248	30.527	0	(0,14)
GLM	07.2024	€	\$	249	269	3	0,00
JPM	07.2024			828	887	0	0,00
MBC	07.2024			30.686	32.813	0	(0,02)
	07.2024	\$	€	345	320	0	0,00
	08.2024			32.815	30.644	75	0,02
MYI	07.2024			8	7	0	0,00
RBC	07.2024			117	108	0	0,00
RYL	07.2024			28	26	0	0,00
SCX	07.2024	€	\$	30.635	32.822	0	0,00
	07.2024	\$	€	38	36	0	0,00
	08.2024			32.870	30.635	10	0,00
SSB	07.2024			794	732	0	0,00
UAG	08.2024	€	\$	40	43	0	0,00
				\$ 155	\$ (1.472)	\$ (1.317)	(0,35)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£	\$	52.263	66.087	\$ 21	0,01
	07.2024	\$	£	129.424	101.562	0	(0,27)
	08.2024			66.098	52.263	0	(0,01)
CBK	07.2024	£	\$	23	29	0	0,00
	07.2024	\$	£	1.864	1.466	0	0,00
	08.2024	£	\$	4	5	0	0,00
DUB	07.2024	\$	£	67.531	52.924	0	(0,17)
MBC	07.2024	£	\$	51.916	65.684	57	0,01
	07.2024	\$	£	63	50	0	0,00
	08.2024			65.509	51.769	0	(0,01)
RBC	07.2024	£	\$	51.731	65.600	208	0,05
	08.2024	\$	£	65.611	51.731	0	(0,05)
RYL	07.2024	£	\$	70	89	1	0,00
				\$ 287	\$ (1.963)	\$ (1.676)	(0,44)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (1.889) (0,50)

Summe Anlagen

\$ 424.026 111,48

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (43.666) (11,48)

Nettovermögen

\$ 380.360 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.  
(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.  
(d) Nullkuponwertpapier.  
(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
(g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
(h) Mit dem Fonds verbunden.  
(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
(j) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,47 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 18	\$ 18	0,00
Corestate Capital Holding S.A.	22.08.2023	0	0	0,00
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	1.233	1.442	0,38
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2020 - 01.05.2020	1.289	537	0,14
		\$ 2.540	\$ 1.997	0,52

- (k) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 815 USD (31. Dezember 2023: 559 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 16.088 USD (31. Dezember 2023: 20.224 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.520 USD (31. Dezember 2023: 290 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 356.903	\$ 3.683	\$ 360.586
Investmentfonds	37.846	0	0	37.846
Pensionsgeschäfte	0	18.550	0	18.550
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	122	6.922	0	7.044
<b>Summen</b>	<b>\$ 37.968</b>	<b>\$ 382.375</b>	<b>\$ 3.683</b>	<b>\$ 424.026</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 5	\$ 360.156	\$ 3.725	\$ 363.886
Investmentfonds	40.097	555	0	40.652
Pensionsgeschäfte	0	69.552	0	69.552
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	247	16.352	0	16.599
<b>Summen</b>	<b>\$ 40.349</b>	<b>\$ 446.615</b>	<b>\$ 3.725</b>	<b>\$ 490.689</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BRC	5,000 %	15.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (519)	\$ (529)	(0,14)
SCX	5,250	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(246)	(246)	(0,06)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (775)</b>	<b>(0,20)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (6)	\$ 0	\$ (6)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(517)	610	93	(48)	0	(48)
BPS	(1.237)	1.180	(57)	119	0	119
BRC	15	0	15	36	0	36
CBK	(3)	0	(3)	(67)	0	(67)
DUB	(636)	730	94	(232)	290	58
FAR	503	(620)	(117)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(62)	0	(62)	2	0	2
GST	(23)	0	(23)	(138)	0	(138)
JPM	33	0	33	(22)	0	(22)
MBC	49	0	49	194	(390)	(196)
MYC	(61)	0	(61)	(76)	0	(76)
MYI	27	(10)	17	178	(390)	(212)
RBC	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(1)	0	(1)	(3)	0	(3)
SCX	42	0	42	643	(910)	(267)
SSB	(3)	0	(3)	838	(730)	108
UAG	(8)	0	(8)	13	0	13

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	48,89	49,72
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	44,05	38,05
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,86	0,37
Investmentfonds	9,95	9,85
Pensionsgeschäfte	4,88	16,85
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	0,75
Zentral abgerechnete Finanzderivate	2,25	2,92
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,50)	0,35
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,20)	(0,13)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Angola	0,21	0,23
Argentinien	0,75	0,72
Australien	0,14	0,13
Aserbaidschan	0,11	k. A.
Bermuda	0,67	0,74
Brasilien	0,52	0,02
Kanada	1,26	1,12
Cayman-Inseln	2,87	3,08
Chile	0,26	k. A.
China	0,01	0,01
Kolumbien	0,57	0,96
Costa Rica	0,08	0,08
Tschechische Republik	0,08	k. A.
Dänemark	0,23	0,22
Dominikanische Republik	0,37	0,60
Ecuador	0,34	0,40
Ägypten	0,61	0,65
El Salvador	0,22	k. A.
Finnland	0,07	0,20
Frankreich	1,81	2,21
Deutschland	1,52	1,82
Ghana	0,23	0,18
Guatemala	0,22	0,26
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,10
Hongkong	0,15	0,10
Ungarn	0,78	0,54
Indonesien	0,85	1,19
Irland	4,71	2,88
Insel Man	0,05	k. A.
Israel	0,27	0,11
Italien	2,83	2,86
Elfenbeinküste	0,56	0,44
Japan	0,46	0,35
Jersey, Kanalinseln	0,52	1,52
Kasachstan	0,20	0,18
Kenia	0,13	k. A.

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Luxemburg	2,60	4,17
Mazedonien	0,08	0,08
Mexiko	2,82	2,30
Niederlande	2,35	2,79
Nigeria	0,40	0,39
Oman	0,27	0,25
Pakistan	0,09	k. A.
Panama	0,61	0,35
Peru	0,77	0,56
Polen	0,43	k. A.
Rumänien	0,95	0,95
Russland	k. A.	0,02
Saudi-Arabien	0,89	1,12
Senegal	0,28	0,04
Serbien	0,27	0,43
Singapur	0,05	k. A.
Slowenien	k. A.	0,41
Südafrika	0,26	0,41
Spanien	0,62	0,44
Sri Lanka	0,17	0,14
Supranational	0,84	k. A.
Schweden	k. A.	0,14
Schweiz	0,39	0,16
Türkei	1,14	0,88
Ukraine	0,44	0,33
Vereinigte Arabische Emirate	0,39	0,21
Großbritannien	4,97	4,89
USA	47,73	42,15
Usbekistan	0,08	k. A.
Venezuela	0,20	0,17
Kurzfristige Instrumente	0,05	0,46
Investmentfonds	9,95	9,85
Pensionsgeschäfte	4,88	16,85
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	0,75
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,04	0,43
Zinsswaps	2,18	2,49
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,05)	(0,08)
Devisenterminkontrakte	0,35	(0,12)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,79)	0,55
Sonstige Aktiva und Passiva	(11,48)	(18,86)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>ARGENTINIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Argentina Government International Bond			
3,500 % fällig am 09.07.2041	\$ 750	\$ 295	0,56
<b>AUSTRALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Goodman Australia Finance Pty. Ltd.			
4,250 % fällig am 03.05.2030	€ 125	136	0,26
<b>BERMUDA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
NCL Corp. Ltd.			
8,375 % fällig am 01.02.2028	\$ 200	209	0,40
<b>BRASILIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco BTG Pactual S.A.			
2,750 % fällig am 11.01.2026	100	95	0,18
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Brazil Government International Bond			
5,000 % fällig am 27.01.2045	200	154	0,29
6,250 % fällig am 18.03.2031	200	199	0,38
		353	0,67
Summe Brasilien		448	0,85
<b>KANADA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Air Canada Pass-Through Trust			
5,250 % fällig am 01.10.2030	344	340	0,64
B.C. Unlimited Liability Co.			
3,875 % fällig am 15.01.2028	175	164	0,31
Summe Kanada		504	0,95
<b>CAYMAN INSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2,528 % fällig am 18.11.2027	100	90	0,17
Seagate HDD Cayman			
3,125 % fällig am 15.07.2029	50	43	0,08
5,750 % fällig am 01.12.2034	200	194	0,37
Summe Cayman Inseln		327	0,62
<b>CHILE</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Chile Government International Bond			
3,100 % fällig am 07.05.2041	300	220	0,41
4,850 % fällig am 22.01.2029	100	99	0,19
Summe Chile		319	0,60
<b>KOLUMBIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Colombia Government International Bond			
5,000 % fällig am 15.06.2045	200	141	0,27
7,500 % fällig am 02.02.2034	300	301	0,57
Summe Kolumbien		442	0,84
<b>COSTA RICA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Costa Rica Government International Bond			
5,625 % fällig am 30.04.2043	150	135	0,26
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
EPH Financing International A/S			
5,875 % fällig am 30.11.2029	€ 100	108	0,20

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>DANEMARK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
TDC Net A/S			
5,618 % fällig am 06.02.2030	€ 300	\$ 331	0,63
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Dominican Republic Government International Bond			
4,500 % fällig am 30.01.2030	\$ 100	91	0,17
6,500 % fällig am 15.02.2048	200	190	0,36
Summe Dominikanische Republik		281	0,53
<b>ECUADOR</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ecuador Government International Bond			
3,500 % fällig am 31.07.2035	400	201	0,38
6,000 % fällig am 31.07.2030	128	81	0,15
Summe Ecuador		282	0,53
<b>ÄGYPTEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Egypt Government International Bond			
6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 400	341	0,64
<b>EL SALVADOR</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
El Salvador Government International Bond			
7,650 % fällig am 15.06.2035	\$ 150	109	0,21
<b>FRANKREICH</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Altice France S.A.			
11,500 % fällig am 01.02.2027 (g)	€ 150	132	0,25
AXA S.A.			
5,500 % fällig am 11.07.2043	100	113	0,21
BNP Paribas S.A.			
8,500 % fällig am 14.08.2028 (d)(f)	\$ 200	205	0,39
BPCE S.A.			
7,003 % fällig am 19.10.2034	150	161	0,30
Cerba Healthcare SACA			
3,500 % fällig am 31.05.2028	€ 100	89	0,17
Crown European Holdings S.A.			
2,875 % fällig am 01.02.2026	100	105	0,20
Electricite de France S.A.			
9,125 % fällig am 15.03.2033 (d)	\$ 125	136	0,26
Forvia SE			
2,375 % fällig am 15.06.2029	€ 200	193	0,37
Loxam S.A.S.			
4,500 % fällig am 15.02.2027	100	107	0,20
Vilmorin & Cie S.A.			
1,375 % fällig am 26.03.2028	100	94	0,18
Summe Frankreich		1.335	2,53
<b>DEUTSCHLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Deutsche Bank AG			
1,625 % fällig am 20.01.2027	100	101	0,19
1,875 % fällig am 23.02.2028	100	102	0,19
3,742 % fällig am 07.01.2033	\$ 200	165	0,31
E.ON SE			
3,750 % fällig am 15.01.2036	€ 150	159	0,30
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide			
1,875 % fällig am 31.03.2028	50	50	0,09
Schaeffler AG			
3,375 % fällig am 12.10.2028	100	104	0,20
Volkswagen Leasing GmbH			
3,875 % fällig am 11.10.2028	200	215	0,41
ZF Finance GmbH			
2,000 % fällig am 06.05.2027	100	100	0,19
Summe Deutschland		996	1,88

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>GHANA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ghana Government International Bond			
7,875 % fällig am 11.02.2035 ^	\$ 350	\$ 180	0,34
<b>UNGARN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Hungary Government International Bond			
2,125 % fällig am 22.09.2031	200	159	0,30
4,000 % fällig am 25.07.2029	€ 125	133	0,25
6,750 % fällig am 25.09.2052	\$ 200	214	0,41
Summe Ungarn		506	0,96
<b>INDIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
ReNew Pvt Ltd.			
5,875 % fällig am 05.03.2027	275	267	0,50
Shriram Finance Ltd.			
6,625 % fällig am 22.04.2027	100	100	0,19
Summe Indien		367	0,69
<b>INDONESIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
4,700 % fällig am 06.06.2032	500	482	0,91
<b>IRLAND</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Cumulus Static CLO DAC			
5,025 % fällig am 15.11.2033	€ 500	536	1,01
Rockford Tower Europe CLO DAC			
5,220 % fällig am 24.04.2037	500	536	1,01
SCF Rahoituspalvelut DAC			
4,364 % fällig am 25.06.2034	200	215	0,41
		1.287	2,43
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bank of Ireland Group PLC			
6,253 % fällig am 16.09.2026	\$ 200	201	0,38
Perrigo Finance Unlimited Co.			
5,150 % fällig am 15.06.2030	200	184	0,35
Smurfit Kappa Treasury ULC			
5,200 % fällig am 15.01.2030	200	199	0,38
		584	1,11
Summe Irland		1.871	3,54
<b>ITALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Intesa Sanpaolo SpA			
8,248 % fällig am 21.11.2033	50	55	0,11
Mundys SpA			
1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 200	197	0,37
Next SpA			
2,125 % fällig am 30.04.2029	100	97	0,18
Telecom Italia SpA			
7,875 % fällig am 31.07.2028	100	117	0,22
Summe Italien		466	0,88
<b>ELFENBEINKÜSTE</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ivory Coast Government International Bond			
6,125 % fällig am 15.06.2033	\$ 100	89	0,17
7,625 % fällig am 30.01.2033	200	195	0,37
Summe Elfenbeinküste		284	0,54
<b>JAPAN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
5,475 % fällig am 22.02.2031	200	202	0,38
Mizuho Financial Group, Inc.			
3,490 % fällig am 05.09.2027	€ 200	215	0,41

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>			
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % fällig am 14.01.2029	\$ 100	\$ 89	0,17
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 5,500 % fällig am 09.03.2028	200	203	0,38
Summe Japan		709	1,34
<b>KASACHSTAN STAATSEMISSIONEN</b>			
Kazakhstan Government International Bond 6,500 % fällig am 21.07.2045	200	231	0,44
<b>LIBERIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Royal Caribbean Cruises Ltd. 4,250 % fällig am 01.07.2026	350	339	0,64
<b>LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Logicor Financing SARL 1,625 % fällig am 17.01.2030	€ 200	184	0,35
<b>MEXIKO STAATSEMISSIONEN</b>			
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031 (c) MXN	3.251	150	0,28
4,875 % fällig am 19.05.2033	\$ 200	185	0,35
5,750 % fällig am 12.10.2110	175	145	0,28
6,400 % fällig am 07.05.2054	75	71	0,13
Summe Mexiko		551	1,04
<b>MAROKKO STAATSEMISSIONEN</b>			
Morocco Government International Bond 3,000 % fällig am 15.12.2032	200	161	0,30
<b>MULTINATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
American Airlines, Inc. 5,750 % fällig am 20.04.2029	100	97	0,18
NXP BV 5,350 % fällig am 01.03.2026	50	50	0,10
Summe multinational		147	0,28
<b>NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AerCap Holdings NV 5,875 % fällig am 10.10.2079	200	199	0,38
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 100	92	0,17
Coöperatieve Rabobank UA 3,758 % fällig am 06.04.2033	\$ 300	266	0,50
Digital Dutch Finco BV 1,000 % fällig am 15.01.2032	€ 200	172	0,33
Enel Finance International NV 2,250 % fällig am 12.07.2031	\$ 350	286	0,54
ING Groep NV 4,125 % fällig am 24.08.2033	€ 100	106	0,20
IPD BV 7,086 % fällig am 15.06.2031	125	134	0,25
JDE Peet's NV 2,250 % fällig am 24.09.2031	\$ 50	40	0,08
NE Property BV 3,375 % fällig am 14.07.2027	€ 100	104	0,20
Prosus NV 3,061 % fällig am 13.07.2031	\$ 200	166	0,31
Sensata Technologies BV 4,000 % fällig am 15.04.2029	300	276	0,52
Universal Music Group NV 4,000 % fällig am 13.06.2031	€ 100	109	0,21
Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	50	50	0,09
Summe Niederlande		2.000	3,78

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>			
<b>OMAN STAATSEMISSIONEN</b>			
Oman Government International Bond 6,750 % fällig am 17.01.2048	\$ 200	\$ 204	0,39
<b>PANAMA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Carnival Corp. 4,000 % fällig am 01.08.2028	100	94	0,18
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Panama Government International Bond 6,700 % fällig am 26.01.2036	700	681	1,29
Summe Panama		775	1,47
<b>PARAGUAY STAATSEMISSIONEN</b>			
Paraguay Government International Bond 5,400 % fällig am 30.03.2050	100	88	0,17
<b>PERU STAATSEMISSIONEN</b>			
Peru Government International Bond 3,000 % fällig am 15.01.2034	200	163	0,31
3,300 % fällig am 11.03.2041	300	223	0,42
6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN 300	75	0,14
Summe Peru		461	0,87
<b>PHILIPPINEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048	\$ 250	254	0,48
<b>POLEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Republic of Poland Government International Bond 3,625 % fällig am 11.01.2034	€ 250	266	0,50
4,875 % fällig am 04.10.2033	\$ 125	122	0,23
5,500 % fällig am 18.03.2054	100	97	0,19
Summe Polen		485	0,92
<b>RUMÄNIEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Romania Government International Bond 1,750 % fällig am 13.07.2030	€ 100	88	0,17
5,250 % fällig am 30.05.2032	50	52	0,10
5,625 % fällig am 22.02.2036	100	105	0,20
5,625 % fällig am 30.05.2037	200	207	0,39
6,625 % fällig am 27.09.2029	75	86	0,16
Summe Rumänien		538	1,02
<b>SENEGAL STAATSEMISSIONEN</b>			
Senegal Government International Bond 4,750 % fällig am 13.03.2028	100	99	0,19
5,375 % fällig am 08.06.2037	100	78	0,15
Summe Senegal		177	0,34
<b>SERBIEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Serbia Government International Bond 1,650 % fällig am 03.03.2033	200	161	0,30
<b>SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Flex Ltd. 4,875 % fällig am 15.06.2029	\$ 50	48	0,09
<b>SUDAFRIKA STAATSEMISSIONEN</b>			
South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029	60	55	0,10
5,650 % fällig am 27.09.2047	60	45	0,09

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>			
5,750 % fällig am 30.09.2049	\$ 240	\$ 182	0,34
Summe Südafrika		282	0,53
<b>SPANIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % fällig am 27.11.2026	€ 100	120	0,23
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,138 % fällig am 14.09.2028	\$ 200	204	0,38
CaixaBank S.A. 3,750 % fällig am 07.09.2029	€ 100	109	0,21
6,840 % fällig am 13.09.2034	\$ 100	106	0,20
Cellnex Finance Co. S.A. 2,000 % fällig am 15.09.2032	€ 300	277	0,52
Grifols S.A. 2,250 % fällig am 15.11.2027	50	48	0,09
Summe Spanien		864	1,63
<b>SRI LANKA STAATSEMISSIONEN</b>			
Sri Lanka Government International Bond 6,750 % fällig am 18.04.2028 ^	\$ 200	118	0,22
<b>SUPRANATIONAL STAATSEMISSIONEN</b>			
Europäische Union 3,375 % fällig am 04.10.2039	€ 100	107	0,20
<b>SCHWEDEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
EQT AB 0,875 % fällig am 14.05.2031	300	260	0,49
<b>SCHWEIZ UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
UBS Group AG 3,091 % fällig am 14.05.2032	\$ 250	213	0,40
<b>TÜRKEI UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Türkiye Varlik Fonu Yonetimi A/S 8,250 % fällig am 14.02.2029	200	204	0,39
<b>GROSSBRITANNIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,125 % fällig am 15.06.2028	250	245	0,46
Barclays PLC 7,437 % fällig am 02.11.2033	200	220	0,42
Berkeley Group PLC 2,500 % fällig am 11.08.2031	€ 100	99	0,19
British Telecommunications PLC 3,875 % fällig am 20.01.2034	€ 100	107	0,20
HSBC Holdings PLC 3,973 % fällig am 22.05.2030	\$ 100	93	0,18
Land Securities Capital Markets PLC 4,875 % fällig am 15.09.2034	€ 100	126	0,24
Marks & Spencer PLC 4,500 % fällig am 10.07.2027	100	123	0,23
National Grid PLC 3,875 % fällig am 16.01.2029	€ 300	324	0,61
NatWest Group PLC 0,780 % fällig am 26.02.2030	400	373	0,70
Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC 0,000 % fällig am 05.04.2032 (a)	\$ 125	82	0,15
Standard Chartered PLC 0,800 % fällig am 17.11.2029	€ 200	188	0,35
6,301 % fällig am 09.01.2029	\$ 50	51	0,10
Virgin Media Secured Finance PLC 4,125 % fällig am 15.08.2030	€ 100	105	0,20
Vmed O2 UK Financing PLC 4,500 % fällig am 15.07.2031	200	209	0,39
5,625 % fällig am 15.04.2032	€ 100	104	0,20
Vodafone Group PLC 5,125 % fällig am 04.06.2081	\$ 300	221	0,42

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026	\$ 200	\$ 188	0,36	Credit Acceptance Corp. 6,625 % fällig am 15.03.2026	\$ 200	\$ 200	0,38	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. 1,350 % fällig am 15.03.2031	\$ 200	\$ 157	0,30
		2.858	5,40	Cross, Inc. 4,250 % fällig am 15.03.2029	50	46	0,09	Netflix, Inc. 4,875 % fällig am 15.06.2030	300	295	0,56
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Crown Castle, Inc. 2,500 % fällig am 15.07.2031	300	248	0,47	OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027	250	234	0,44
United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054	£ 100	121	0,23	3,100 % fällig am 15.11.2029	50	45	0,09	Open Text Holdings, Inc. 4,125 % fällig am 15.02.2030	100	90	0,17
Summe Großbritannien		2.979	5,63	CVS Health Corp. 3,750 % fällig am 01.04.2030	300	276	0,52	Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 200	202	0,38
<b>USA</b>				Dell International LLC 3,375 % fällig am 15.12.2041	100	73	0,14	4,125 % fällig am 30.04.2028	\$ 50	47	0,09
<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				6,020 % fällig am 15.06.2026	19	19	0,04	Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % fällig am 01.04.2053	225	234	0,44
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 5,520 % fällig am 22.02.2055	\$ 90	86	0,17	Edgewell Personal Care Co. 5,500 % fällig am 01.06.2028	50	49	0,09	Panther Escrow Issuer LLC 7,125 % fällig am 01.06.2031	75	76	0,14
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 5,760 % fällig am 25.08.2036	12	12	0,02	Elanco Animal Health, Inc. 6,850 % fällig am 28.08.2028	200	203	0,38	Park Intermediate Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.05.2029	100	94	0,18
Option One Mortgage Loan Trust 5,960 % fällig am 25.07.2036	252	144	0,27	Embecta Corp. 5,000 % fällig am 15.02.2030	200	165	0,31	PennyMac Financial Services, Inc. 7,875 % fällig am 15.12.2029	100	103	0,20
		242	0,46	Equinix, Inc. 2,500 % fällig am 15.05.2031	150	126	0,24	PNC Financial Services Group, Inc. 2,200 % fällig am 01.11.2024	300	297	0,56
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Ford Motor Co. 3,250 % fällig am 12.02.2032	275	227	0,43	Post Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.12.2029	150	145	0,27
AES Corp. 2,450 % fällig am 15.01.2031	250	206	0,39	Fortress Intermediate, Inc. 7,500 % fällig am 01.06.2031	50	51	0,10	Quanta Services, Inc. 2,350 % fällig am 15.01.2032	200	163	0,31
5,450 % fällig am 01.06.2028	150	150	0,28	Freedom Mortgage Holdings LLC 9,125 % fällig am 15.05.2031	100	97	0,18	Radian Group, Inc. 6,200 % fällig am 15.05.2029	100	101	0,19
Albertsons Cos., Inc. 3,500 % fällig am 15.03.2029	100	90	0,17	Frontier Communications Holdings LLC 8,750 % fällig am 15.05.2030	73	75	0,14	Reworld Holding Corp. 4,875 % fällig am 01.12.2029	200	183	0,35
Ally Financial, Inc. 8,000 % fällig am 01.11.2031	140	155	0,29	Global Medical Response, Inc. 10,000 % fällig am 31.10.2028	25	25	0,05	Ritchie Bros Holdings, Inc. 7,750 % fällig am 15.03.2031	50	52	0,10
American Tower Corp. 2,900 % fällig am 15.01.2030	50	44	0,08	Goldman Sachs Group, Inc. 3,102 % fällig am 24.02.2033	100	85	0,16	Rivian Holdings LLC 11,310 % fällig am 15.10.2026	100	101	0,19
2,950 % fällig am 15.01.2051	200	125	0,24	5,727 % fällig am 25.04.2030	25	25	0,05	Rocket Mortgage LLC 4,000 % fällig am 15.10.2033	200	169	0,32
Amgen, Inc. 3,000 % fällig am 22.02.2029	250	230	0,44	Gray Television, Inc. 5,375 % fällig am 15.11.2031	50	28	0,05	San Diego Gas & Electric Co. 4,950 % fällig am 15.08.2028	75	75	0,14
AT&T, Inc. 4,300 % fällig am 15.02.2030	300	288	0,55	Haleon U.S. Capital LLC 3,375 % fällig am 24.03.2029	350	325	0,62	Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % fällig am 09.09.2026	200	199	0,38
Avantor Funding, Inc. 3,875 % fällig am 01.11.2029	200	182	0,34	HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	50	47	0,09	SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	75	67	0,13
Aviation Capital Group LLC 5,500 % fällig am 15.12.2024	50	50	0,09	8,000 % fällig am 15.06.2027	100	104	0,20	Scripps Escrow, Inc. 3,875 % fällig am 15.01.2029	25	17	0,03
Axalta Coating Systems LLC 3,375 % fällig am 15.02.2029	200	179	0,34	HCA, Inc. 4,125 % fällig am 15.06.2029	350	332	0,63	Sirius XM Radio, Inc. 3,875 % fällig am 01.09.2031	150	123	0,23
Ball Corp. 2,875 % fällig am 15.08.2030	400	340	0,64	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2032	200	173	0,33	SLM Corp. 3,125 % fällig am 02.11.2026	150	140	0,26
Bank of America Corp. 6,204 % fällig am 10.11.2028	400	412	0,78	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 4,875 % fällig am 01.07.2031	200	177	0,33	Solar Star Funding LLC 5,375 % fällig am 30.06.2035	260	254	0,48
Bank of New York Mellon Corp. 4,706 % fällig am 01.02.2034	200	191	0,36	Host Hotels & Resorts LP 2,900 % fällig am 15.12.2031	250	209	0,40	Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	500	420	0,79
Beacon Roofing Supply, Inc. 4,500 % fällig am 15.11.2026	200	195	0,37	Ingevity Corp. 3,875 % fällig am 01.11.2028	50	45	0,09	Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	400	482	0,91
Block, Inc. 6,500 % fällig am 15.05.2032	125	127	0,24	Intercontinental Exchange, Inc. 3,625 % fällig am 01.09.2028	300	283	0,54	Standard Industries, Inc. 4,375 % fällig am 15.07.2030	200	181	0,34
Boise Cascade Co. 4,875 % fällig am 01.07.2030	250	232	0,44	IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2028	€ 250	250	0,47	Starwood Property Trust, Inc. 7,250 % fällig am 01.04.2029	50	51	0,10
Brandywine Operating Partnership LP 8,875 % fällig am 12.04.2029	60	63	0,12	JPMorgan Chase & Co. 2,580 % fällig am 22.04.2032	\$ 600	507	0,97	TEGNA, Inc. 5,000 % fällig am 15.09.2029	75	66	0,13
Builders FirstSource, Inc. 4,250 % fällig am 01.02.2032	200	177	0,34	Kilroy Realty LP 2,650 % fällig am 15.11.2033	200	147	0,28	Tenet Healthcare Corp. 4,625 % fällig am 15.06.2028	200	190	0,36
Cable One, Inc. 4,000 % fällig am 15.11.2030	100	75	0,14	Kraft Heinz Foods Co. 3,750 % fällig am 01.04.2030	50	47	0,09	TerraForm Power Operating LLC 5,000 % fällig am 31.01.2028	200	191	0,36
CCO Holdings LLC 4,500 % fällig am 01.05.2032	75	60	0,11	6,500 % fällig am 09.02.2040	100	107	0,20	Topaz Solar Farms LLC 5,750 % fällig am 30.09.2039	188	182	0,34
Charter Communications Operating LLC 3,850 % fällig am 01.04.2061	100	58	0,11	Lamb Weston Holdings, Inc. 4,375 % fällig am 31.01.2032	200	179	0,34	TopBuild Corp. 3,625 % fällig am 15.03.2029	250	225	0,43
3,950 % fällig am 30.06.2062	200	119	0,23	Level 3 Financing, Inc. 3,875 % fällig am 15.10.2030	50	26	0,05	Travel + Leisure Co. 4,625 % fällig am 01.03.2030	250	228	0,43
Chobani LLC 4,625 % fällig am 15.11.2028	300	284	0,54	11,000 % fällig am 15.11.2029	6	6	0,01	Twilio, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2029	200	180	0,34
Citigroup, Inc. 5,449 % fällig am 11.06.2035	75	74	0,14	LPL Holdings, Inc. 4,000 % fällig am 15.03.2029	50	47	0,09	Uber Technologies, Inc. 4,500 % fällig am 15.08.2029	200	191	0,36
Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	275	240	0,45	Marvell Technology, Inc. 4,875 % fällig am 22.06.2028	50	49	0,09	UKG, Inc. 6,875 % fällig am 01.02.2031	125	127	0,24
Comcast Corp. 4,650 % fällig am 15.02.2033	100	97	0,18	Moody's Corp. 2,000 % fällig am 19.08.2031	250	203	0,38				
Community Health Systems, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2031	50	39	0,07	Morgan Stanley 5,123 % fällig am 01.02.2029	330	329	0,62				
Coty, Inc. 5,000 % fällig am 15.04.2026	157	155	0,29	MSCI, Inc. 3,625 % fällig am 01.09.2030	50	45	0,09				

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNG</b>				<b>US-REGIERUNG</b>				<b>USBEKISTAN</b>			
United Airlines Pass-Through Trust				<b>US-SCHATZ OBLIGATIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
5,875 % fällig am 15.04.2029	\$ 55	\$ 55	0,10	U.S. Treasury Bonds				Republic of Uzbekistan International Bond			
United Rentals North America, Inc.				3,875 % fällig am 15.05.2043	500	451	0,85	5,375 % fällig am 29.05.2027	€ 100	\$ 107	0,20
3,875 % fällig am 15.02.2031	200	179	0,34	4,000 % fällig am 15.11.2042	175	162	0,31				
Verizon Communications, Inc.				Summe USA		26.762	50,64	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
1,500 % fällig am 18.09.2030	50	41	0,08					<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
2,850 % fällig am 03.09.2041	100	70	0,13					5,396 % fällig am			
VMware LLC								29.08.2024 (a)(b)(h)	\$ 800	793	1,50
2,200 % fällig am 15.08.2031	200	163	0,31					Summe kurzfristige Instrumente		793	1,50
4,500 % fällig am 15.05.2025	50	50	0,09								
Walgreens Boots Alliance, Inc.								Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 51.239	96,94	
2,125 % fällig am 20.11.2026	€ 100	101	0,19								
Wells Fargo & Co.								<b>AKTIEN</b>			
4,540 % fällig am 15.08.2026	\$ 100	99	0,19					<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Wisconsin Power & Light Co.								<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
4,950 % fällig am 01.04.2033	200	194	0,37					PIMCO Funds: Global			
WMG Acquisition Corp.								Investors Series plc -			
2,250 % fällig am 15.08.2031	€ 400	375	0,71					Emerging Markets Bond			
Yum! Brands, Inc.								ESG Fund (e)	303.571	3.464	6,55
4,625 % fällig am 31.01.2032	\$ 100	92	0,17					PIMCO Funds: Global			
ZF North America Capital, Inc.								Investors Series plc -			
7,125 % fällig am 14.04.2030	200	207	0,39					Global Investment Grade			
		18.295	34,62					Credit ESG Fund (e)	145.292	1.559	2,95
								Summe Investmentfonds	\$ 5.023	9,50	
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>URUGUAY</b>							
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
6,293 % fällig am 19.09.2044	26	23	0,04	Uruguay Government International Bond							
				5,100 % fällig am 18.06.2050	300	283	0,54				

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 402.000	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	\$ (410)	\$ 402	\$ 402	0,76
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (410)	\$ 402	\$ 402	0,76

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	4	\$ 3	0,01
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	13	(16)	(0,03)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	4	(6)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	5	0	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	21	10	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	7	(6)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	18	(15)	(0,03)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	7	4	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	3	(1)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (27)	(0,05)

#### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Cellnex Telecom S.A.	5,000 %	20.12.2030	€ 100	\$ 21	0,04

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000 %	20.06.2029	\$ 700	\$ (4)	(0,01)

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	18.09.2034	£ 100	\$ (2)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	30	(2)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	1.100	(11)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	18.09.2026	200	1	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 10.000	2	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850	20.09.2033	70.000	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	\$ 1.900	55	0,10
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	2.100	(18)	(0,03)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	18.12.2026	3.800	(29)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,284	04.01.2027	BRL 2.400	(12)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	CAD 400	1	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	AUD 1.000	12	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 300	14	0,02
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	700	(15)	(0,03)
					\$ (4)	(0,01)
					\$ 13	0,02

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**VERKAUFSOPTIONEN****ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689 %	15.07.2024	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	100	0	0	0,00
							\$ (3)	\$ (2)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2028	\$ 300	\$ (17)	\$ 13	\$ (4)	(0,01)	
BRC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2027	100	(17)	13	(4)	(0,01)	
GST	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2029	350	4	(1)	3	0,01	
MYC	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2028	200	(35)	26	(9)	(0,02)	
						\$ (65)	\$ 51	\$ (14)	(0,03)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 8.409	\$ 9.129	\$ 117	\$ 0	\$ 117	0,22
BRC	07.2024	174	187	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 189	TRY 6.551	1	0	1	0,00
	09.2024	MXN 7.186	\$ 384	0	(5)	(5)	(0,01)
CBK	07.2024	PEN 111	30	1	0	1	0,00
	08.2024	£ 8	10	0	0	0	0,00
	09.2024	PEN 231	62	2	0	2	0,01
GLM	07.2024	€ 99	107	1	0	1	0,00
MBC	07.2024	CAD 12	9	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 357	389	6	0	6	0,01
	07.2024	£ 749	954	7	0	7	0,02
	07.2024	\$ 948	£ 749	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	£ 749	\$ 948	1	0	1	0,00
MYI	07.2024	€ 248	265	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 37	€ 34	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	9.936	9.272	3	(2)	1	0,00
	07.2024	0	MXN 8	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 9.110	\$ 9.775	0	(3)	(3)	(0,01)
				\$ 139	\$ (11)	\$ 128	0,24

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 45	\$ 48	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 15.380	€ 14.166	0	(198)	(198)	(0,37)
BRC	07.2024	€ 189	\$ 202	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 14.236	€ 13.147	0	(146)	(146)	(0,28)
CBK	07.2024	€ 58	\$ 62	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 9	€ 8	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	€ 7	\$ 8	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	13.216	14.132	0	(32)	(32)	(0,06)
	08.2024	\$ 14.115	€ 13.181	33	0	33	0,06
MYI	07.2024	€ 20	\$ 22	0	0	0	0,00
	08.2024	34	37	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	13.187	14.129	0	(5)	(5)	(0,01)
	07.2024	\$ 13.301	€ 12.259	0	(163)	(163)	(0,31)
	08.2024	14.150	13.187	5	0	5	0,01
SSB	07.2024	€ 12.775	\$ 13.687	0	(5)	(5)	(0,01)
	08.2024	\$ 13.707	€ 12.775	5	0	5	0,01
UAG	07.2024	€ 83	\$ 90	1	0	1	0,00
				\$ 44	\$ (549)	\$ (505)	(0,96)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2024	£ 71	\$ 89	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2024	\$ 83	£ 65	0	0	0	0,00
	08.2024	89	71	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	£ 70	\$ 88	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 89	£ 70	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	88	70	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	89	70	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1	\$ (2)	\$ (1)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (394) (0,75)

Summe Anlagen

\$ 56.256 106,42

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (3.394) (6,42)

Nettovermögen

\$ 52.862 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,29 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Altice France S.A.	11,500 %	01.02.2027	20.12.2023	\$ 160	\$ 132	0,25

- (h) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 162 USD (31. Dezember 2023: null USD) und Barmittel in Höhe von 200 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 398 USD (31. Dezember 2023: 367 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

#### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 51.216	\$ 23	\$ 51.239
Investmentfonds	5.023	0	0	5.023
Pensionsgeschäfte	0	402	0	402
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(10)	(398)	0	(408)
<b>Summen</b>	<b>\$ 5.013</b>	<b>\$ 51.220</b>	<b>\$ 23</b>	<b>\$ 56.256</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 51.082	\$ 24	\$ 51.106
Investmentfonds	5.470	0	0	5.470
Pensionsgeschäfte	0	3.000	0	3.000
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	19	96	0	115
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(970)	0	(970)
<b>Summen</b>	<b>\$ 5.489</b>	<b>\$ 53.208</b>	<b>\$ 24</b>	<b>\$ 58.721</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (85)	\$ 0	\$ (85)	\$ (9)	\$ 0	\$ (9)
BRC	(154)	172	18	10	0	10
CBK	4	0	4	(2)	0	(2)
GLM	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
GST	3	0	3	5	0	5
MBC	13	0	13	36	0	36
MYC	(9)	0	(9)	(12)	0	(12)
MYI	0	(7)	(7)	80	0	80
SCX	(166)	190	24	4	0	4
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
UAG	1	0	1	55	0	55

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	56,54	54,77
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	39,39	34,03
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,01	k. A.
Investmentfonds	9,50	9,50
Pensionsgeschäfte	0,76	5,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,05)	(0,21)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,02	0,11
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,75)	0,29
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(1,69)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Argentinien	0,56	0,53
Australien	0,26	k. A.
Bermuda	0,40	0,37
Brasilien	0,85	0,81
Kanada	0,95	0,64
Cayman-Inseln	0,62	0,56
Chile	0,60	0,40
Kolumbien	0,84	0,96
Costa Rica	0,26	0,24
Tschechische Republik	0,20	k. A.
Dänemark	0,63	0,59
Dominikanische Republik	0,53	0,49
Ecuador	0,53	0,43
Ägypten	0,64	0,50
El Salvador	0,21	0,20
Frankreich	2,53	3,30
Deutschland	1,88	1,10
Ghana	0,34	0,27
Hongkong	k. A.	0,37
Ungarn	0,96	0,67
Indien	0,69	0,46
Indonesien	0,91	0,88
Irland	3,54	1,00
Italien	0,88	1,00
Elfenbeinküste	0,54	0,16
Japan	1,34	1,80
Kasachstan	0,44	0,40
Liberia	0,64	0,59
Luxemburg	0,35	0,64
Mexiko	1,04	0,61
Marokko	0,30	0,29
Multinational	0,28	1,11
Niederlande	3,78	3,43
Oman	0,39	0,36
Panama	1,47	1,37
Paraguay	0,17	0,15
Peru	0,87	0,70
Philippinen	0,48	0,46
Polen	0,92	0,22
Rumänien	1,02	0,70
Senegal	0,34	0,18
Serbien	0,30	0,28
Singapur	0,09	0,09
Südafrika	0,53	0,60
Spanien	1,63	1,98
Sri Lanka	0,22	0,18
Supranational	0,20	k. A.
Schweden	0,49	0,46
Schweiz	0,40	0,37
Türkei	0,39	k. A.
Großbritannien	5,63	4,82
USA	50,64	50,16
Uruguay	0,54	0,52
Usbekistan	0,20	k. A.
Kurzfristige Instrumente	1,50	0,40
Investmentfonds	9,50	9,50
Pensionsgeschäfte	0,76	5,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,05)	(0,21)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,01)	k. A.
Zinsswaps	(0,01)	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,03)	(0,04)
Devisenterminkontrakte	0,24	(0,08)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,96)	0,41
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(1,69)
Sonstige Aktiva und Passiva	(6,42)	(2,01)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN</b>											
American Airlines, Inc. 10,336 % fällig am 20.04.2028	\$ 720	\$ 745	0,02	Athene Global Funding 4,823 % fällig am 23.02.2027	€ 5.200	\$ 5.582	0,16	Digital Dutch Finco BV 1,500 % fällig am 15.03.2030	€ 1.100	1.032	0,03
BCP Modular Services Holdings Ltd. 7,897 % fällig am 15.12.2028	€ 4.900	5.231	0,15	Aviation Capital Group LLC 3,500 % fällig am 01.11.2027	\$ 3.600	3.372	0,10	DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	3.500	3.467	0,10
Caesars Entertainment, Inc. 8,097 % fällig am 06.02.2031	\$ 4.300	4.309	0,12	5,500 % fällig am 15.12.2024	200	200	0,01	EQT AB 2,375 % fällig am 06.04.2028	1.200	1.213	0,03
Carnival Corp. 8,094 % fällig am 08.08.2027	2.213	2.227	0,06	Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	4.290	3.861	0,11	Equinix, Inc. 0,250 % fällig am 15.03.2027	1.500	1.472	0,04
Charter Communications Operating LLC 7,052 % fällig am 01.02.2027	185	185	0,01	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % fällig am 02.03.2026	6.500	7.045	0,20	3,900 % fällig am 15.04.2032	\$ 300	273	0,01
Delos Aircraft DAC 7,052 % fällig am 31.10.2027	1.840	1.852	0,05	Banco Santander S.A. 4,375 % fällig am 14.01.2026 (h)(j)	3.200	3.291	0,09	Everglades Re Ltd. 15,855 % fällig am 13.05.2031	450	448	0,01
Hertz Corp. 8,859 % fällig am 30.06.2028	2.772	2.514	0,07	Bank of America Corp. 2,687 % fällig am 22.04.2032	\$ 200	169	0,00	16,855 % fällig am 13.05.2031	450	448	0,01
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 7,089 % - 7,095 % fällig am 08.11.2030	4.774	4.784	0,14	4,300 % fällig am 28.01.2025 (h)	\$ 3.600	3.540	0,10	18,105 % fällig am 13.05.2031	450	449	0,01
IRB Holding Corp. 8,179 % fällig am 15.12.2027	1.799	1.801	0,05	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025 (h)(j)	€ 3.700	4.036	0,12	Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % fällig am 29.04.2030	2.500	2.385	0,07
LifePoint Health, Inc. 9,329 % fällig am 17.05.2031	2.300	2.306	0,07	Barclays PLC 2,645 % fällig am 24.06.2031	\$ 900	765	0,02	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 5,874 % fällig am 30.11.2026	€ 1.700	2.156	0,06
10,056 % fällig am 16.11.2028	4.190	4.218	0,12	3,330 % fällig am 24.11.2042	3.600	2.587	0,07	Ford Motor Credit Co. LLC 2,330 % fällig am 25.11.2025	€ 200	210	0,01
Modena Buyer LLC TBD % fällig am 18.04.2031	3.100	3.030	0,09	4,337 % fällig am 10.01.2028	300	289	0,01	2,700 % fällig am 10.08.2026	\$ 3.900	3.664	0,10
MPH Acquisition Holdings LLC 9,859 % fällig am 01.09.2028	4.376	3.654	0,10	4,972 % fällig am 16.05.2029	300	294	0,01	2,900 % fällig am 16.02.2028	€ 1.800	1.629	0,05
Nouryon Finance BV 7,215 % fällig am 03.04.2028	€ 5.476	5.851	0,17	5,304 % fällig am 09.08.2026	2.500	2.464	0,07	3,250 % fällig am 15.09.2025	€ 100	106	0,00
Telekom Srbija TBD % fällig am 11.06.2029	7.500	8.001	0,23	5,501 % fällig am 09.08.2028	600	589	0,02	4,535 % fällig am 06.03.2025	€ 200	251	0,01
United Airlines, Inc. TBD % fällig am 21.04.2028	\$ 0	0	0,00	6,375 % fällig am 15.12.2025 (h)(j)	€ 1.700	2.094	0,06	5,800 % fällig am 05.03.2027	\$ 4.600	4.602	0,13
		50.708	1,45	7,125 % fällig am 02.11.2028	\$ 900	1.129	0,03	G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 1.200	1.242	0,04
				7,385 % fällig am 15.06.2025 (h)(j)	\$ 2.500	2.635	0,08	4,250 % fällig am 31.03.2029	1.587	1.643	0,05
				7,437 % fällig am 02.11.2033	2.700	2.971	0,08	6,250 % fällig am 31.03.2030	978	981	0,03
				Bayou Re Ltd. 23,855 % fällig am 30.04.2031	600	591	0,02	Goldman Sachs Group, Inc. 1,875 % fällig am 16.12.2030	€ 2.500	2.610	0,07
				Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 4.400	4.021	0,11	2,615 % fällig am 22.04.2032	\$ 200	168	0,00
				BGC Group, Inc. 4,375 % fällig am 15.12.2025	\$ 1.100	1.071	0,03	3,615 % fällig am 15.03.2028	2.000	1.913	0,05
				Blue Owl Capital Corp. 2,875 % fällig am 11.06.2028	1.900	1.681	0,05	3,691 % fällig am 05.06.2028	300	287	0,01
				Blue Owl Finance LLC 3,125 % fällig am 10.06.2031	4.500	3.752	0,11	5,727 % fällig am 25.04.2030	700	713	0,02
				6,250 % fällig am 18.04.2034	1.500	1.505	0,04	5,798 % fällig am 10.08.2026	4.200	4.203	0,12
				BNP Paribas S.A. 1,904 % fällig am 30.09.2028	7.800	6.969	0,20	Goodman Australia Finance Pty. Ltd. 4,250 % fällig am 03.05.2030	€ 1.300	1.410	0,04
				2,125 % fällig am 23.01.2027	€ 2.400	2.504	0,07	HSBC Holdings PLC 1,750 % fällig am 24.07.2027	€ 3.200	3.761	0,11
				BPCE S.A. 2,125 % fällig am 13.10.2046 (j)	3.800	3.328	0,09	2,357 % fällig am 18.08.2031	\$ 2.200	1.839	0,05
				6,612 % fällig am 19.10.2027	\$ 3.550	3.606	0,10	2,804 % fällig am 24.05.2032	800	670	0,02
				Brown & Brown, Inc. 4,200 % fällig am 15.09.2024	7.500	7.469	0,21	2,871 % fällig am 22.11.2032	5.000	4.160	0,12
				Cape Lookout Re Ltd. 13,355 % fällig am 05.04.2027	3.500	3.466	0,10	3,973 % fällig am 22.05.2030	4.700	4.395	0,13
				CapitaLand Ascendas REIT 0,750 % fällig am 23.06.2028	€ 3.200	3.003	0,09	4,583 % fällig am 19.06.2029	4.170	4.032	0,12
				CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 27.01.2028	2.000	1.891	0,05	4,750 % fällig am 04.07.2029 (h)(j)	€ 2.200	2.213	0,06
				0,900 % fällig am 12.10.2029	2.300	2.086	0,06	5,210 % fällig am 11.08.2028	\$ 2.600	2.584	0,07
				Constellation Insurance, Inc. 6,800 % fällig am 24.01.2030	\$ 3.500	3.425	0,10	6,375 % fällig am 30.03.2025 (h)(j)	500	499	0,01
				Cooperative Rabobank UA 4,375 % fällig am 29.06.2027 (h)(j)	€ 1.800	1.836	0,05	ING Groep NV 5,550 % fällig am 19.03.2035	7.000	6.914	0,20
				5,500 % fällig am 05.10.2026	€ 3.000	3.021	0,09	5,750 % fällig am 16.11.2026 (h)(j)	900	866	0,02
				Coventry Building Society 2,625 % fällig am 07.12.2026	€ 1.100	1.156	0,03	Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % fällig am 16.03.2028	€ 3.100	2.991	0,09
				Credit Suisse AG AT1 Claim 2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 3.100	3.196	0,09	3,250 % fällig am 23.09.2024	\$ 5.800	5.764	0,16
				Cromwell Ereit Lux Finco SARL 3,100 % fällig am 15.11.2029	\$ 250	223	0,01	4,000 % fällig am 23.09.2029	400	369	0,01
				3,800 % fällig am 15.02.2028	\$ 2.250	2.133	0,06	5,148 % fällig am 10.06.2030	€ 1.400	1.636	0,05
				Crown Castle, Inc. 0,625 % fällig am 27.09.2026	€ 1.800	1.796	0,05	JAB Holdings BV 2,200 % fällig am 23.11.2030	\$ 1.638	1.320	0,04
				1,250 % fällig am 21.06.2029	€ 5.100	4.749	0,14	2,200 % fällig am 23.11.2030	€ 1.638	1.320	0,04
				1,500 % fällig am 27.09.2031	1.700	1.493	0,04	JPMorgan Chase & Co. 2,595 % fällig am 24.02.2026	6.400	6.274	0,18
				Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	4.600	4.114	0,12	4,005 % fällig am 23.04.2029	4.500	4.304	0,12
				1,625 % fällig am 20.01.2027	1.900	1.928	0,06	JPMorgan Chase Bank N.A. 5,110 % fällig am 08.12.2026	2.100	2.100	0,06
				2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 1.200	1.496	0,04	Kennedy-Wilson, Inc. 4,750 % fällig am 01.02.2030	3.000	2.493	0,07
								Kizuna RE Pte Ltd. 8,105 % fällig am 09.04.2029	602	607	0,02
								Lazard Group LLC 4,375 % fällig am 11.03.2029	15.300	14.650	0,42
								Legal & General Group PLC 5,625 % fällig am 24.03.2031 (h)(j)	€ 800	902	0,03
								LFS Topco LLC 5,875 % fällig am 15.10.2026	\$ 1.500	1.385	0,04
								Lloyds Banking Group PLC 4,375 % fällig am 22.03.2028	900	872	0,02



BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Las Vegas Sands Corp. 3,900 % fällig am 08.08.2029	\$ 200	\$ 183	0,01	Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	€ 4.600	\$ 4.574	0,13	0,750 % fällig am 25.05.2048 (a)	\$ 1.630	\$ 177	0,01
Melco Resorts Finance Ltd. 5,375 % fällig am 04.12.2029	200	180	0,01	Werfen S.A. 4,250 % fällig am 03.05.2030	400	432	0,01	1,050 % fällig am 25.03.2042 (a)	6.342	647	0,02
MGM China Holdings Ltd. 7,125 % fällig am 26.06.2031	700	704	0,02	WMG Acquisition Corp. 2,250 % fällig am 15.08.2031	2.300	2.155	0,06	1,150 % fällig am 25.11.2035 (a)	45	1	0,00
Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % fällig am 20.06.2027	3.960	3.971	0,11	Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 15.01.2026	\$ 400	392	0,01	1,180 % fällig am 25.10.2038 (a)	118	0	0,00
Motability Operations Group PLC 4,000 % fällig am 17.01.2030	€ 3.400	3.690	0,11	5,500 % fällig am 01.10.2027	200	191	0,01	1,500 % fällig am 25.01.2052 (a)	9.101	917	0,03
MPH Acquisition Holdings LLC 5,500 % fällig am 01.09.2028	\$ 3.300	2.495	0,07			224.648	6,42	2,000 % fällig am 25.11.2050 - 25.07.2052 (a)	37.843	4.661	0,13
Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 10.100	9.945	0,28	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				2,230 % fällig am 25.06.2043 (a)	4.428	289	0,01
Nidec Corp. 0,046 % fällig am 30.03.2026	1.100	1.111	0,03	AES Corp. 2,450 % fällig am 15.01.2031	2.200	1.812	0,05	2,500 % fällig am 25.07.2037 (a)	42.548	3.269	0,09
Nissan Motor Co. Ltd. 3,522 % fällig am 17.09.2025	\$ 7.500	7.280	0,21	CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 1,500 % fällig am 17.10.2031	€ 2.500	2.273	0,06	3,000 % fällig am 25.08.2043 - 25.02.2052 (a)	51.865	8.157	0,23
4,345 % fällig am 17.09.2027	1.700	1.624	0,05	4,700 % fällig am 30.11.2031	€ 2.500	2.309	0,07	3,500 % fällig am 25.01.2051 (a)	15.538	2.736	0,08
4,810 % fällig am 17.09.2030	500	465	0,01	Electricite de France S.A. 4,125 % fällig am 17.06.2031	€ 1.900	2.054	0,06	4,584 % fällig am 25.03.2036	212	229	0,01
Penske Truck Leasing Co. LP 3,950 % fällig am 10.03.2025	2.000	1.976	0,06	Entergy Corp. 2,400 % fällig am 15.06.2031	\$ 300	248	0,01	5,588 % fällig am 25.03.2034	21	20	0,00
Petroleos Mexicanos 6,700 % fällig am 16.02.2032	4.981	4.174	0,12	EPH Financing International A/S 4,625 % fällig am 15.07.2027	€ 3.000	3.225	0,09	5,590 % fällig am 25.02.2032	22	22	0,00
10,000 % fällig am 07.02.2033	900	904	0,03	Georgia Power Co. 5,875 % fällig am 30.11.2029	\$ 1.200	1.161	0,03	5,620 % fällig am 25.11.2032	6	5	0,00
Prosus NV 3,680 % fällig am 21.01.2030	600	533	0,02	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 4,625 % fällig am 15.07.2027	350	344	0,01	5,795 % fällig am 01.12.2034	2	2	0,00
Sabine Pass Liquefaction LLC 4,200 % fällig am 15.03.2028	4.000	3.860	0,11	ONEOK, Inc. 4,350 % fällig am 15.03.2029	100	96	0,00	5,800 % fällig am 25.03.2037	16	16	0,00
5,000 % fällig am 15.03.2027	800	793	0,02	Pacific Gas & Electric Co. 3,000 % fällig am 15.06.2028	2.400	2.195	0,06	5,850 % fällig am 25.09.2032	2	2	0,00
Sandoz Finance BV 4,220 % fällig am 17.04.2030	€ 3.200	3.504	0,10	3,150 % fällig am 01.01.2026	500	482	0,01	5,898 % fällig am 18.10.2030	3	3	0,00
Sands China Ltd. 2,850 % fällig am 08.03.2029	\$ 900	793	0,02	3,250 % fällig am 01.06.2031	2.400	2.065	0,06	5,959 % fällig am 01.02.2035	3	3	0,00
3,250 % fällig am 08.08.2031	1.100	927	0,03	3,300 % fällig am 01.12.2027	3.000	2.798	0,08	6,314 % fällig am 01.11.2042	9	9	0,00
5,400 % fällig am 08.08.2028	7.800	7.642	0,22	3,500 % fällig am 01.08.2050	200	196	0,01	Freddie Mac 0,000 % fällig am 15.08.2042	1.010	695	0,02
Sartorius Finance BV 4,375 % fällig am 14.09.2029	€ 700	769	0,22	4,300 % fällig am 15.03.2045	500	385	0,01	0,260 % fällig am 15.12.2050 (a)	35.503	1.304	0,04
4,875 % fällig am 14.09.2035	600	670	0,02	4,550 % fällig am 01.07.2030	4.100	3.888	0,11	0,482 % fällig am 15.12.2037 (a)	262	18	0,00
Schaeffler AG 4,500 % fällig am 28.03.2030	3.200	3.394	0,10	4,950 % fällig am 08.06.2025	1.500	1.487	0,04	0,650 % fällig am 25.06.2050 (a)	8.312	908	0,03
Scripps Escrow, Inc. 5,375 % fällig am 15.01.2031	\$ 1.600	711	0,02	5,450 % fällig am 15.06.2027	200	200	0,01	0,700 % fällig am 25.06.2050 (a)	11.109	1.278	0,04
Southern Co. 3,700 % fällig am 30.04.2030	400	369	0,01	6,150 % fällig am 15.01.2033	3.800	3.863	0,11	0,702 % fällig am 15.07.2047 (a)	119	14	0,00
Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	600	529	0,02	Southern California Gas Co. 2,950 % fällig am 15.04.2027	1.900	1.790	0,05	1,162 % fällig am 15.04.2042 (a)	130	12	0,00
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 1.000	1.062	0,03	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		743.945	21,26	1,500 % fällig am 25.12.2035 (a)	7.461	320	0,01
T-Mobile USA, Inc. 2,250 % fällig am 15.11.2031	\$ 2.300	1.881	0,05	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				2,000 % fällig am 25.12.2050 - 25.06.2052 (a)	60.229	7.577	0,22
3,300 % fällig am 15.02.2051	2.700	1.824	0,05	Southwest Airlines Co. 1,250 % fällig am 01.05.2025	7.500	7.536	0,21	3,000 % fällig am 25.10.2049 - 15.10.2052 (a)	32.051	5.603	0,16
3,875 % fällig am 15.04.2030	4.200	3.927	0,11	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,500 % fällig am 25.04.2050 - 25.05.2051 (a)	17.095	3.211	0,09
TD SYNnex Corp. 2,375 % fällig am 09.08.2028	5.800	5.169	0,15	California State General Obligation Bonds, (BABs), (AGM/CR Insured), Series 2010	2.345	2.443	0,07	4,000 % fällig am 15.01.2033 - 25.07.2050 (a)	15.643	3.102	0,09
TDF Infrastructure SASU 1,750 % fällig am 01.12.2029	€ 6.400	6.032	0,17	Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010	643	690	0,02	4,000 % fällig am 01.07.2047 (a)	96	89	0,00
Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,875 % fällig am 29.05.2026	2.200	2.243	0,06	Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007	23.300	2.140	0,06	5,730 % fällig am 25.09.2031	385	385	0,01
Thales S.A. 4,125 % fällig am 18.10.2028	1.500	1.637	0,05	Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020	1.500	1.275	0,04	6,553 % fällig am 25.07.2044	290	269	0,01
Thames Water Utilities Finance PLC 4,375 % fällig am 18.01.2031	700	648	0,02	3,151 % fällig am 01.06.2032	800	671	0,02	Ginnie Mae 3,500 % fällig am 15.07.2045	10.211	9.205	0,26
4,375 % fällig am 03.07.2034	400	401	0,01	3,301 % fällig am 01.06.2033				3,625 % fällig am 25.09.2031	93	91	0,00
5,125 % fällig am 28.09.2037	800	835	0,02	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				3,750 % fällig am 20.11.2029	1	1	0,00
6,500 % fällig am 09.02.2032	400	446	0,01	Fannie Mae 0,032 % fällig am 25.11.2046 (a)	4.539	84	0,00	4,000 % fällig am 20.10.2042 (a)	3.226	524	0,02
7,125 % fällig am 30.04.2031	700	786	0,02	0,450 % fällig am 25.12.2056 (a)	3.257	421	0,01	4,000 % fällig am 15.02.2052 - 15.03.2052	4.093	3.832	0,11
United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029	\$ 2.369	2.378	0,07	0,463 % fällig am 25.07.2042 (a)	17.799	246	0,01	4,500 % fällig am 20.10.2045 (a)	2.144	421	0,01
United Airlines, Inc. 4,625 % fällig am 15.04.2029	200	186	0,01	0,600 % fällig am 25.07.2059 (a)	8.154	770	0,02	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.04.2037 - 01.07.2048	3.000	2.777	0,08
Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 01.11.2033	6.400	5.460	0,16	0,611 % fällig am 25.06.2042 (a)	13.897	136	0,00	4,000 % fällig am 01.05.2047 - 01.03.2049	11.268	10.119	0,29
6,250 % fällig am 15.01.2030	4.800	4.874	0,14	0,650 % fällig am 25.07.2050 (a)	3.886	395	0,01	4,500 % fällig am 01.04.2028	8.235	7.712	0,22
Vmed O2 UK Financing PLC 4,500 % fällig am 15.07.2031	£ 2.800	2.928	0,08	0,700 % fällig am 25.07.2043 - 25.09.2060 (a)	12.072	719	0,02	5,500 % fällig am 01.07.2026 - 01.08.2040	3	3	0,00
								6,000 % fällig am 01.10.2025 - 01.05.2041	391	393	0,01
								6,000 % fällig am 01.10.2025 - 01.05.2041	207	209	0,01
								Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2054	119.800	106.060	3,03
								4,000 % fällig am 01.07.2054 - 01.08.2054	160.200	146.663	4,19
								4,500 % fällig am 01.07.2054 - 01.08.2054	120.300	113.448	3,24
								5,000 % fällig am 01.07.2054 - 01.09.2054	1.037.500	1.002.857	28,66
								5,500 % fällig am 01.08.2054	135.100	133.237	3,81
								6,000 % fällig am 01.08.2054	77.500	77.691	2,22
								6,500 % fällig am 01.08.2054	68.400	69.581	1,99
									1.733.614	49,55	
								<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
								U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g) 0,625 % fällig am 15.07.2032	79.200	71.051	2,03

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
1,125 % fällig am 15.01.2033	\$ 72.411	\$ 67.026	1,92	4,266 % fällig am 25.11.2036	\$ 1.098	\$ 495	0,01	5,873 % fällig am 20.05.2046	\$ 277	\$ 231	0,01
1,375 % fällig am 15.07.2033	67.923	64.168	1,83	4,386 % fällig am 25.11.2036	2.989	1.615	0,05	5,940 % fällig am 25.01.2037	1.983	1.582	0,05
U.S. Treasury Notes				4,401 % fällig am 25.09.2034	56	49	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2035	1.218	846	0,02
0,250 % fällig am 31.08.2025	12.200	11.545	0,33	4,427 % fällig am 25.03.2036	219	173	0,01	6,000 % fällig am 25.04.2036	574	269	0,01
		213.790	6,11	4,610 % fällig am 25.05.2036	486	229	0,01	6,000 % fällig am 25.04.2036	116	54	0,00
				5,310 % fällig am 25.05.2035	262	242	0,01	6,000 % fällig am 25.04.2036	91	46	0,00
				5,769 % fällig am 25.01.2034	36	32	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2036	526	184	0,01
				5,780 % fällig am 25.02.2034	103	94	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2036	117	66	0,00
				5,800 % fällig am 25.08.2036	165	147	0,00	6,000 % fällig am 25.12.2036	1.242	499	0,01
				5,860 % fällig am 25.02.2034	509	453	0,01	6,000 % fällig am 25.02.2037	226	95	0,00
				5,900 % fällig am 25.04.2036	375	325	0,01	6,000 % fällig am 25.03.2037	288	103	0,00
				5,940 % fällig am 25.02.2036	267	231	0,01	6,000 % fällig am 25.04.2037	554	257	0,01
				Bear Stearns Mortgage Funding Trust				6,000 % fällig am 25.05.2037	92	43	0,00
				5,640 % fällig am 25.06.2037	548	489	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2037	641	306	0,01
				Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				6,020 % fällig am 25.02.2037	689	550	0,02
				4,200 % fällig am 26.12.2046	392	298	0,01	6,040 % fällig am 25.02.2036	1.582	1.354	0,04
				Canada Square Funding PLC				6,097 % fällig am 20.11.2035	19	16	0,00
				6,083 % fällig am 17.01.2059	£ 1.895	2.397	0,07	6,153 % fällig am 25.12.2035	2.049	1.665	0,05
				Chase Mortgage Finance Trust				6,360 % fällig am 25.12.2036	639	219	0,01
				4,520 % fällig am 25.03.2037	\$ 304	275	0,01	6,500 % fällig am 25.08.2032	37	36	0,00
				4,675 % fällig am 25.03.2037	24	22	0,00	6,500 % fällig am 25.09.2037	547	206	0,01
				6,181 % fällig am 25.02.2037	11	10	0,00	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
				ChaseFlex Trust				3,771 % fällig am 25.04.2035	28	21	0,00
				6,060 % fällig am 25.07.2037	10	9	0,00	3,959 % fällig am 20.05.2036	580	533	0,02
				ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust				4,059 % fällig am 20.02.2036	432	379	0,01
				4,247 % fällig am 25.08.2037	512	387	0,01	4,545 % fällig am 20.05.2036	333	305	0,01
				4,247 % fällig am 25.08.2037	228	168	0,01	5,250 % fällig am 25.12.2027	20	12	0,00
				Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				5,500 % fällig am 25.11.2035	4	2	0,00
				5,640 % fällig am 25.05.2036	23	21	0,00	5,750 % fällig am 25.02.2037	351	150	0,00
				Citicorp Mortgage Securities Trust				5,750 % fällig am 25.05.2037	22	11	0,00
				6,000 % fällig am 25.09.2037	25	23	0,00	5,750 % fällig am 25.08.2037	2.070	1.067	0,03
				Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.				5,920 % fällig am 25.05.2035	32	27	0,00
				5,960 % fällig am 25.05.2032	24	23	0,00	6,000 % fällig am 25.09.2037	83	42	0,00
				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				6,040 % fällig am 25.04.2035	23	21	0,00
				4,284 % fällig am 25.10.2046	281	237	0,01	6,040 % fällig am 25.04.2035	12	10	0,00
				5,149 % fällig am 25.07.2037	8	6	0,00	6,100 % fällig am 25.03.2035	249	213	0,01
				5,731 % fällig am 25.08.2035	35	33	0,00	6,120 % fällig am 25.02.2035	34	29	0,00
				6,175 % fällig am 25.02.2034	6	6	0,00	6,200 % fällig am 25.02.2035	717	599	0,02
				6,238 % fällig am 25.03.2034	45	39	0,00	6,241 % fällig am 20.07.2034	70	65	0,00
				6,830 % fällig am 25.09.2035	0	0	0,00	6,500 % fällig am 25.12.2037	1.432	581	0,02
				7,336 % fällig am 25.09.2037	16	15	0,00	7,884 % fällig am 20.02.2036	21	18	0,00
				7,410 % fällig am 25.05.2035	40	38	0,00	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
				7,860 % fällig am 25.11.2035	64	61	0,00	6,500 % fällig am 25.11.2034	11	11	0,00
				CitiMortgage Alternative Loan Trust				6,500 % fällig am 25.03.2035	332	314	0,01
				6,000 % fällig am 25.09.2036	1.381	1.139	0,03	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
				6,000 % fällig am 25.01.2037	1.006	806	0,02	6,000 % fällig am 25.01.2036	480	287	0,01
				6,000 % fällig am 25.06.2037	1.467	1.145	0,03	6,056 % fällig am 25.03.2032	24	22	0,00
				6,000 % fällig am 25.10.2037	620	540	0,02	6,500 % fällig am 25.04.2033	3	3	0,00
				Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates			
				6,000 % fällig am 25.05.2036	94	51	0,00	6,852 % fällig am 25.10.2033	5	5	0,00
				Countrywide Alternative Loan Trust				Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
				0,000 % fällig am 25.12.2035 (a)	1.075	49	0,00	3,199 % fällig am 30.11.2037	3.375	3.015	0,09
				5,000 % fällig am 25.03.2035	5	4	0,00	4,840 % fällig am 25.06.2050	1.646	1.414	0,04
				5,500 % fällig am 25.04.2035	117	80	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
				5,500 % fällig am 25.09.2035	227	134	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2037	3.711	1.610	0,05
				5,500 % fällig am 25.11.2035	169	95	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2036	43	16	0,00
				5,500 % fällig am 25.12.2035	106	45	0,00	7,000 % fällig am 25.08.2037	372	182	0,01
				5,500 % fällig am 25.12.2035	3.012	1.843	0,05	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
				5,500 % fällig am 25.01.2037	1.077	462	0,01	5,600 % fällig am 25.07.2047	358	324	0,01
				5,500 % fällig am 25.12.2035	20	11	0,00	5,760 % fällig am 25.03.2037	216	189	0,01
				5,500 % fällig am 25.01.2036	20	11	0,00	5,760 % fällig am 25.09.2047	627	512	0,02
				5,500 % fällig am 25.05.2036	385	296	0,01	6,120 % fällig am 25.08.2037	1.301	1.022	0,03
				5,633 % fällig am 20.02.2047	295	226	0,01	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
				5,643 % fällig am 20.03.2047	4.584	3.687	0,11	5,643 % fällig am 19.10.2036	578	484	0,01
				5,648 % fällig am 20.12.2046	10.119	8.660	0,25	6,146 % fällig am 19.07.2044	153	139	0,00
				5,660 % fällig am 25.04.2047	165	155	0,01	Dutch Property Finance BV			
				5,733 % fällig am 20.09.2046	553	412	0,01	4,514 % fällig am 28.07.2054	€ 1.028	1.103	0,03
				5,740 % fällig am 25.06.2037	628	537	0,02	EMF-NL Prime BV			
				5,740 % fällig am 25.04.2047	1.143	995	0,03	4,688 % fällig am 17.04.2041	800	837	0,02
				5,750 % fällig am 25.02.2035	130	86	0,00	Eurosail PLC			
				5,750 % fällig am 25.07.2035	646	391	0,01	3,989 % fällig am 13.03.2045	3.632	3.757	0,11
				5,750 % fällig am 25.05.2036	428	159	0,01	5,603 % fällig am 13.03.2045	£ 7.250	8.840	0,25
				5,750 % fällig am 25.03.2037	372	195	0,01	5,833 % fällig am 10.06.2044	4.816	5.978	0,17
				5,780 % fällig am 25.09.2047	505	446	0,01	6,303 % fällig am 13.06.2045	10.049	12.462	0,36
				5,800 % fällig am 25.05.2047	523	437	0,01	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
				5,820 % fällig am 25.05.2047	735	667	0,02	4,725 % fällig am 25.01.2036	\$ 300	146	0,00
				5,830 % fällig am 25.02.2037	1.931	580	0,02	5,818 % fällig am 25.09.2034	30	29	0,00
				5,840 % fällig am 25.07.2046	274	272	0,01	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust			
				5,840 % fällig am 25.09.2046	15	14	0,00	6,231 % fällig am 25.08.2035	23	16	0,00
				5,873 % fällig am 20.03.2046	48	40	0,00				







## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>OPTIONSSCHEINE</b>											
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071 (k)	1	\$ 0	0,00	TER Finance Jersey Ltd. 7,020 % fällig am 02.01.2025 (e)(f)	\$ 1.500	\$ 1.447	0,04	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (i)	1.496.908	\$ 14.520	0,42
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>											
Nationwide Building Society 10,250 %	7.094	1.172	0,03	U.S. TREASURY BILLS 5,365 % fällig am 30.07.2024 (b)(e)(f)(m)	84.100	83.745	2,40	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (i)	10.035.127	102.258	2,92
	PARI (000S)			Summe kurzfristige Instrumente		101.232	2,90	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)	10.123.168	100.883	2,88
<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>											
<b>COMMERCIAL PAPER</b>											
AES Corp. 5,900 % fällig am 23.07.2024	\$ 14.700	14.638	0,42	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 3.808.846	108,86			225.468	6,44
<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>											
Gateway Re Ltd. 5,355 % fällig am 23.12.2028	1.500	1.402	0,04	<b>INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>							
				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (i)	770.713	7.807	0,22	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
								PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (i)	1.244.050	124.473	3,56
								Summe Investmentfonds		\$ 349.941	10,00

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOM	4,710 %	26.06.2024	03.07.2024	CAD 200.000	Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2064	\$ (145.966)	\$ 146.162	\$ 146.256	4,18
BRC	5,430	28.06.2024	01.07.2024	\$ 166.800	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % - 2,375 % fällig am 15.01.2025 - 15.01.2031	(170.132)	166.800	166.875	4,77
CEW	4,720	24.06.2024	02.07.2024	CAD 410.000	Province of Ontario 3,650 % - 4,150 % fällig am 02.06.2033 - 02.12.2054	(283.990)	299.632	299.902	8,56
	4,720	25.06.2024	03.07.2024	20.000	Province of Quebec 1,500 % fällig am 01.09.2031	(17.259)			
	4,720	27.06.2024	05.07.2024	50.000	Province of Ontario 2,600 % fällig am 02.06.2027	(14.928)	14.616	14.627	0,42
	4,720	28.06.2024	08.07.2024	190.000	Province of Ontario 1,900 % - 2,900 % fällig am 02.12.2046 - 02.12.2051	(122.668)	138.853	138.907	3,97
	4,720	28.06.2024	08.07.2024	190.000	Province of Quebec 4,250 % fällig am 01.12.2043	(18.448)			
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	\$ 2.211	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.01.2026	(2.255)	2.211	2.211	0,06
MEI	4,710	25.06.2024	03.07.2024	CAD 20.000	Canada Government International Bond 3,000 % fällig am 01.06.2034	(14.749)	14.616	14.627	0,42
	4,710	26.06.2024	03.07.2024	190.000	Canada Government International Bond 1,500 % - 4,500 % fällig am 01.11.2025 - 01.12.2031	(140.906)	138.853	138.943	3,97
SAL	5,340	28.06.2024	01.07.2024	\$ 10.200	U.S. Treasury Notes 5,000 % fällig am 30.09.2025	(10.532)	10.200	10.205	0,29
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (978.863)</b>	<b>\$ 968.483</b>	<b>\$ 969.112</b>	<b>27,68</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	337	\$ 209	0,01
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	918	(880)	(0,03)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	634	(1.112)	(0,03)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	1.154	(577)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	2.230	675	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	2.475	1.167	0,03
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	1.879	(623)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	3.597	(2.481)	(0,07)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	566	(351)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	877	(1.170)	(0,03)
				<b>\$ (5.143)</b>	<b>(0,15)</b>
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (5.143)</b>	<b>(0,15)</b>

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	\$ 500	\$ (63)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.700	(18)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	300	7	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	100	1	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	€ 7.000	11	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	\$ 4.300	25	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	400	4	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	€ 4.300	89	0,00
				\$ 56	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 87	\$ (6)	0,00
CDX.HY-41 5-Year Index	(5,000)	20.12.2028	48.114	(282)	(0,01)
				\$ (288)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 41 5-Year Index	5,000 %	20.06.2029	€ 13.000	\$ (234)	(0,01)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,700 %	28.03.2034	£ 2.100	\$ 58	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	87.600	(496)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,550	14.09.2028	¥ 28.270.000	232	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	19.09.2028	\$ 62.000	(743)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,725	19.09.2028	59.800	(722)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	24.100	3.779	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,827	03.07.2028	85.800	(9.529)	(0,27)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,842	19.09.2053	12.500	415	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,857	15.07.2032	29.320	(4.917)	(0,14)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,874	19.09.2053	11.700	367	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,999	03.07.2053	17.500	5.038	0,14
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	27.10.2028	38.000	(3.390)	(0,10)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	10.12.2029	40	5	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,060	27.10.2053	7.600	2.233	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,250	20.06.2028	104.830	1.777	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	3.700	(72)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	3.700	(67)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	3.700	(67)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	2.500	(296)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	3.700	(60)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	3.700	(58)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	3.700	(57)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,545	31.10.2030	7.700	246	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,550	31.10.2030	1.400	44	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,572	31.10.2030	98.400	2.983	0,08
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,592	31.10.2030	241.500	7.037	0,20
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,594	09.01.2034	4.300	161	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,595	31.10.2030	20.900	606	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,600	17.01.2034	2.700	111	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,601	31.10.2030	18.500	530	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,602	31.10.2030	49.300	1.407	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,606	31.10.2030	46.900	1.328	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,620	31.01.2034	2.000	(60)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,623	31.10.2030	20.300	554	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,648	08.01.2034	5.000	188	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.03.2034	2.400	(63)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,655	24.01.2034	2.700	(75)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,664	31.10.2030	13.400	334	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,665	24.01.2034	2.600	(70)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,670	08.01.2034	6.100	219	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,677	31.10.2030	10.900	264	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,685	24.01.2034	5.800	(146)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,687 %	31.10.2030	\$ 45.000	\$ 1.061	0,03	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,691	31.10.2030	21.300	497	0,01	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,710	05.03.2034	2.900	(63)	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,721	31.10.2030	43.900	946	0,03	
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,725	07.02.2034	3.500	(71)	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	23.01.2034	1.800	(38)	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,738	23.01.2034	300	(6)	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,739	31.10.2030	15.700	322	0,01	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,749	31.10.2030	29.000	578	0,02	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	10.800	(146)	0,00	
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	162.200	767	0,02	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	3.200	93	0,00	
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,783	07.02.2034	3.800	(59)	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	7.400	(124)	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	3.200	77	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	3.200	70	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	6.000	124	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,860	21.02.2034	9.300	(84)	0,00	
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	10.04.2034	5.100	(22)	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	22.02.2029	8.000	(77)	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	5.800	75	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	16.04.2034	300	0	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	3.400	22	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,078	29.04.2034	2.700	28	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	17.04.2034	7.400	77	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	05.06.2034	8.700	(44)	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,085	22.04.2034	7.400	86	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,090	30.04.2034	15.100	170	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,105	24.04.2034	10.400	133	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,130	03.05.2034	6.900	100	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	22.04.2034	6.800	112	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	17.000	176	0,01	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,768	04.01.2027	BRL 926.600	(3.224)	(0,09)	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,496	04.01.2027	109.600	(168)	(0,01)	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,566	04.01.2027	564.000	(535)	(0,02)	
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,691	04.01.2027	1.076.000	641	0,02	
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.06.2032	CAD 45.000	470	0,01	
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	387.200	204	0,01	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	€ 6.700	(471)	(0,01)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	5.800	(387)	(0,01)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	3.400	(237)	(0,01)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	7.200	(433)	(0,01)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	3.500	(209)	(0,01)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	39.700	906	0,03	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	05.03.2034	1.300	(10)	0,00	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	137.900	(1.832)	(0,05)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	04.03.2034	3.100	(21)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	16.04.2029	5.100	(32)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	29.04.2034	1.000	(4)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029	3.700	(19)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,818	26.06.2029	3.000	12	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029	2.700	(7)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,860	24.04.2029	3.500	(6)	0,00	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029	1.600	8	0,00	
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,641	19.02.2029	PLN 59.000	(282)	(0,01)	
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,730	16.02.2029	55.200	(211)	(0,01)	
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,810	16.02.2029	21.700	(64)	0,00	
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,970	21.03.2029	116.200	(129)	0,00	
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,020	21.03.2029	31.700	(12)	0,00	
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,158	22.03.2027	204.500	(127)	0,00	
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,160	21.03.2027	204.100	(133)	0,00	
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,160	16.09.2027	93.100	(1.437)	(0,04)	
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,210	26.04.2027	116.600	(850)	(0,03)	
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,240	23.09.2027	78.600	(1.274)	(0,04)	
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,270	20.09.2027	89.800	(1.479)	(0,04)	
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,280	26.09.2027	26.700	(443)	(0,01)	
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,310	19.09.2027	94.800	(1.597)	(0,05)	
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,985	11.10.2027	113.000	(2.617)	(0,08)	
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,156	13.10.2027	58.300	(1.445)	(0,04)	
					\$	(3.646)	(0,10)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					\$	<b>(4.112)</b>	<b>(0,12)</b>

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,275	06.12.2024	500	\$ 60	\$ 127	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	06.12.2024	380	48	73	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	06.12.2024	900	82	129	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	14.01.2025	870	84	143	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	14.01.2025	900	72	112	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	23.01.2025	900	85	114	0,00
BRC	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	420	45	64	0,00
	Call - OTC USD versus JPY	¥ 153,500	05.07.2024	32.000	180	1.431	0,04
CBK	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,300	14.01.2025	900	94	168	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,450	14.02.2025	900	85	103	0,00
MBC	Call - OTC USD versus CNH	7,350	06.12.2024	900	87	164	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,375	14.02.2025	1.080	106	147	0,01
SCX	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	350	36	53	0,00
					\$ 1.064	\$ 2.828	0,08

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens	
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,725 %	14.11.2024	59.000	\$ 0	\$ 29	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,749	13.11.2024	101.600	0	51	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,754	15.11.2024	42.700	0	23	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,765	18.11.2024	32.600	0	18	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	20.11.2024	42.200	0	28	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	17.12.2024	24.000	0	23	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,820	21.11.2024	42.300	0	30	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,850	22.11.2024	33.600	0	27	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	09.12.2024	60.800	0	68	0,01	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	13.12.2024	20.700	0	25	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,920	25.11.2024	43.500	0	43	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	29.11.2024	54.300	0	59	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	11.12.2024	45.000	0	57	0,00	
								\$ 0	\$ 481	0,01

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus MXN	MXN 18,989	24.07.2024	17.300	\$ (248)	\$ (108)	0,00
BRC	Call - OTC USD versus JPY	¥ 157,250	05.07.2024	64.000	(119)	(1.401)	(0,04)
					\$ (367)	\$ (1.509)	(0,04)

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	9.200	\$ (42)	\$ (12)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	9.200	(41)	0	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,060	28.06.2024	0	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,410	28.06.2024	0	0	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,700	05.07.2024	2.100	(8)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	2.100	(8)	(1)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,586	15.07.2024	6.700	(25)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,986	15.07.2024	6.700	(25)	(37)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	7.000	(27)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	4.500	(18)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	8.900	(27)	(25)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	7.000	(27)	(45)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,994	28.06.2024	0	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	4.500	(18)	(23)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	8.900	(27)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,344	28.06.2024	0	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,300	14.11.2024	6.600	0	(32)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	13.11.2024	11.300	0	(56)	(0,01)
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	15.11.2024	4.700	0	(24)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.11.2024	3.600	0	(19)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,350 %	20.11.2024	4.700	\$ 0	\$ (28)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,353	17.12.2024	2.700	0	(20)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,357	21.11.2024	4.700	0	(29)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,360	22.11.2024	3.700	0	(23)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,395	09.12.2024	6.700	0	(53)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,400	25.11.2024	4.900	0	(35)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,425	13.12.2024	2.300	0	(20)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,465	29.11.2024	6.000	0	(54)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,468	11.12.2024	5.000	0	(49)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	18.07.2024	1.300	(4)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,760	28.06.2024	0	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	18.07.2024	1.300	(4)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,030	28.06.2024	0	0	0	0,00
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,850	05.07.2024	4.900	(12)	(2)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	05.07.2024	4.900	(12)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	3.900	(15)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	3.900	(15)	(21)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,800	03.07.2024	1.700	(7)	(2)	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,150	03.07.2024	1.700	(7)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	5.600	(9)	(13)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	5.600	(9)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	2.800	(10)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	4.000	(17)	(13)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	2.800	(10)	(16)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	4.000	(17)	(5)	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	17.07.2024	4.100	(7)	(3)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	22.07.2024	3.900	(6)	(3)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	200	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	22.07.2024	3.900	(6)	(8)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,970	17.07.2024	4.100	(7)	(6)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	200	0	0	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	2.100	(7)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	2.100	(7)	(10)	0,00
							\$ (483)	\$ (740)	(0,02)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ (2)	\$ 2	\$ 0	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	400	(6)	7	1	0,00
MYC	California State General Obligation Bonds, Series 2003	1,000	20.09.2024	2.900	23	(16)	7	0,00
					\$ 15	\$ (7)	\$ 8	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 800	\$ (24)	\$ 22	\$ (2)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	11.000	(379)	351	(28)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	10.900	(378)	349	(29)	0,00
					\$ (781)	\$ 722	\$ (59)	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2024	NZD	\$ 5.004	\$ 3.064	\$ 15	\$ 15	0,00	
	08.2024	\$	3.064	NZD 5.004	(15)	(15)	0,00	
	10.2024		12.543	CNH 89.774	0	(142)	0,00	
BOA	07.2024	HKD	6.378	\$ 817	0	0	0,00	
	07.2024	KRW	17.841.792	13.042	83	83	0,00	
	07.2024	SGD	271	200	0	0	0,00	
	07.2024	\$	1.195	€ 1.110	0	(5)	0,00	
	07.2024		38.801	PLN 156.247	88	(30)	58	0,00
	07.2024		36.219	SGD 49.140	51	(11)	40	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	PEN	2.581	\$	674	\$	0	0,00
	08.2024	SGD	45.500		33.572		(51)	0,00
	08.2024	TRY	1.329		38		0	0,00
	02.2025	CNH	12.149		1.701		8	0,00
BPS	07.2024	BRL	14.816		2.946		278	0,01
	07.2024	CAD	15.902		11.635		14	0,00
	07.2024	€	6.518		7.014		28	0,00
	07.2024	£	73.119		93.403		973	0,03
	07.2024	¥	204.900		1.312		38	0,00
	07.2024	KRW	17.833.855		12.993		41	0,00
	07.2024	PLN	212.678		52.485		(408)	(0,01)
	07.2024	\$	8.201	AUD	12.308		19	0,00
	07.2024		100	BRL	535		(4)	0,00
	07.2024		5.575	CAD	7.638		(2)	0,00
	07.2024		2.400	IDR	39.323.662		3	0,00
	07.2024		652	ILS	2.417		(10)	0,00
	07.2024		6.412	NZD	10.437		(52)	0,00
	07.2024		6.644	PLN	26.384		(83)	0,00
	08.2024	AUD	12.308	\$	8.208		(19)	0,00
	09.2024	CNH	193.518		27.005		344	0,01
	09.2024	TWD	580.756		18.049		110	0,00
	09.2024	\$	4.918	INR	411.645		7	0,00
	10.2024	CNH	69.183	\$	9.662		106	0,00
	10.2024	\$	2.481	CNH	17.766		(27)	0,00
	12.2024		3.509		25.165		(21)	0,00
BRC	01.2025	CNH	26.930	\$	3.770		27	0,00
	07.2024	AUD	751		497		(5)	0,00
	07.2024	DKK	436		63		1	0,00
	07.2024	MXN	50.465		2.732		(23)	0,00
	07.2024	NOK	437		41		1	0,00
	07.2024	SGD	6.423		4.756		17	0,00
	07.2024	THB	3.670		100		0	0,00
	07.2024	\$	17.966	CAD	24.583		(9)	0,00
	07.2024		4.153	PLN	16.592		(27)	0,00
	07.2024		11.982	TRY	412.535		333	0,01
	08.2024		7.227		251.358		46	0,00
	09.2024	MXN	563.026	\$	29.610		(813)	(0,02)
	09.2024	\$	3.485	TRY	126.293		76	0,00
	02.2025		1.701	CNH	12.143		(9)	0,00
BSH	08.2024	PEN	22.516	\$	5.899		22	0,00
CBK	07.2024	BRL	69.729		12.797		243	0,01
	07.2024	CAD	491.707		359.038		(353)	(0,01)
	07.2024	CHF	4.150		4.560		(58)	0,00
	07.2024	£	797		1.017		10	0,00
	07.2024	KRW	1.298.438		952		9	0,00
	07.2024	MXN	324.389		17.609		(97)	0,00
	07.2024	PEN	44.831		11.853		150	0,00
	07.2024	\$	1.036	CAD	1.427		7	0,00
	07.2024		5.338	£	4.174		(61)	0,00
	07.2024		5.879	PEN	22.412		(29)	0,00
	07.2024		22.589	PLN	89.010		(455)	(0,01)
	07.2024		1.607	TRY	54.179		7	0,00
	07.2024		2.584	ZAR	46.986		(14)	0,00
	07.2024	ZAR	502	\$	27		0	0,00
	08.2024	£	266		336		0	0,00
	08.2024	PEN	14.172		3.699		0	0,00
	08.2024	\$	12.797	BRL	69.963		(246)	(0,01)
	09.2024	TWD	216.160	\$	6.707		30	0,00
	09.2024	\$	31.476	INR	2.631.505		(11)	0,00
DUB	01.2025		3.770	CNH	26.914		(29)	0,00
	07.2024	AUD	1.441	\$	954		(9)	0,00
	07.2024	BRL	528		100		5	0,00
	07.2024	CAD	7.100		5.172		(17)	0,00
	07.2024	IDR	815.550		50		0	0,00
	07.2024	KRW	9.678.467		7.035		5	0,00
	07.2024	\$	6.987	PLN	27.458		(158)	(0,01)
	08.2024		4.655	BRL	23.961		(357)	(0,01)
	03.2025		812	TRY	38.638		98	0,00
FAR	07.2024	AUD	12.299	\$	8.194		(19)	0,00
	07.2024	CAD	25.026		18.267		(23)	0,00
	07.2024	€	577.742		629.250		10.056	0,29
	07.2024	NZD	9.616		5.865		5	0,00
	07.2024	\$	2.767	¥	440.824		(26)	0,00
	07.2024		543	NZD	881		(6)	0,00
	08.2024	¥	438.756	\$	2.767		26	0,00
	08.2024	\$	5.865	NZD	9.616		(5)	0,00
GLM	07.2024	BRL	266.600	\$	53.825		5.827	0,17
	07.2024	KRW	11.549		8		0	0,00
	07.2024	MXN	48.354		2.604		(35)	0,00
	07.2024	\$	48.522	BRL	262.500		(1.262)	(0,04)
	07.2024		150	KRW	206.069		0	0,00
	07.2024		17.770	MXN	324.806		(42)	0,00
	07.2024		4.432	PLN	17.509		(77)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2024	ZAR	108.352	\$	5.922	\$	0	0,00
	08.2024	\$	5.244	TRY	180.970		32	0,00
	09.2024		995		39.764		133	0,00
	04.2025	BRL	283.100	\$	50.743		1.318	0,04
JPM	07.2024		56.918		10.545		297	0,01
	07.2024	CHF	2.484		2.746		0	0,00
	07.2024	CNY	22.314		3.129		34	0,00
	07.2024	IDR	15.849.119		977		9	0,00
	07.2024	KRW	11.956.056		8.668		0	0,00
	07.2024	SGD	42.325		31.445		215	0,01
	07.2024	\$	752	BRL	4.100		0	0,00
	07.2024		35.094	CHF	31.493		0	0,00
	07.2024		57	CNY	408		0	0,00
	07.2024		94	DKK	658		0	0,00
	07.2024		8.021	€	7.357		0	0,00
	07.2024		1.747	ILS	6.460		0	0,00
	07.2024		16	KRW	22.687		0	0,00
	07.2024		3.879	PLN	15.237		2	0,00
	07.2024		8.628	TRY	292.230		238	0,01
	07.2024	ZAR	205.243	\$	11.149		0	0,00
	08.2024	CHF	31.377		35.094		46	0,00
	08.2024	DKK	657		94		0	0,00
	08.2024	\$	3.129	CNY	22.328		0	0,00
	08.2024		5.744	TRY	200.390		124	0,00
	09.2024	TWD	367.761	\$	11.423		64	0,00
	09.2024	\$	9.699	BRL	53.014		0	(0,01)
	09.2024		7.486	INR	626.839		14	0,00
	09.2024		30.227	MXN	547.009		0	(0,02)
	10.2024	CNH	96.699	\$	13.512		155	0,00
	10.2024	\$	2.480	CNH	17.712		0	0,00
	11.2024		826	TRY	32.596		42	0,00
	12.2024	CNH	25.177	\$	3.509		19	0,00
	03.2025	\$	705	TRY	34.138		100	0,00
MBC	04.2025	BRL	4.400	\$	783		15	0,00
	07.2024	CAD	251.198		183.668		198	0,00
	07.2024	€	2.402		2.615		41	0,00
	07.2024	£	86		109		0	0,00
	07.2024	HUF	75.344		202		0	0,00
	07.2024	¥	236.300		1.500		31	0,00
	07.2024	SGD	132		98		1	0,00
	07.2024	\$	57.803	CAD	79.161		59	0,00
	07.2024		633.752	€	592.679		1.452	0,04
	07.2024		1.187	£	938		0	0,00
	07.2024		32	NOK	340		0	0,00
	08.2024	CAD	64.577	\$	47.197		0	0,00
	08.2024	€	592.679		634.678		0	(0,04)
	08.2024	NOK	339		32		0	0,00
	09.2024	TWD	16.289		506		3	0,00
	12.2024	CNH	24.268		3.400		36	0,00
	12.2024	\$	3.400	CNH	24.259		0	0,00
MYI	07.2024	CHF	25	\$	28		0	0,00
	07.2024	€	5.058		5.420		2	0,00
	07.2024	£	812		1.026		1	0,00
	07.2024	\$	28.201	BRL	145.670		0	(0,06)
	07.2024		2.283	CAD	3.123		0	0,00
	07.2024		65	DKK	452		0	0,00
	07.2024		29	€	27		0	0,00
	07.2024		1.209	£	956		0	0,00
	07.2024		6.495	NZD	10.590		0	0,00
	08.2024	DKK	451	\$	65		0	0,00
	09.2024	TWD	146.298		4.560		41	0,00
	09.2024	\$	2.534	INR	211.880		1	0,00
RBC	07.2024		1.403	CAD	1.928		6	0,00
	07.2024		87.359	£	68.890		0	(0,01)
	08.2024	£	68.890	\$	87.374		275	0,01
RYL	07.2024	€	5.575		5.964		0	0,00
	07.2024	\$	1.456	AUD	2.183		2	0,00
SCX	07.2024	€	4.630	\$	4.974		12	0,00
	07.2024	IDR	820.600		50		0	0,00
	07.2024	KRW	9.043.799		6.631		63	0,00
	07.2024	\$	2.095	CAD	2.864		0	0,00
	07.2024		3.078	CNY	21.890		0	0,00
	07.2024		103	ZAR	1.905		1	0,00
	08.2024	PEN	5.810	\$	1.517		0	0,00
	09.2024	CNH	77.352		10.782		125	0,00
	09.2024	TWD	230.679		7.157		32	0,00
	09.2024	\$	26.119	INR	2.186.048		39	0,00
SSB	07.2024	CAD	7.000	\$	5.135		20	0,00
TOR	07.2024		3.900		2.850		1	0,00
	07.2024	CHF	109		120		0	0,00
	07.2024	NZD	7.288		4.464		23	0,00
	08.2024	CAD	600		439		0	0,00
	08.2024	\$	2.708	COP	10.860.531		0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	\$ 4.464	NZD 7.288	\$ 0	\$ (23)	\$ (23)	0,00
UAG	07.2024	CAD 390.352	\$ 285.942	663	0	663	0,02
	07.2024	CHF 24.768	27.408	0	(154)	(154)	0,00
	07.2024	DKK 675	98	1	0	1	0,00
	07.2024	ILS 8.484	2.289	36	0	36	0,00
	07.2024	\$ 19	CHF 17	0	0	0	0,00
	08.2024	CHF 17	\$ 19	0	0	0	0,00
				\$ 25.318	\$ (10.814)	\$ 14.504	0,41

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD 4.585	\$ 3.054	\$ 0	\$ (8)	\$ (8)	0,00
	07.2024	\$ 4.238	AUD 6.363	12	0	12	0,00
	08.2024	3.056	4.585	8	0	8	0,00
BOA	07.2024	AUD 31	\$ 20	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	4.639	3.091	0	(8)	(8)	0,00
	08.2024	\$ 3.057	AUD 4.585	7	0	7	0,00
BRC	07.2024	AUD 21	\$ 14	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	178	118	0	(1)	(1)	0,00
DUB	07.2024	10	7	0	0	0	0,00
FAR	07.2024	4.280	2.855	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	\$ 3.176	AUD 4.767	8	0	8	0,00
	08.2024	2.857	4.280	4	0	4	0,00
GLM	07.2024	AUD 186	\$ 124	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2024	73	49	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 4	AUD 6	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	AUD 20	\$ 13	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	15	10	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	13	9	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	\$ 1.938	AUD 2.913	8	0	8	0,00
				\$ 47	\$ (22)	\$ 25	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	\$ 1.808	CAD 2.474	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	07.2024	CAD 3.633	\$ 2.655	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2.669	CAD 3.635	0	(12)	(12)	0,00
	08.2024	2.655	3.631	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	CAD 7.325	\$ 5.351	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	\$ 2.136	CAD 2.908	0	(10)	(10)	0,00
	08.2024	5.351	7.320	3	0	3	0,00
MYI	07.2024	1.423	1.943	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 3	\$ (29)	\$ (26)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 3.274	CHF 2.945	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
CBK	07.2024	323	294	4	0	4	0,00
GLM	07.2024	3	2	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	CHF 3.565	\$ 3.976	9	0	9	0,00
	08.2024	\$ 3.742	CHF 3.345	0	(5)	(5)	0,00
MYI	07.2024	CHF 2	\$ 2	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	16	18	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 33	CHF 29	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	3.768	3.404	20	0	20	0,00
UAG	07.2024	CHF 3.347	\$ 3.730	6	0	6	0,00
	07.2024	\$ 3.726	CHF 3.367	21	0	21	0,00
	08.2024	3.730	3.335	0	(6)	(6)	0,00
				\$ 63	\$ (11)	\$ 52	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und G Retail EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 169	\$ 183	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2024	\$ 51.999	€ 47.895	0	(668)	(668)	(0,02)
BPS	07.2024	€ 37.606	\$ 40.225	1	(81)	(80)	0,00
	07.2024	\$ 45.925	€ 42.421	0	(460)	(460)	(0,01)
	08.2024	40.130	37.464	80	0	80	0,00
BRC	07.2024	34	32	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	€ 267	\$ 287	1	0	1	0,00
FAR	07.2024	\$ 50.465	€ 46.334	0	(807)	(807)	(0,02)
GLM	07.2024	121	112	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2024	€ 36	\$ 38	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	37.733	40.350	1	(92)	(91)	0,00
	07.2024	\$ 14	€ 13	0	0	0	0,00
	08.2024	40.164	37.506	92	0	92	0,00
MYI	07.2024	€ 23.420	\$ 25.055	0	(46)	(46)	0,00
RBC	07.2024	14	16	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	37.504	40.182	0	(13)	(13)	0,00
	07.2024	\$ 82	€ 77	0	0	0	0,00
	08.2024	40.241	37.504	13	0	13	0,00
SSB	07.2024	€ 134	\$ 145	2	0	2	0,00
UAG	08.2024	\$ 838	€ 782	2	0	2	0,00
				\$ 194	\$ (2.168)	\$ (1.974)	(0,05)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 719.312	\$ 909.576	\$ 295	\$ 0	\$ 295	0,01
	07.2024	\$ 1.809.665	£ 1.420.138	0	(14.469)	(14.469)	(0,41)
	08.2024	909.725	719.312	0	(277)	(277)	(0,01)
BRC	07.2024	1.417	1.109	0	(16)	(16)	0,00
CBK	07.2024	£ 2.549	\$ 3.242	20	0	20	0,00
	07.2024	\$ 32.213	£ 25.233	0	(316)	(316)	(0,01)
	08.2024	551	436	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	930.631	729.346	0	(8.666)	(8.666)	(0,25)
MBC	07.2024	£ 733.354	\$ 927.838	806	0	806	0,02
	07.2024	\$ 2.717	£ 2.138	0	(15)	(15)	0,00
	08.2024	914.164	722.423	0	(782)	(782)	(0,02)
RBC	07.2024	£ 722.088	\$ 915.679	2.888	0	2.888	0,08
	08.2024	\$ 915.836	£ 722.088	0	(2.878)	(2.878)	(0,08)
RYL	07.2024	£ 661	\$ 846	10	0	10	0,00
				\$ 4.019	\$ (27.419)	\$ (23.400)	(0,67)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2024	\$ 112	NOK 1.181	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
CBK	07.2024	112	1.181	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2024	NOK 926	\$ 87	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 0	NOK 4	0	0	0	0,00
	08.2024	86	919	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	NOK 1.178	\$ 110	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 105	NOK 1.107	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	110	1.177	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklasse Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SEK 41	\$ 4	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2024	24	2	0	0	0	0,00
BRC	07.2024	17.845	1.684	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 1.684	SEK 17.818	1	0	1	0,00
CBK	07.2024	SEK 48	\$ 5	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.701	SEK 18.055	4	0	4	0,00
DUB	07.2024	SEK 16.457	\$ 1.555	1	0	1	0,00
	08.2024	\$ 1.555	SEK 16.431	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2024	SEK 364	\$ 35	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.643	SEK 17.252	0	(14)	(14)	0,00
	08.2024	SEK 94	\$ 9	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	17.866	1.691	5	0	5	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
RYL	08.2024	\$ 1.691	SEK 17.839	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
RYL	07.2024	1.649	17.341	0	(13)	(13)	0,00
SCX	07.2024	0	2	0	0	0	0,00
				\$ 11	\$ (33)	\$ (22)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (9.835)	(0,28)

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2054	\$ 15.900	\$ (12.438)	(0,36)
2,000 % fällig am 01.08.2054	85.000	(66.556)	(1,90)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (78.994)	(2,26)
Summe Anlagen		\$ 5.029.186	143,73
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.530.233)	(43,73)
Nettovermögen		\$ 3.498.953	100,00

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (i) Mit dem Fonds verbunden.
- (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (k) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,21 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Altice France S.A, 11,500 % fällig am 01.02.2027	20.12.2023	\$ 2.148	\$ 1.766	0,05
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	113	112	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071	10.06.2022	0	0	0,00
Intelsat Emergence S.A.	05.09.2018	2.000	720	0,02
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	29.07.2022	2.568	2.284	0,07
		\$ 6.829	\$ 4.882	0,14

(l) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 683 USD (31. Dezember 2023: 35.754 USD) und Barmittel in Höhe von 5.292 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(m) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 4.049 USD (31. Dezember 2023: null USD) und Barmittel in Höhe von 20.140 USD (31. Dezember 2023: 21.652 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 64.123 USD (31. Dezember 2023: 69.247 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.570	\$ 3.792.561	\$ 13.715	\$ 3.808.846
Investmentfonds	349.941	0	0	349.941
Pensionsgeschäfte	0	968.483	0	968.483
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(2.360)	(16.730)	0	(19.090)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(78.994)	0	(78.994)
Summen	\$ 350.151	\$ 4.665.320	\$ 13.715	\$ 5.029.186

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 44	\$ 4.172.220	\$ 3.743	\$ 4.176.007
Investmentfonds	213.446	124.057	0	337.503
Pensionsgeschäfte	0	734.416	0	734.416
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(5.514)	(35.726)	0	(41.240)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(82.577)	0	(82.577)
<b>Summen</b>	<b>\$ 207.976</b>	<b>\$ 4.912.390</b>	<b>\$ 3.743</b>	<b>\$ 5.124.109</b>

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
MBC	2,850 %	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (636)	\$ (683)	(0,02)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (683)</b>	<b>(0,02)</b>

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (130)	\$ 0	\$ (130)	\$ 301	\$ (350)	\$ (49)
BOA	(650)	899	249	2.067	(2.059)	8
BPS	(12.843)	11.580	(1.263)	(2.092)	5.240	3.148
BRC	(329)	455	126	(5.671)	5.892	221
BSH	22	0	22	(1.494)	1.850	356
CBK	(855)	798	(57)	(437)	270	(167)
DUB	(9.099)	8.430	(669)	(5.911)	6.570	659
FAR	9.168	(9.860)	(692)	(72)	0	(72)
GLM	5.808	(5.180)	628	726	(670)	56
GST	(1)	0	(1)	60	0	60
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
JPM	(11)	20	9	(1.504)	1.540	36
MBC	457	(470)	(13)	184	0	184
MYC	(78)	40	(38)	(160)	290	130
MYI	(2.028)	1.897	(131)	966	(1.160)	(194)
NGF	k. A.	k. A.	k. A.	190	0	190
RBC	15	0	15	2	0	2
RYL	(32)	0	(32)	3.857	(4.790)	(933)
SCX	281	(300)	(19)	6.522	(8.040)	(1.518)
SSB	21	(10)	11	261	(290)	(29)
TOR	(78)	70	(8)	998	(930)	68
UAG	540	(810)	(270)	5.254	0	5.254
ULO	(13)	0	(13)	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	35,35	45,63
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	73,02	75,48
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,49	0,09
Investmentfonds	10,00	9,80
Pensionsgeschäfte	27,68	21,31
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,15)	(1,12)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,12)	(0,19)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,28)	0,12
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,26)	(2,40)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,02)	(0,04)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	1,45	1,05
Unternehmensanleihen und Wechsel	21,26	21,59
Wandelanleihen & Wechsel	0,21	0,22
Kommunalanleihen und Wechsel	0,21	0,26
US-Regierungsbehörden	49,55	52,17
US-Schatzobligationen	6,11	8,61
Non-Agency-MBS	5,89	7,47
Forderungsbesicherte Wertpapiere	14,42	16,91
Staatsemissionen	6,73	5,72
Stammaktien	0,10	0,08
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,03	0,03
Kurzfristige Instrumente	2,90	7,09
Investmentfonds	10,00	9,80
Pensionsgeschäfte	27,68	21,31
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,15)	(1,12)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,01)	0,02
Zinsswaps	(0,10)	(0,20)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,08	k. A.
Zinsswapoptionen	0,01	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,04)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,41	(0,48)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,72)	0,61
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,26)	(2,40)
Sonstige Aktiva und Passiva	(43,73)	(48,72)
Nettovermögen	100,00	100,00





# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Bundesrepublik Deutschland 2,300 % fällig am 15.02.2033	€ 122.400	€ 121.036	4,85	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>				Bank of Beijing Co. Ltd. 'A' (b)	126.100	€ 95	0,00
Romania Government International Bond 5,000 % fällig am 27.09.2026	26.000	26.582	1,06	Ambev S.A.	436.700	€ 837	0,03	Bank of Ireland Group PLC	101.912	994	0,04
Serbia Government International Bond 6,250 % fällig am 26.05.2028	\$ 300	284	0,01	Bunge Global S.A.	13.808	1.376	0,06	Bank of Jiangsu Co. Ltd. 'A'	109.500	104	0,00
Stockholms Lans Landsting 0,750 % fällig am 26.02.2025	€ 7.000	6.870	0,28	China Feihe Ltd.	212.000	91	0,00	Bank of Nanjing Co. Ltd. 'A'	61.700	82	0,00
		200.108	8,01	Coca-Cola Co.	31.710	1.883	0,08	Bank of Shanghai Co. Ltd. 'A'	84.800	79	0,00
				Colgate-Palmolive Co. (b)	49.207	4.455	0,18	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	16.514	642	0,03
				General Mills, Inc. (b)	37.726	2.227	0,09	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	3.211.200	840	0,03
				George Weston Ltd.	4.890	656	0,03	BB Seguridade Participacoes S.A.	57.900	320	0,01
				Gruma S.A.B. de C.V. 'B' (b)	5.300	90	0,00	Berkshire Hathaway, Inc. 'B' (b)	14.378	5.457	0,22
				Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd. 'A'	37.200	123	0,01	BlackRock, Inc.	424	312	0,01
				Kimberly-Clark Corp.	32.990	4.254	0,17	CaixaBank S.A.	360.287	1.787	0,07
				Kimberly-Clark de Mexico S.A.B. de C.V. 'A' (b)	148.800	240	0,01	Cboe Global Markets, Inc.	10.117	1.605	0,06
				Kroger Co.	66.722	3.109	0,12	China CITIC Bank Corp. Ltd. 'H' (b)	778.000	465	0,02
				Target Corp.	45.208	6.245	0,25	China Merchants Bank Co. Ltd. 'A' (b)	110.300	484	0,02
				Wal-Mart de Mexico S.A.B. de C.V. (b)	151.800	482	0,02	Chubb Ltd.	286	68	0,00
				Walmart, Inc.	32.267	2.039	0,08	Cincinnati Financial Corp.	13.391	1.476	0,06
				Want Want China Holdings Ltd. (b)	463.000	261	0,01	CITIC Securities Co. Ltd. 'A' (b)	73.100	171	0,01
						28.368	1,14	CITIC Securities Co. Ltd. 'H' (b)	122.500	168	0,01
<b>STAMMAKTEN</b>				<b>ENERGIE</b>				CME Group, Inc.	10.814	1.984	0,08
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				Cheniere Energy, Inc.	22.586	3.684	0,15	Corebridge Financial, Inc.	24.383	663	0,03
Alphabet, Inc. 'A'	85.111	14.465	0,58	Equinor ASA	87.137	2.335	0,09	Credicorp Ltd.	3.268	492	0,02
Alphabet, Inc. 'C'	89.484	15.314	0,61	HF Sinclair Corp.	15.920	792	0,03	DB Insurance Co. Ltd.	3.685	285	0,01
Baidu, Inc. 'A' (b)(h)	27.100	274	0,01	Idemitsu Kosan Co. Ltd. (b)	88.700	538	0,02	Equitable Holdings, Inc.	28.864	1.100	0,04
Electronic Arts, Inc.	24.869	3.233	0,13	Marathon Petroleum Corp.	35.283	5.711	0,23	Erie Indemnity Co. 'A' (b)	294	99	0,00
Hellenic Telecommunications Organization S.A. (b)	15.496	208	0,01	MOL Hungarian Oil & Gas PLC	21.078	154	0,01	Erste Group Bank AG	20.241	895	0,04
Match Group, Inc. (b)	24.143	684	0,03	ORLEN S.A. (b)	53.403	838	0,03	Everest Group Ltd.	4.136	1.470	0,06
Meta Platforms, Inc. 'A'	35.204	16.562	0,66	Parkland Corp. (h)	11.379	298	0,01	EXOR NV	9.739	950	0,04
Pearson PLC	59.799	697	0,03	Petroleo Brasileiro S.A.	361.000	2.449	0,10	Fairfax Financial Holdings Ltd.	2.052	2.178	0,09
SK Telecom Co. Ltd.	3.534	123	0,01	PRIO S.A.	9.600	71	0,00	Far East Horizon Ltd.	165.000	100	0,00
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	4.533.600	804	0,03	PTT Exploration & Production PCL	120.900	466	0,02	FirstRand Ltd.	486.228	1.917	0,08
Tencent Holdings Ltd.	153.500	6.796	0,27	Repsol S.A. (b)	116.375	1.723	0,07	Goldman Sachs Group, Inc.	594	251	0,01
Verizon Communications, Inc. (b)	137.038	5.273	0,21	Shell PLC	116.475	3.898	0,16	Haci Omer Sabanci Holding A/S	36.589	101	0,00
		64.433	2,58	Tenaris S.A.	42.367	609	0,02	Hargreaves Lansdown PLC	30.421	405	0,02
				TotalEnergies SE	107.569	6.725	0,27	Hartford Financial Services Group, Inc.	29.116	2.731	0,11
<b>LUXUSGÜTER</b>				Türkiye Petrol Rafinerileri A/S	82.188	387	0,02	Huatai Securities Co. Ltd. 'A' (b)	43.600	69	0,00
Amazon.com, Inc. (b)	87.534	15.783	0,63	Valero Energy Corp.	32.259	4.719	0,19	Huatai Securities Co. Ltd. 'H' (b)	111.600	115	0,00
Booking Holdings, Inc.	1.052	3.888	0,15			35.397	1,42	Huaxia Bank Co. Ltd. 'A'	79.100	65	0,00
Bridgestone Corp.	55.100	2.029	0,08	<b>FINANZWERTE</b>				IGM Financial, Inc.	5.723	147	0,01
Cheng Shin Rubber Industry Co. Ltd.	147.000	209	0,01	3i Group PLC	84.921	3.054	0,12	Industrial Bank of Korea	20.396	194	0,01
Cie Generale des Etablissements Michelin S.C.A.	63.377	2.287	0,09	Aflac, Inc.	51.833	4.319	0,17	Industrivarden AB 'A'	11.736	373	0,02
Dick's Sporting Goods, Inc.	5.765	1.156	0,05	Ageas S.A.	15.084	643	0,03	Intesa Sanpaolo SpA	1.124.379	3.902	0,16
eBay, Inc.	50.427	2.528	0,10	Agricultural Bank of China Ltd. 'A'	114.000	64	0,00	JPMorgan Chase & Co.	8.338	1.574	0,06
Expedia Group, Inc. (b)	12.731	1.497	0,06	AIB Group PLC	156.643	772	0,03	Kasikornbank PCL	37.800	120	0,01
Ford Otomotiv Sanayi A/S	4.810	154	0,01	Akbank T.A.S.	275.197	502	0,02	Krungthai Card PCL	102.600	106	0,00
Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd. 'A'	12.000	74	0,00	American Express Co. (b)	12.441	2.688	0,11	LPL Financial Holdings, Inc.	7.284	1.898	0,08
Garmin Ltd.	14.818	2.252	0,09	American Financial Group, Inc.	6.979	801	0,03	Mastercard, Inc. 'A' (b)	6.516	2.682	0,11
Hankook Tire & Technology Co. Ltd.	5.235	160	0,01	Ameriprise Financial, Inc.	9.810	3.910	0,16	Medibank Pvt Ltd.	244.906	567	0,02
Home Depot, Inc.	10.395	3.339	0,13	Amundi S.A.	5.045	305	0,01	Meritz Financial Group, Inc.	8.825	472	0,02
Kia Corp.	25.260	2.205	0,09	Arch Capital Group Ltd. (b)	36.508	3.437	0,14	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	13.365	6.239	0,25
Midea Group Co. Ltd. 'A'	21.000	174	0,01	Assicurazioni Generali SpA	31.283	727	0,03	Nedbank Group Ltd.	43.776	576	0,02
Nien Made Enterprise Co. Ltd. (b)	11.000	123	0,00	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	571.725	5.359	0,21	Onex Corp. (b)	3.605	229	0,01
NVR, Inc. (b)	308	2.181	0,09	Banco BPM SpA	73.246	440	0,02	ORIX Corp. (b)	86.700	1.793	0,07
O'Reilly Automotive, Inc. (b)	3.134	3.088	0,12	Banco de Chile	4.402.208	457	0,02	OTP Bank Nyrt	21.938	1.016	0,04
Sekisui Chemical Co. Ltd. (b)	32.700	424	0,02	Banco do Brasil S.A.	160.371	289	0,01	PICC Property & Casualty Co. Ltd. 'H' (b)	632.000	731	0,03
Subaru Corp. (b)	56.700	1.125	0,04	Banco Santander S.A.	1.549.841	6.733	0,27	Ping An Bank Co. Ltd. 'A'	113.500	148	0,01
Sumitomo Electric Industries Ltd. (b)	66.600	972	0,04	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	1.225.300	324	0,01	Poste Italiane SpA	40.199	478	0,02
Technion Industries Co. Ltd.	131.000	1.394	0,06					Powszechny Zakład Ubezpieczeń S.A. (b)	55.771	665	0,03
TJX Cos., Inc.	68.004	6.986	0,28								
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	87.200	161	0,01								
Topsports International Holdings Ltd. (b)	186.000	92	0,00								
Ulta Beauty, Inc. (b)	4.726	1.701	0,07								
Vipshop Holdings Ltd.	36.392	442	0,02								
		56.424	2,26								

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Progressive Corp. (b)	18.999	€ 3.682	0,15	Horizon Construction Development Ltd. (b)	30.556	€ 5	0,00	NXP Semiconductors NV	20.223	€ 5.077	0,20
Qifu Technology, Inc.	11.858	218	0,01	Illinois Tool Works, Inc.	4.958	1.096	0,04	Oracle Corp. Japan	2.800	180	0,01
Raymond James Financial, Inc. (b)	10.189	1.175	0,05	ITOCHU Corp. (b)	79.000	3.624	0,15	Otsuka Corp. (b)	22.300	401	0,02
Sampo Oyj 'A'	44.210	1.780	0,07	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd. (b)	34.100	464	0,02	Pegatron Corp.	179.000	537	0,02
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	2.798	734	0,03	Kingspan Group PLC	3.118	247	0,01	Qorvo, Inc. (b)	9.073	982	0,04
SCB PCL	58.900	154	0,01	Korean Air Lines Co. Ltd.	13.679	215	0,01	QUALCOMM, Inc.	79.309	14.739	0,59
SEI Investments Co.	10.059	607	0,02	Legrand S.A.	23.666	2.193	0,09	Quanta Computer, Inc.	262.000	2.337	0,09
Singapore Exchange Ltd.	75.200	490	0,02	Makita Corp. (b)	21.900	560	0,02	Realtek Semiconductor Corp.	44.000	689	0,03
Sompo Holdings, Inc. (b)	85.300	1.705	0,07	Marubeni Corp. (b)	138.800	2.402	0,10	Renesas Electronics Corp.	146.400	2.591	0,10
State Street Corp. (b)	29.566	2.041	0,08	Masco Corp.	21.326	1.327	0,05	Samsung Electronics Co. Ltd.	62.256	3.419	0,14
Swiss Re AG	29.499	3.412	0,14	MISC Bhd.	112.700	190	0,01	SCREEN Holdings Co. Ltd. (b)	7.300	618	0,03
Synchrony Financial	39.646	1.746	0,07	Mitsubishi Corp. (b)	264.500	4.852	0,19	Seiko Epson Corp. (b)	24.000	350	0,01
T. Rowe Price Group, Inc.	21.899	2.356	0,09	Mitsui & Co. Ltd. (b)	229.200	4.878	0,20	Shenzhen Transsion Holdings Co. Ltd. 'A'	6.736	66	0,00
Türkiye İş Bankası A.S. 'C'	730.822	330	0,01	Mitsui OSK Lines Ltd. (b)	31.900	895	0,04	Skyworks Solutions, Inc.	15.274	1.519	0,06
Wells Fargo & Co.	49.770	2.758	0,11	Nippon Yusen KK (b)	43.300	1.179	0,05	STMicroelectronics NV	6.785	248	0,01
Yapi ve Kredi Bankası A/S	267.332	257	0,01	Owens Corning (b)	8.457	1.371	0,06	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	262.000	7.243	0,29
Zurich Insurance Group AG	8.048	3.999	0,16	ROCKWOOL A/S 'B'	736	279	0,01	Texas Instruments, Inc.	1.755	318	0,01
		117.900	4,72	Siemens AG	427	74	0,00	Trend Micro, Inc. (b)	11.500	437	0,02
				SKF AB 'B'	30.392	570	0,02	United Microelectronics Corp.	1.081.000	1.744	0,07
				Snap-on, Inc.	4.994	1.218	0,05	VeriSign, Inc. (b)	6.443	1.069	0,04
<b>GESUNDHEITSWESSEN</b>				Sumitomo Corp. (b)	100.600	2.359	0,09	Will Semiconductor Co. Ltd. Shanghai 'A' (b)	7.100	90	0,00
AbbVie, Inc. (b)	109.711	17.558	0,70	Toyota Tsusho Corp. (b)	63.600	1.160	0,05	Wistron Corp.	239.000	724	0,03
AstraZeneca PLC	2.671	388	0,02	Trelleborg AB 'B'	9.616	349	0,01			175.813	7,04
Bristol-Myers Squibb Co. (b)	68.367	2.649	0,11	Türkiye Sise ve Cam Fabrikaları A/S	88.906	127	0,01				
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	65.800	2.187	0,09	Veralto Corp.	1.033	92	0,00				
Cigna Group	4.254	1.312	0,05	Wartsila Oyj Abp (b)	34.153	618	0,02	<b>BAUSTOFFE</b>			
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	360.000	268	0,01	Waste Management, Inc.	6.137	1.222	0,05	BHP Group Ltd.	162.404	4.336	0,17
Daiichi Sankyo Co. Ltd. (b)	9.800	318	0,01	Weichai Power Co. Ltd. 'A'	40.500	84	0,00	CRH PLC	14.634	1.012	0,04
Gilead Sciences, Inc.	98.914	6.332	0,25	Weichai Power Co. Ltd. 'H'	152.000	270	0,01	Glencore PLC (b)	47.649	253	0,01
GSK PLC	405.806	7.283	0,29			56.651	2,27	Heidelberg Materials AG	12.993	1.254	0,05
Hanmi Pharm Co. Ltd.	689	126	0,01	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				Holcim AG	30.939	2.551	0,10
Hologic, Inc. (b)	19.564	1.355	0,05	Adobe, Inc. (b)	1.049	544	0,02	JFE Holdings, Inc. (b)	52.200	703	0,03
Ipsen S.A.	3.694	424	0,02	Apple, Inc.	142.066	27.919	1,12	Kinross Gold Corp.	120.240	934	0,04
Johnson & Johnson	106.299	14.496	0,58	Applied Materials, Inc.	36.211	7.973	0,32	Klabin S.A.	80.500	290	0,01
Merck & Co., Inc.	88.343	10.205	0,41	ASE Technology Holding Co. Ltd. (b)	322.000	1.556	0,06	LyondellBasell Industries NV 'A'	19.877	1.774	0,07
Novartis AG	96.503	9.585	0,38	Brother Industries Ltd. (b)	18.900	312	0,01	MMG Ltd. (b)	416.000	148	0,01
Ono Pharmaceutical Co. Ltd. (b)	36.100	460	0,02	Canon, Inc.	97.000	2.456	0,10	Mondi PLC	40.190	720	0,03
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (b)	973	954	0,04	Check Point Software Technologies Ltd. (b)	8.844	1.362	0,06	Nippon Steel Corp. (b)	37.300	738	0,03
Richter Gedeon Nyrt	13.690	332	0,01	Cisco Systems, Inc.	289.150	12.818	0,51	Nucor Corp.	19.179	2.829	0,11
Roche Holding AG	27.545	7.162	0,29	Compal Electronics, Inc.	352.000	350	0,01	Packaging Corporation of America	2.947	502	0,02
Royalty Pharma PLC 'A'	35.184	866	0,03	F5, Inc. (b)	5.530	889	0,04	Reliance, Inc.	4.599	1.225	0,05
United Therapeutics Corp. (b)	4.377	1.301	0,05	Fortinet, Inc. (b)	63.507	3.571	0,14	Rio Tinto PLC	81.734	5.004	0,20
		85.561	3,42	Gen Digital, Inc.	56.128	1.308	0,05	Steel Dynamics, Inc.	14.712	1.778	0,07
				GoDaddy, Inc. 'A' (b)	12.818	1.671	0,07	Suzano S.A.	71.300	683	0,03
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Hewlett Packard Enterprise Co.	84.366	1.666	0,07	voestalpine AG (b)	7.658	193	0,01
A.O. Smith Corp.	11.392	869	0,04	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. (b)	605.000	3.717	0,15			26.927	1,08
ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A. (b)	19.337	780	0,03	HP, Inc.	93.880	3.068	0,12	<b>IMMOBILIEN</b>			
AGC, Inc.	17.600	534	0,02	International Business Machines Corp.	16.017	2.585	0,10	Hulic Co. Ltd.	30.300	252	0,01
Allegion PLC	8.134	897	0,04	Jinko Solar Co. Ltd. 'A'	64.661	59	0,00	Swire Pacific Ltd. 'A'	34.000	280	0,01
BOC Aviation Ltd.	18.000	120	0,00	KLA Corp.	2.034	1.565	0,06			532	0,02
Brambles Ltd.	131.043	1.181	0,05	Lam Research Corp.	805	800	0,03	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
Brenntag SE	12.179	767	0,03	Logitech International S.A. (b)	15.241	1.368	0,06	Canadian Utilities Ltd. 'A'	9.720	196	0,01
Builders FirstSource, Inc. (b)	11.797	1.524	0,06	Luxshare Precision Industry Co. Ltd. 'A' (b)	28.800	145	0,01	CGN Power Co. Ltd. (b)	120.700	72	0,00
Carlisle Cos., Inc.	4.681	1.770	0,07	Manhattan Associates, Inc. (b)	2.767	637	0,03	CGN Power Co. Ltd. 'H'	889.000	365	0,01
Caterpillar, Inc. (b)	10.674	3.318	0,13	MediaTek, Inc.	149.000	5.988	0,24	China National Nuclear Power Co. Ltd. 'A' (b)	112.700	154	0,01
Cie de Saint-Gobain S.A.	44.638	3.242	0,13	Microchip Technology, Inc.	19.654	1.678	0,07	China Yangtze Power Co. Ltd. 'A' (b)	143.200	532	0,02
Cummins, Inc.	12.942	3.344	0,13	Microsoft Corp.	67.796	28.274	1,13	CPFL Energia S.A.	23.000	126	0,01
Dai Nippon Printing Co. Ltd. (b)	18.200	573	0,02	NetApp, Inc.	19.982	2.401	0,10	Endesa S.A.	28.092	493	0,02
EMCOR Group, Inc.	4.608	1.570	0,06	Novatek Microelectronics Corp.	54.000	940	0,04	Enel SpA (b)	443.409	2.873	0,11
Fortive Corp.	6.068	420	0,02	NVIDIA Corp.	111.179	12.815	0,51	Engie Brasil Energia S.A.	20.400	152	0,01
Fortune Brands Innovations, Inc. 'I'	11.500	697	0,03								
Graco, Inc. (b)	12.996	961	0,04								
Haitian International Holdings Ltd.	62.000	164	0,01								

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS		
												INVESTMENTFONDS	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN
<b>EUROPEAN STABILITY MECHANISM TREASURY BILLS</b>													
Fortum Oyj (b)	43.936	€ 601	0,02	3,811 % fällig am 08.08.2024 (c)(d)	€ 640	€ 637	0,03						
Iberdrola S.A.	40.983	496	0,02	3,822 % fällig am 08.08.2024 (c)(d)	550	548	0,02						
Kansai Electric Power Co., Inc. (b)	66.000	1.034	0,04	3,824 % fällig am 08.08.2024 (c)(d)	2.730	2.720	0,11						
Kunlun Energy Co. Ltd.	318.000	307	0,01									3.905	0,16
Osaka Gas Co. Ltd. (b)	34.000	701	0,03										
Petronas Gas Bhd.	32.300	114	0,00										
SSE PLC (b)	59.195	1.247	0,05										
Tokyo Gas Co. Ltd. (b)	33.500	673	0,03										
Verbund AG	6.101	451	0,02										
<b>FRANCE TREASURY BILLS</b>													
				3,734 % fällig am 11.09.2024 (c)(d)	1.840	1.827	0,07						
				3,762 % fällig am 11.09.2024 (c)(d)	920	913	0,04						
				3,782 % fällig am 21.08.2024 (c)(d)	10.300	10.248	0,41						
				3,787 % fällig am 21.08.2024 (c)(d)	44.290	44.068	1,76						
				3,856 % fällig am 31.07.2024 (c)(d)	23.270	23.201	0,93						
				3,858 % fällig am 31.07.2024 (c)(d)	12.260	12.224	0,49						
				3,861 % fällig am 31.07.2024 (c)(d)	10.780	10.748	0,43						
				3,863 % fällig am 17.07.2024 (c)(d)	37.200	37.143	1,49						
				3,863 % fällig am 31.07.2024 (c)(d)	1.380	1.376	0,06						
				3,877 % fällig am 03.07.2024 (c)(d)	23.230	23.228	0,93						
				3,880 % fällig am 03.07.2024 (c)(d)	2.900	2.900	0,12						
				3,886 % fällig am 03.07.2024 (c)(d)	12.820	12.819	0,51						
				3,892 % fällig am 03.07.2024 (c)(d)	850	850	0,03						
												181.545	7,27
<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>													
				(0,003) % fällig am	¥ 14.150.000	82.076	3,28						
				08.07.2024 (c)(d)									
				Summe kurzfristige Instrumente									
							297.455	11,91					
				Summe Übertragbare Wertpapiere									
							€ 3.074.791	123,10					
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>													
Bancolombia S.A. 0,000 %	23.450	180	0,01										
Gerdau S.A. 0,000 %	116.400	360	0,01										
Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 %	464.400	2.968	0,12										
Samsung Electronics Co. Ltd. 0,000 %	69.349	2.971	0,12										
							6.479	0,26					
<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>													
Host Hotels & Resorts, Inc.	3.712	62	0,00										
Simon Property Group, Inc.	31.910	4.520	0,18										
							4.582	0,18					
<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>													
<b>COMMERCIAL PAPER</b>													
Regie Autonome des Transports Parisiens EPIC 3,969 % fällig am 05.07.2024	€ 10.000	9.993	0,40										
Universal Music Group NV 4,127 % fällig am 31.07.2024	20.000	19.936	0,80										
							29.929	1,20					

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	3,630 %	28.06.2024	01.07.2024	€ 65.800	Societe Nationale SNCF S.A. 4,150 % fällig am 18.01.2042	€ (66.182)	€ 65.800	€ 65.820	2,63
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	\$ 11.467	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(10.913)	10.699	10.699	0,43
Summe Pensionsgeschäfte						€ (77.095)	€ 76.499	€ 76.519	3,06

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	241	€ (38)	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	59	36	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2024	150	43	0,00
Euro STOXX 600 September Futures	Long	09.2024	702	(66)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	23	(39)	0,00
FTSE 100 Index September Futures	Long	09.2024	40	(1)	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	26	29	0,00
Mini MSCI Emerging Markets Index September Futures	Long	09.2024	316	132	0,01
SPI 200 Index September Futures	Long	09.2024	16	12	0,00
Topix Index September Futures	Long	09.2024	62	111	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	793	376	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	464	99	0,00

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	4.601	€ 2.139	0,09
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	169	149	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	143	79	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	400	151	0,01
				€ 3.212	0,13
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 3.212	0,13

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 500	€ (2)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	100	3	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	1.000	18	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	200	4	0,00
				€ 23	0,00

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000 %	20.06.2029	\$ 133.600	€ (763)	(0,03)
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	29.700	260	0,01
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	439.900	(408)	(0,01)
				€ (911)	(0,03)

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000 %	18.09.2029	£ 9.700	€ (63)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,600	18.09.2029	¥ 22.730.000	429	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	\$ 110.400	9.052	0,36
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	90.100	2.222	0,09
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	30.500	3.250	0,13
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	174.400	6.112	0,24
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2026	29.500	17	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	24.700	56	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	52.600	1.422	0,06
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	10.100	57	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,520	02.01.2026	BRL 193.100	(381)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,525	02.01.2026	117.163	(230)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,875	04.01.2027	81.038	(236)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,880	04.01.2027	136.700	(396)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,649	03.04.2029	ZAR 414.300	435	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 42.300	620	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	17.200	(70)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	87.400	(161)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	135.350	741	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026	70.300	(48)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIE	9,230	04.05.2029	MXN 733.000	(543)	(0,02)
				€ 22.285	0,89	
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				€ 21.397	0,86	

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,275	06.12.2024	489	€ 54	€ 116	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,350	06.12.2024	527	45	90	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	06.12.2024	607	52	81	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	14.01.2025	509	46	78	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	14.01.2025	607	45	71	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	23.01.2025	607	54	72	0,00
CBK	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.01.2025	607	60	106	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,450	14.02.2025	607	54	64	0,00
MBC	Call - OTC USD versus CNH	7,375	14.02.2025	607	56	77	0,00
SCX	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	205	20	29	0,00
					€ 486	€ 784	0,03

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689 %	15.07.2024	3.600	€ (7)	€ (1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	3.600	(7)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	1.800	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	3.000	(11)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	1.500	(5)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	6.900	(20)	(18)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	3.000	(11)	(18)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	1.800	(7)	(11)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	1.500	(5)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	6.900	(20)	(2)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	1.500	(5)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	1.500	(5)	(7)	0,00
							€ (110)	€ (83)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	NDUEACWF Index	85.800	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 36.256	07.05.2025	€ 0	€ 613	€ 613	0,02
MYI	Erhalt	NDUEACWF Index	61.410	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	25.950	07.05.2025	0	438	438	0,02
	Erhalt	NDUEACWF Index	19.990	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	8.652	25.06.2025	0	(20)	(20)	0,00
							€ 0	€ 1.031	€ 1.031	0,04

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	€ 2.049	NZD 3.585	€ 0	€ (11)	€ (11)	0,00
BOA	07.2024	DKK 9.218	€ 1.236	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 3.339	3.958	20	0	20	0,00
	07.2024	HKD 210.607	\$ 26.989	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	KRW 17.407.756	12.725	76	0	76	0,00
	07.2024	PLN 6.892	1.718	3	0	3	0,00
	07.2024	SGD 5.694	4.219	16	0	16	0,00
	07.2024	\$ 901.391	€ 830.240	0	(10.804)	(10.804)	(0,43)
	07.2024	1.922	KRW 2.617.380	0	(20)	(20)	0,00
	07.2024	38	SGD 51	0	0	0	0,00
	08.2024	51	\$ 38	0	0	0	0,00
BPS	08.2024	TRY 105.574	3.015	0	(30)	(30)	0,00
	07.2024	CHF 33.928	€ 34.585	0	(643)	(643)	(0,03)
	07.2024	€ 5.995	AUD 9.648	17	0	17	0,00
	07.2024	990	CAD 1.466	10	0	10	0,00
	07.2024	36.849	¥ 6.236.194	0	(677)	(677)	(0,03)
	07.2024	27.154	\$ 29.438	322	(8)	314	0,01
	07.2024	£ 862	€ 1.010	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	KRW 17.403.071	\$ 12.679	37	0	37	0,00
	07.2024	PLN 3.094	769	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 28.440	BRL 148.125	0	(1.653)	(1.653)	(0,07)
07.2024	110.220	€ 101.747	0	(1.094)	(1.094)	(0,04)	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2024	\$	1.400	IDR	22.937.271	€	2	0,00
	07.2024		552	ILS	2.045		0	0,00
	07.2024		1.384	PLN	5.609		10	0,00
	07.2024		9.321	SGD	12.642		6	0,00
	08.2024	SGD	12.623	\$	9.321		0	0,00
	09.2024	CNH	159.496		22.257		260	0,01
	09.2024	TWD	824.969		25.654		160	0,01
	09.2024	\$	7.491	TWD	241.033		0	0,00
	10.2024	CNH	55.010	\$	7.683		76	0,00
	10.2024	\$	4.610	CNH	33.072		0	0,00
	01.2025	CNH	15.671	\$	2.194		14	0,00
BRC	07.2024	€	19.484	AUD	31.343		47	0,00
	07.2024		39.089	CAD	57.595		242	0,01
	07.2024		1.899	CHF	1.819		0	0,00
	07.2024		1.000	£	845		0	0,00
	07.2024		8.038	\$	8.687		68	0,00
	07.2024	£	26.138	€	30.713		13	0,00
	07.2024	MXN	81.081	\$	4.386		0	0,00
	07.2024	SEK	41.560	€	3.613		0	0,00
	07.2024	SGD	2.638	\$	1.953		6	0,00
	07.2024	THB	1.835		50		0	0,00
	07.2024	TRY	137.345		4.044		0	0,00
	07.2024	\$	5.603	HKD	43.731		1	0,00
	07.2024		11.936	PLN	47.232		1	0,00
	07.2024		1.904	SGD	2.570		0	0,00
	07.2024		5.660	TRY	195.728		169	0,01
	08.2024	AUD	31.361	€	19.484		0	0,00
	08.2024	CAD	27.772		18.980		55	0,00
	08.2024	€	1.466	\$	1.570		0	0,00
	08.2024	TRY	8.995		255		0	0,00
	08.2024	\$	10.111	TRY	347.767		77	0,00
	09.2024	MXN	116.666	\$	6.191		0	0,00
	09.2024	\$	6.482	MXN	122.366		120	0,00
	09.2024		2.761	TRY	99.519		33	0,00
	10.2024		19.510	CNH	140.518		0	0,00
CBK	07.2024	BRL	30.086	\$	5.521		98	0,00
	07.2024	COP	182.953.588		45.041		940	0,04
	07.2024	€	3.328	£	2.816		0	0,00
	07.2024	£	224	€	265		1	0,00
	07.2024	NOK	6.707		587		0	0,00
	07.2024	\$	1.097	PLN	4.350		0	0,00
	07.2024		1.476	TRY	49.744		6	0,00
	07.2024		48	ZAR	885		0	0,00
	07.2024	ZAR	166.650	\$	9.182		99	0,00
	08.2024	\$	5.521	BRL	30.187		0	0,00
	09.2024		19.978	INR	1.670.402		16	0,00
	09.2024		409	PHP	24.066		2	0,00
	09.2024		2.851	TWD	91.898		0	0,00
	01.2025		2.194	CNH	15.663		0	0,00
DUB	07.2024	BRL	528	\$	100		5	0,00
	07.2024	IDR	815.550		50		0	0,00
	07.2024	KRW	9.443.019		6.864		5	0,00
	07.2024	\$	12.200	TWD	394.487		0	0,00
	08.2024	BRL	8.713	\$	1.693		121	0,00
	09.2024	INR	183.944		2.197		0	0,00
GLM	07.2024	€	150.599	£	127.102		0	0,00
	07.2024	INR	1.017.785	\$	12.200		0	0,00
	07.2024	¥	166.042	€	977		14	0,00
	07.2024	KRW	11.549	\$	8		0	0,00
	07.2024	MXN	38.319		2.063		0	0,00
	07.2024	SEK	18.770	€	1.671		18	0,00
	07.2024	\$	150	KRW	206.069		0	0,00
	07.2024		208	MXN	3.763		0	0,00
	07.2024		9.169	PLN	36.397		0	0,00
	07.2024		10.450	ZAR	191.198		7	0,00
	08.2024	£	127.266	€	150.599		682	0,03
	08.2024	\$	24.837	BRL	131.375		0	0,00
	08.2024		3.637	TRY	125.507		19	0,00
	09.2024		1.634		57.956		7	0,00
JPM	07.2024	AUD	1.194	€	734		0	0,00
	07.2024	CHF	32.773		33.402		0	0,00
	07.2024	CNY	1.309	\$	184		2	0,00
	07.2024	€	2.817	¥	480.300		0	0,00
	07.2024		1.735	SEK	19.943		22	0,00
	07.2024		1.072	\$	1.155		6	0,00
	07.2024	£	101.915	€	119.681		0	0,00
	07.2024	IDR	37.146.434	\$	2.290		19	0,00
	07.2024	KRW	11.665.480		8.457		0	0,00
	07.2024	SEK	5.330	€	474		5	0,00
	07.2024	SGD	6.796	\$	5.049		32	0,00
	07.2024	\$	10.026	CNY	71.503		0	0,00
	07.2024		47.981	€	44.682		0	0,00
	07/2024		1.397	ILS	5.168		0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$	KRW	22.135	€ 0	€ 0	0,00
	07.2024		THB	37.415	1	0	0,00
	07.2024		ZAR	362.170	126	0	0,01
	08.2024	CNY	\$	10.026	3	0	0,00
	09.2024	\$	INR	223.166	6	0	0,00
	09.2024		MXN	252.484	0	(288)	(0,01)
	09.2024		TWD	156.349	0	(25)	0,00
	10.2024	CNH	\$	2.388	24	0	0,00
	10.2024	\$	CNH	223.589	0	(330)	(0,01)
	11.2024	TRY	\$	248	0	(12)	0,00
MBC	07.2024	AUD	€	16.386	0	(319)	(0,01)
	07.2024	CHF		5.313	0	(22)	0,00
	07.2024	€	CHF	7.156	0	(115)	(0,01)
	07.2024		NZD	8.689	0	(23)	0,00
	07.2024		\$	394.521	137	(818)	(0,03)
	07.2024	HUF		3.552	0	(36)	0,00
	07.2024	¥	€	141.950	6.335	0	0,25
	07.2024	NOK		2.226	0	(4)	0,00
	07.2024	SGD	\$	100	1	1	0,00
	07.2024	\$	€	30.632	0	(280)	(0,01)
	08.2024			357.871	816	0	0,03
	09.2024	TWD	\$	30.238	159	0	0,01
	10.2024	\$	CNH	110	0	0	0,00
MYI	07.2024	AUD	€	8.360	0	(163)	(0,01)
	07.2024	BRL	\$	10.219	668	0	0,03
	07.2024	€	CHF	45.904	0	(141)	(0,01)
	07.2024		DKK	9.219	0	0	0,00
	07.2024		£	619	0	(2)	0,00
	07.2024		NOK	32.115	0	(1)	0,00
	07.2024		\$	18.593	0	(35)	0,00
	07.2024	£	€	308	0	0	0,00
	07.2024	HUF	\$	335	0	(2)	0,00
	07.2024	NOK	€	2	0	0	0,00
	07.2024	PLN	\$	8.101	0	(33)	0,00
	07.2024	ZAR		7.194	0	(155)	(0,01)
	08.2024	CHF	€	47.805	139	0	0,01
	08.2024	DKK		1.236	0	0	0,00
	08.2024	NOK		2.815	1	0	0,00
	09.2024	\$	INR	79.264	1	1	0,00
	09.2024		MXN	28.766	0	(4)	0,00
	09.2024		TWD	62.197	0	(16)	0,00
RBC	07.2024	€	CHF	17.011	431	0	0,02
	07.2024	\$	COP	175.000.000	0	(364)	(0,01)
	07.2024	ZAR	\$	128	0	(3)	0,00
	09.2024	\$	TWD	79.045	0	(27)	0,00
RYL	07.2024	NZD	€	3.530	13	0	0,00
SCX	07.2024	BRL	\$	12.425	719	0	0,03
	07.2024	CAD	€	47.622	0	(553)	(0,02)
	07.2024	CNY	\$	9.864	126	0	0,01
	07.2024	€	£	371	3	0	0,00
	07.2024		¥	2.696.412	0	(168)	(0,01)
	07.2024		\$	897.119	0	(274)	(0,01)
	07.2024	£	€	200	0	0	0,00
	07.2024	IDR	\$	30	0	0	0,00
	07.2024	KRW		6.471	57	0	0,00
	07.2024	\$	€	252.264	0	(2.656)	(0,11)
	07.2024	ZAR	\$	1.055	0	(8)	0,00
	08.2024	€	£	169	0	0	0,00
	08.2024	¥	€	4.202	16	0	0,00
	08.2024	\$		837.333	263	0	0,01
	09.2024	CNH	\$	9.129	97	0	0,00
	09.2024	TWD		33.522	228	0	0,01
	09.2024	\$	INR	1.011.209	17	0	0,00
	09.2024		PHP	24.039	1	1	0,00
	09.2024		TWD	90.406	0	(11)	0,00
SSB	07.2024		KRW	16.817.090	13	0	0,00
UAG	07.2024	€	CAD	11.111	34	0	0,00
	07.2024	HUF	\$	4	0	0	0,00
	07.2024	ILS		2.528	37	0	0,00
				€ 14.459	€ (26.333)	€ (11.874)	(0,48)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen BM Retail AUD (Hedged) Income II und M Retail AUD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD	€	4	2	€ 0	0,00
GLM	07.2024	€	AUD	101	165	2	0,00
MBC	07.2024			2	4	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SCX	07.2024	€ 101	AUD 165	€ 2	€ 0	€ 2	0,00
SSB	07.2024	101	165	2	0	2	0,00
				€ 6	€ 0	€ 6	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 0	CHF 0	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
BRC	07.2024	0	0	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	0	0	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	4	4	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	4	4	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	CHF 4	€ 5	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 5	CHF 4	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	4	4	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	0	0	0	0	0	0,00
				€ 0	€ 0	€ 0	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 138.151	£ 117.671	€ 638	€ 0	€ 638	0,03
	07.2024	£ 96	€ 113	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	€ 7.798	£ 6.651	47	0	47	0,00
BRC	07.2024	426	362	1	0	1	0,00
DUB	07.2024	55	47	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	£ 138.697	€ 164.337	748	0	748	0,03
	08.2024	€ 164.337	£ 138.876	0	(746)	(746)	(0,03)
JPM	07.2024	163.654	139.361	718	0	718	0,03
MBC	07.2024	5.946	5.064	28	(1)	27	0,00
	07.2024	£ 154	€ 183	1	0	1	0,00
RYL	07.2024	€ 59	£ 50	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	£ 2.114	€ 2.500	7	(1)	6	0,00
	08.2024	€ 48	£ 41	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	164.407	140.340	1.120	0	1.120	0,04
	07.2024	£ 10.647	€ 12.579	21	0	21	0,00
	08.2024	€ 10.295	£ 8.724	0	(19)	(19)	0,00
SSB	07.2024	£ 210	€ 248	1	0	1	0,00
UAG	07.2024	432	506	0	(3)	(3)	0,00
				€ 3.330	€ (771)	€ 2.559	0,10

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional ILS (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2024	€ 21	ILS 86	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
CBK	07.2024	ILS 125	€ 31	1	0	1	0,00
GLM	07.2024	119	30	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 18	ILS 71	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	1.448	5.760	0	(22)	(22)	0,00
MYI	07.2024	1.418	5.637	0	(22)	(22)	0,00
SSB	07.2024	1.418	5.637	0	(22)	(22)	0,00
				€ 1	€ (66)	€ (65)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) Accumulation und M Retail SGD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2024	€ 20.590	SGD 30.149	€ 167	€ 0	€ 167	0,01
MBC	07.2024	21.003	30.753	170	0	170	0,01
MYI	07.2024	20.591	30.149	165	0	165	0,00
	07.2024	SGD 1.032	€ 711	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	83	57	0	0	0	0,00
				€ 502	€ 0	€ 502	0,02

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional USD (Hedged) Accumulation, Institutional USD (Hedged) Income II, BM Retail USD (Hedged) Income II, E Class USD (Hedged) Accumulation, H Institutional USD (Hedged) Accumulation, M Retail USD (Hedged) Income II und T Class USD (Hedged) Accumulation die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	\$ 6.737	€ 6.272	€ 9	€ (22)	€ (13)	0,00
BOA	07.2024	€ 74.408	\$ 80.785	969	0	969	0,04
BPS	07.2024	70.740	76.583	716	0	716	0,03
	07.2024	\$ 63.994	€ 59.830	120	0	120	0,00
	08.2024	€ 59.830	\$ 64.087	0	(120)	(120)	0,00
BRC	07.2024	67.300	72.879	700	0	700	0,03
GLM	07.2024	\$ 441	€ 404	0	(7)	(7)	0,00
JPM	07.2024	869	810	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2024	69.829	65.300	148	(3)	145	0,01
	08.2024	€ 64.478	\$ 69.047	0	(147)	(147)	(0,01)
RBC	07.2024	\$ 589	€ 550	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	198	184	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	69.976	65.310	21	(2)	19	0,00
	08.2024	€ 64.355	\$ 69.052	0	(20)	(20)	0,00
SSB	07.2024	\$ 14.466	€ 13.337	0	(160)	(160)	(0,01)
UAG	07.2024	488	449	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	38	36	0	0	0	0,00
						€ 2.195	0,09
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>€ (4.945)</b>	<b>(0,20)</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>€ 3.412.707</b>	<b>136,63</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>€ (914.968)</b>	<b>(36,63)</b>
<b>Nettovermögen</b>						<b>€ 2.497.739</b>	<b>100,00</b>

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (g) Mit dem Fonds verbunden.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: null):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Baidu, Inc. 'A'	10.05.2024	€ 345	€ 274	0,01
Parkland Corp.	02.05.2024	328	298	0,01
		€ 673	€ 572	0,02

Barmittel in Höhe von 1.221 EUR (31. Dezember 2023: 160.662 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Aktienoptionsgeschäfte regeln, als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen verpfändet.

Barmittel in Höhe von 67.999 EUR (31. Dezember 2023: 139.157 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 14.620 EUR (31. Dezember 2023: 20.700 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 444.219	€ 2.630.286	€ 286	€ 3.074.791
Investmentfonds	210.116	31.637	0	241.753
Pensionsgeschäfte	0	76.499	0	76.499
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	370	19.294	0	19.664
<b>Summen</b>	<b>€ 654.705</b>	<b>€ 2.757.716</b>	<b>€ 286</b>	<b>€ 3.412.707</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 350.997	€ 3.029.852	€ 292	€ 3.381.141
Investmentfonds	309.264	3.401	0	312.665
Pensionsgeschäfte	0	358.849	0	358.849
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	63.704	13.481	0	77.185
<b>Summen</b>	<b>€ 723.965</b>	<b>€ 3.405.583</b>	<b>€ 292</b>	<b>€ 4.129.840</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	€ (24)	€ 0	€ (24)	€ (2)	€ 0	€ (2)
BOA	(9.133)	9.630	497	686	(2.500)	(1.814)
BPS	(1.379)	880	(499)	(5.743)	7.890	2.147
BRC	966	(890)	76	(1.298)	2.490	1.192
CBK	1.139	(1.300)	(161)	(3.926)	3.590	(336)
DUB	89	0	89	521	(750)	(229)
GLM	(1.341)	1.200	(141)	824	(730)	94
IND	k. A.	k. A.	k. A.	11	0	11
JPM	(1.122)	1.100	(22)	195	1.160	1.355
MBC	6.082	(5.860)	222	5.541	(5.910)	(369)
MYI	818	(777)	41	738	(1.120)	(382)
RBC	37	0	37	67	2.220	2.287
RYL	18	0	18	966	(1.220)	(254)
SCX	(991)	1.540	549	(4.364)	3.350	(1.014)
SSB	(166)	270	104	897	0	897
UAG	62	0	62	4.966	(8.660)	(3.694)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	78,81	62,16
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	44,25	40,00
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,04	1,50
Investmentfonds	9,68	9,58
Pensionsgeschäfte	3,06	11,00
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,13	1,64
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,86	0,72
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,20)	0,00

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	16,64	10,67
Wandelanleihen & Wechsel	k. A.	0,32
US-Regierungsbehörden	39,25	32,95
US-Schatzobligationen	5,76	3,22
Non-Agency-MBS	4,92	4,52
Forderungsbesicherte Wertpapiere	9,80	9,07
Staatsemissionen	8,01	7,83
Stammaktien	26,37	18,21
Vorzugswertpapiere	0,26	0,00
Real Estate Investment Trusts	0,18	0,18
Kurzfristige Instrumente	11,91	16,69
Investmentfonds	9,68	9,58
Pensionsgeschäfte	3,06	11,00
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,13	1,98
Optionskauf		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Optionen auf Indizes	k. A.	0,02
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Indizes	k. A.	(0,36)

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,03)	0,20
Zinsswaps	0,89	0,52
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,03	k. A.
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	0,00	k. A.
Total Return Swaps auf Indizes	0,04	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,48)	0,06
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,21	(0,05)
Sonstige Aktiva und Passiva	(36,63)	(26,60)
Nettovermögen	100,00	100,00



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	AKTIEN	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>INDIEN</b>					<b>ISRAEL</b>					<b>MEXIKO</b>					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>STAATSEMISSIONEN</b>					<b>STAMMAKTIVEN</b>					
HDFC Bank Ltd.					Israel Government International Bond					Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. (c)					
8,100 % fällig am 22.03.2025	INR	1.380.000	16.528	0,62	5,000 % fällig am 30.10.2026 (j)	€	11.600	\$ 12.627	0,47						
<b>INDONESIEN</b>					<b>ITALIEN</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>					<b>STAATSEMISSIONEN</b>					America Movil S.A.B. de C.V.					
Indonesia Government International Bond					Cassa Depositi e Prestiti SpA					8,460 % fällig am 18.12.2036	MXN	1.800	83	0,00	
6,375 % fällig am 15.04.2032	IDR	221.556.000	13,021	0,49	5,875 % fällig am 30.04.2029	\$	2.100	2.133	0,08	Corp. GEO S.A.B. de C.V.					
6,500 % fällig am 15.02.2031		103.289.000	6,138	0,23	<b>ELFENBEINKÜSTE</b>					8,875 % fällig am 25.09.2014 ^	\$	250	0	0,00	
6,625 % fällig am 15.02.2034		161.079.000	9,547	0,36	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>					9,250 % fällig am 30.06.2020 ^		700	0	0,00	
6,875 % fällig am 15.04.2029		62.053.000	3,781	0,14	Elfenbeinküste					Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.					
7,000 % fällig am 15.09.2030		223.602.000	13,663	0,51	6,852 % fällig am 07.03.2025	€	14.400	15.394	0,57	9,620 % fällig am 28.06.2018	MXN	22.130	0	0,00	
7,000 % fällig am 15.02.2033		44.776.000	2,732	0,10	8,908 % fällig am 19.03.2027		4.740	5.018	0,19	Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.					
7,125 % fällig am 15.06.2038		210.018.000	12,896	0,48	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					8,790 % fällig am 09.12.2014 ^		29.700	0	0,00	
7,125 % fällig am 15.06.2042		34.279.000	2,097	0,08	Ivory Coast Government International Bond										
7,125 % fällig am 15.06.2043		141.844.000	8,686	0,33	4,875 % fällig am 30.01.2032		7.917	7.126	0,27	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
7,500 % fällig am 15.08.2032		44.694.000	2,806	0,10	5,250 % fällig am 22.03.2030		2.022	1.978	0,07	Mexico Government International Bond					
7,500 % fällig am 15.06.2035		236.780.000	14,938	0,56	5,875 % fällig am 17.10.2031		1.500	1.453	0,06	3,000 % fällig am 03.12.2026 (f)		1.089.622	55.110	2,06	
7,500 % fällig am 15.05.2038		109.016.000	6,883	0,26	<b>KASACHSTAN</b>					4,000 % fällig am 30.11.2028 (f)		161.751	8.278	0,31	
7,500 % fällig am 15.04.2040		275.279.000	17,388	0,65	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					4,000 % fällig am 24.08.2034 (f)		176.590	8.643	0,32	
8,250 % fällig am 15.05.2029		83.961.000	5,388	0,20	Development Bank of Kazakhstan JSC					7,500 % fällig am 26.05.2033		563.900	26.568	1,00	
8,250 % fällig am 15.05.2036		2.102.000	140	0,01	5,500 % fällig am 15.04.2027	\$	4.500	4.481	0,17	7,750 % fällig am 29.05.2031		401.902	19.660	0,74	
8,375 % fällig am 15.03.2034		256.683.000	17,109	0,64	<b>KENIA</b>					7,750 % fällig am 23.11.2034		10.900	515	0,02	
9,000 % fällig am 15.03.2029		77.897.000	5,136	0,19	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					7,750 % fällig am 13.11.2042		188.100	8.334	0,31	
Summe Indonesien			142.349	5,33	Republic of Kenya Government International Bond					8,000 % fällig am 07.11.2047		524.629	23.529	0,88	
<b>INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>					17,933 % fällig am 06.05.2030	KES	485.500	3.891	0,14	8,000 % fällig am 31.07.2053		367.200	16.284	0,61	
Project Mercury					18,461 % fällig am 09.08.2032		742.300	6.064	0,23	8,500 % fällig am 01.03.2029		606.000	31.210	1,17	
0,400 % - 8,088 % fällig am 11.08.2030	€	5.000	5.485	0,21	Summe Kenia			9.955	0,37	8,500 % fällig am 31.05.2029		798.340	41.169	1,54	
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic					<b>LUXEMBURG</b>					8,500 % fällig am 18.11.2038		254.700	12.384	0,46	
8,229 % fällig am 26.11.2024	\$	2.733	2.721	0,10	<b>STAMMAKTIVEN</b>					Summe Mexiko			251.684	9,42	
Summe International			8.206	0,31	DrillCo Holding Lux S.A. (c)(f)		7.882	184	0,01	<b>PARAGUAY</b>					
<b>IRLAND</b>					Foresea Holding S.A. 'A' (c)		3.120	73	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					Summe Stammaktien			257	0,01	Paraguay Government International Bond					
Avoca Static CLO DAC					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					7,900 % fällig am 09.02.2031	PYG	45.817.000	6.317	0,24	
5,506 % fällig am 15.10.2030	€	963	1.036	0,04	Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)					<b>PERU</b>					
Black Diamond CLO DAC					3,000 % fällig am 31.12.2026 (b)	\$	338	278	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
4,757 % fällig am 20.01.2032		446	479	0,02	<b>FORESEA Holding S.A.</b>					Banco de Credito del Peru S.A.					
<b>BNPP AM Euro CLO DAC</b>					7,500 % fällig am 15.06.2030		137	128	0,00	4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	11.600	3.009	0,11	
4,506 % fällig am 15.04.2031		500	534	0,02	Summe Luxemburg			663	0,02	<b>Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.</b>					
Carlyle Euro CLO DAC					<b>MALAYSIA</b>					10,100 % fällig am 15.12.2043		106.050	28.375	1,06	
4,606 % fällig am 15.01.2031		4.002	4.295	0,16	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					Summe Peru			31.384	1,17	
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.					Malaysia Government International Bond					<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
4,578 % fällig am 15.11.2031		1.762	1.880	0,07	2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	286.320	56.572	2,12	Peru Government International Bond					
Dryden Euro CLO DAC					3,885 % fällig am 15.08.2029		95.170	20.418	0,76	5,350 % fällig am 12.08.2040			73.600	15.585	0,58
4,688 % fällig am 15.05.2034		7.036	7.540	0,28	4,065 % fällig am 15.06.2050		42.685	8.843	0,33	5,400 % fällig am 12.08.2034			52.700	12.137	0,46
Summe Irland			15.764	0,59	4,504 % fällig am 30.04.2029		30.950	6.810	0,25	6,150 % fällig am 12.08.2032			161.651	40.729	1,53
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					4,696 % fällig am 15.10.2042		84.177	19.185	0,72						
Iridium Capital PLC					4,762 % fällig am 07.04.2037		22.208	5.078	0,19						
9,250 % fällig am 18.06.2029		17.050	18.433	0,69	4,893 % fällig am 08.06.2038		59.810	13.895	0,52						
Summe Irland			34.197	1,28	Malaysia Government Investment Issue										
					4,291 % fällig am 14.08.2043		66.000	14.324	0,54						
					4,417 % fällig am 30.09.2041		68.903	15.238	0,57						
					5,357 % fällig am 15.05.2052		20.417	5.104	0,19						
					Summe Malaysia			165.467	6,19						

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
6,850 % fällig am 12.02.2042	PEN	26.900	\$ 6.701	0,25
6,900 % fällig am 12.08.2037		127.100	31.892	1,19
6,950 % fällig am 12.08.2031		25.800	6.919	0,26
7,300 % fällig am 12.08.2033		49.900	13.387	0,50
		<u>127.350</u>	<u>4,77</u>	
Summe Peru		<u>158.734</u>	<u>5,94</u>	
<b>PHILIPPINEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Philippines Government International Bond				
6,250 % fällig am 14.01.2036	PHP	613.000	9.881	0,37
6,250 % fällig am 28.02.2044		961.020	15.425	0,57
6,750 % fällig am 15.09.2032		105.040	1.816	0,07
Summe Philippinen		<u>27.122</u>	<u>1,01</u>	
<b>POLEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Poland Government International Bond				
1,750 % fällig am 25.04.2032 (j)	PLN	85.200	16.132	0,60
6,000 % fällig am 25.10.2033 (j)		193.300	49.278	1,85
Summe Polen		<u>65.410</u>	<u>2,45</u>	
<b>KATAR</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
QNB Finance Ltd.				
6,900 % fällig am 23.01.2025	IDR	276.200.000	16.801	0,63
<b>RUMÄNIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Romania Government International Bond				
4,150 % fällig am 26.01.2028	RON	153.900	30.970	1,16
4,250 % fällig am 28.04.2036		103.700	17.648	0,66
4,750 % fällig am 11.10.2034		62.000	11.303	0,42
5,000 % fällig am 12.02.2029		12.600	2.549	0,10
5,250 % fällig am 30.05.2032	€	6.400	6.682	0,25
5,625 % fällig am 30.05.2037		6.400	6.622	0,25
7,350 % fällig am 28.04.2031	RON	41.600	9.214	0,34
7,900 % fällig am 24.02.2038		21.000	4.914	0,18
Summe Rumänien		<u>89.902</u>	<u>3,36</u>	
<b>SERBIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Serbia Government International Bond				
4,500 % fällig am 20.08.2032	RSD	371.800	3.152	0,12
<b>SINGAPUR</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Yinson Production Financial Services Pte Ltd.				
9,625 % fällig am 03.05.2029	\$	3.600	3.591	0,14
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Singapore Government International Bond				
1,875 % fällig am 01.10.2051	SGD	7.400	4.236	0,16

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
3,250 % fällig am 01.06.2054	SGD	13.732	\$ 10.501	0,39
		<u>14.737</u>	<u>0,55</u>	
Summe Singapur		<u>18.328</u>	<u>0,69</u>	
<b>SÜDAFRIKA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Entwicklungsbank für das südliche Afrika				
8,600 % fällig am 21.10.2024 (i)	ZAR	221.300	12.045	0,45
Eskom Holdings SOC Ltd.				
0,000 % fällig am 18.08.2027 (d)		100.100	3.404	0,13
0,000 % fällig am 31.12.2032 (d)		254.000	3.346	0,12
		<u>18.795</u>	<u>0,70</u>	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
South Africa Government International Bond				
6,250 % fällig am 31.03.2036		114.500	4.179	0,16
6,500 % fällig am 28.02.2041		184.751	6.192	0,23
7,000 % fällig am 28.02.2031		588.446	27.033	1,01
8,000 % fällig am 31.01.2030 (j)		1.843.127	92.587	3,47
8,250 % fällig am 31.03.2032		498.080	23.805	0,89
8,500 % fällig am 31.01.2037		1.011.900	43.646	1,63
8,750 % fällig am 31.01.2044		432.400	17.761	0,67
8,875 % fällig am 28.02.2035		213.800	9.907	0,37
9,000 % fällig am 31.01.2040		489.800	21.158	0,79
10,500 % fällig am 21.12.2026 (j)		956.132	54.348	2,03
10,500 % fällig am 21.12.2026		470.400	26.738	1,00
		<u>327.354</u>	<u>12,25</u>	
Summe Südafrika		<u>346.149</u>	<u>12,95</u>	
<b>SUPRANATIONAL</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Asian Development Bank				
6,720 % fällig am 08.02.2028	INR	3.363.500	40.268	1,51
Asiatische Infrastrukturinvestmentsbank				
7,000 % fällig am 01.03.2029		6.090.600	72.523	2,71
7,200 % fällig am 25.01.2029		1.474.100	17.601	0,66
7,200 % fällig am 02.07.2031 (a)		1.296.700	15.509	0,58
Europäische Investitionsbank				
2,875 % fällig am 15.11.2029	PLN	108.500	23.551	0,88
6,950 % fällig am 01.03.2029	INR	529.800	6.318	0,24
Inter-American Development Bank				
7,000 % fällig am 25.01.2029		422.000	4.964	0,19
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
6,250 % fällig am 12.01.2028	IDR	191.500.000	11.581	0,43
7,050 % fällig am 22.07.2029	INR	1.767.000	21.463	0,80
Summe Supranational		<u>213.778</u>	<u>8,00</u>	
<b>TANSANIA</b>				
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania				
TBD % fällig am 20.06.2030	\$	6.600	6.552	0,25
9,225 % fällig am 26.04.2028	€	6.545	6.963	0,26
Summe Tansania		<u>13.515</u>	<u>0,51</u>	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
<b>THAILAND</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Thailand Government International Bond				
2,000 % fällig am 17.06.2042	THB	145.900	\$ 3.370	0,13
3,300 % fällig am 17.06.2038		234.832	6.677	0,25
3,390 % fällig am 17.06.2037		501.188	14.401	0,54
3,400 % fällig am 17.06.2036		287.304	8.265	0,31
3,450 % fällig am 17.06.2043		943.655	26.532	0,99
4,000 % fällig am 17.06.2055		231.780	6.936	0,26
Summe Thailand		<u>66.181</u>	<u>2,48</u>	
<b>TÜRKEI</b>				
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
SOCAR Turkey Enerji A/S				
7,348 % fällig am 11.08.2026	€	12.200	13.027	0,49
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Turkey Government International Bond				
26,200 % fällig am 05.10.2033	TRY	798.600	23.896	0,89
37,000 % fällig am 18.02.2026		85.600	2.573	0,10
Türkiye Government Bond				
50,000 % fällig am 17.05.2028		864.656	26.249	0,98
		<u>52.718</u>	<u>1,97</u>	
Summe Türkei		<u>65.745</u>	<u>2,46</u>	
<b>UKRAINE</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Ukraine Government International Bond				
7,253 % fällig am 15.03.2035	\$	7.800	2.258	0,08
7,750 % fällig am 01.08.2041		4.600	2.268	0,09
Summe Ukraine		<u>4.526</u>	<u>0,17</u>	
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC				
5,375 % fällig am 08.05.2029		5.400	5.489	0,20
5,500 % fällig am 08.05.2034		5.400	5.550	0,21
ADCB Finance Cayman Ltd.				
7,500 % fällig am 15.10.2029	IDR	29.000.000	1.758	0,07
8,160 % fällig am 29.04.2029		323.000.000	19.975	0,75
		<u>32.772</u>	<u>1,23</u>	
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
NMC Opco Ltd.				
11,585 % fällig am 25.03.2027	AED	16.490	4.534	0,17
Summe Vereinigte Arabische Emirate		<u>37.306</u>	<u>1,40</u>	
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC				
0,000 % fällig am 05.04.2032 (d)	\$	39.300	25.692	0,96
Petra Diamonds U.S. Treasury PLC				
9,750 % fällig am 08.03.2026		859	606	0,03
		<u>26.298</u>	<u>0,99</u>	



## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 7.863	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (8.020)	\$ 7.863	\$ 7.863	0,29
SAL	5,400	28.06.2024	01.07.2024	16.900	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 31.03.2026	(17.262)	16.900	16.908	0,64
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (25.282)	\$ 24.763	\$ 24.771	0,93

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	49	\$ (90)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	2.236	(204)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	126	(86)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	2	0	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	56	(50)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	27	73	0,00
				\$ (357)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (357)	(0,01)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,700 %	28.03.2034	£ 1.700	\$ 47	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	7.600	44	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	14.000	(200)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	43.400	(394)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	18.09.2026	25.300	(39)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	18.09.2029	INR 5.416.940	296	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,384	20.06.2026	8.667.200	(36)	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,384	20.06.2026	15.211.500	563	0,02
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,397	20.06.2034	3.886.600	(115)	0,00
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,397	20.06.2034	2.208.900	39	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	18.09.2029	4.559.990	(290)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	18.09.2034	1.412.820	130	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,621	20.12.2028	1.148.310	(45)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	19.06.2025	¥ 33.020.000	49	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,232	05.10.2025	41.960.000	(201)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,350	21.03.2026	8.125.000	(49)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	18.09.2029	SGD 82.440	348	0,01
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,322	20.12.2028	49.620	231	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,250	18.09.2029	THB 732.630	198	0,01
Zahlung	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	20.03.2026	4.965.840	133	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	18.09.2029	3.292.970	(392)	(0,01)
Zahlung	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,770	20.12.2028	154.900	67	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	18.12.2025	\$ 12.000	105	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	26.400	1.107	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	4.000	(103)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.09.2029	15.900	(90)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	3.900	(30)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	23.660	866	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	8.400	(93)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	72.000	(1.156)	(0,04)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.09.2054	5.300	(51)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2054	5.700	106	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,600	17.01.2034	1.000	41	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,620	31.01.2034	2.300	(69)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,648	08.01.2034	2.200	83	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,655	24.01.2034	100	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,665	24.01.2034	1.400	(38)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	2.400	84	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,685	24.01.2034	800	(20)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	2.800	(83)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	3.100	(89)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.09.2026	69.100	276	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750 %	20.12.2028	\$ 28.100	\$ 607	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	54.700	(520)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	759.765	6.982	0,27
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	243.000	594	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	108.000	(267)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	63.900	(271)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	2.400	70	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	141.100	(2.837)	(0,11)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	5.200	55	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	20.000	(293)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2036	100	(2)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,783	07.02.2034	2.200	(34)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	2.200	53	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	1.200	7	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	1.800	39	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	4.700	97	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,860	21.02.2034	2.400	(22)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	2.000	26	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	500	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	15.04.2034	2.800	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	22.02.2029	15.500	(150)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	3.600	47	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	16.04.2034	2.800	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	900	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	3.000	20	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,078	29.04.2034	4.700	48	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	17.04.2034	3.800	40	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	05.06.2034	4.300	(22)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,085	22.04.2034	3.800	44	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,090	30.04.2034	11.000	141	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,130	03.05.2034	1.700	25	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	3.200	29	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,155	02.10.2033	5.700	51	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,165	27.09.2033	5.200	51	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	7.000	72	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	4.000	43	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	2.400	36	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	1.900	30	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	4.600	(49)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	2.200	40	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	2.300	78	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	2.600	90	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	4.200	149	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,455	30.06.2026	474.600	251	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,151	04.01.2027	BRL 528.200	(13.016)	(0,49)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,630	04.01.2027	85.900	(701)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,783	04.01.2027	498.300	3.734	0,14
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,795	04.01.2027	227.500	(1.663)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,815	04.01.2027	156.000	(1.091)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,830	02.01.2026	540.400	(2.442)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,832	04.01.2027	142.200	(985)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,840	04.01.2027	185.700	(1.325)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,840	04.01.2027	195.800	1.386	0,05
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	9,842	04.01.2027	234.800	(1.619)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,044	02.01.2029	169.800	(1.563)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,076	04.01.2027	325.100	(2.645)	(0,10)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,164	02.01.2026	14.390	75	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,225	04.01.2027	98.900	(535)	(0,02)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,235	04.01.2027	98.900	(531)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,512	04.01.2027	115.000	(560)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,529	02.01.2026	178.300	536	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,565	04.01.2027	141.200	(591)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,583	02.01.2029	67.500	482	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,602	04.01.2027	259.100	(1.547)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,670	02.01.2025	1.501.800	(44)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,671	04.01.2027	311.000	1.187	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,691	02.01.2026	193.000	(435)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,751	02.01.2026	73.100	(151)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,768	04.01.2027	59.800	232	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,792	04.01.2027	356.400	(1.426)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,811	02.01.2025	542.910	(724)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,872	04.01.2027	135.200	467	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,880	04.01.2027	441.200	1.362	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,943	04.01.2027	243.700	708	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,980	04.01.2027	221.300	(606)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,064	04.01.2027	259.100	(709)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,133	04.01.2027	102.100	236	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,135	04.01.2027	96.300	221	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,169	04.01.2027	96.950	293	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,510	04.01.2027	399.700	449	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,600	04.01.2027	283.100	238	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,736	04.01.2027	164.500	162	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,928 %	02.01.2029	BRL	113.400	\$ (139)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,940	03.01.2033		155.600	(229)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024		288.000	(66)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024		312.400	(154)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024		542.300	883	0,03
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,000	18.09.2029	CAD	36.300	(243)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,000	18.09.2054		7.300	(171)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	18.09.2034		28.400	345	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	18.09.2026		24.800	58	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	18.09.2029	CNY	994.710	871	0,03
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,405	20.12.2028		245.800	(269)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,115	01.02.2031	COP	14.558.000	213	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,120	01.02.2031		10.388.000	152	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,155	15.01.2031		5.060.000	80	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,675	18.06.2031		20.000.000	590	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,290	22.01.2029		65.042.000	(634)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,620	26.02.2034		65.179.100	(501)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,705	26.03.2031		62.868.510	384	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,930	17.05.2029		70.869.400	228	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,990	12.06.2029		50.723.000	107	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,020	04.12.2030		24.925.400	65	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,085	16.05.2029		75.630.200	(131)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,090	21.06.2029		20.565.500	20	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,152	25.04.2029		100.846.700	(153)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,155	24.06.2029		40.481.600	11	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,168	17.06.2029		28.186.700	(8)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,215	14.11.2028		106.774.400	243	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,340	26.02.2026		239.703.800	303	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,360	31.05.2029		64.790.200	(81)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,370	26.04.2029		105.284.000	(68)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,380	28.06.2034		35.592.000	(24)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,415	04.06.2029		66.242.000	(123)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,470	21.06.2026		102.766.000	(44)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,500	04.04.2026		160.424.000	326	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,500	09.04.2026		14.803.000	28	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,510	29.04.2029		27.597.500	(58)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,515	09.04.2026		29.464.200	55	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,540	05.04.2026		48.434.000	89	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,580	28.06.2026		127.080.000	27	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,590	20.06.2026		65.136.400	6	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,600	11.04.2026		82.826.000	(117)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,620	10.04.2026		15.198.400	21	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,650	17.06.2026		174.158.300	(49)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,653	11.04.2026		50.270.500	(59)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,820	05.06.2028		50.580.700	(76)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,860	12.04.2026		66.754.000	(15)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,920	12.04.2026		66.754.000	3	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,050	15.04.2026		30.626.400	21	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,300	26.03.2031		35.440.700	(469)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,490	30.06.2032		6.936.040	117	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,790	20.01.2028		45.916.600	495	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,800	17.01.2028		54.120.000	580	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,820	27.02.2033		9.049.540	(199)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,130	25.01.2028		42.970.500	580	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,400	21.11.2029		3.111.360	(70)	0,00
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,590	18.05.2028	ILS	28.600	132	0,01
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,792	06.11.2028		24.100	(129)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,192	20.06.2034	KRW	11.971.900	30	0,00
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,302	20.06.2026		60.491.010	(28)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,820	20.12.2028		25.400.300	519	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027	ZAR	137.000	140	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,565	22.03.2026		300.200	89	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,881	09.02.2026		502.300	(105)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,070	30.11.2028		83.300	2	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,100	05.06.2026		326.200	(71)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,355	31.01.2030		119.200	78	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	13.07.2025		312.500	(74)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,440	02.11.2028		366.800	248	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,599	05.06.2029		308.400	(291)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,650	31.01.2030		64.630	(53)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,735	31.01.2030		110.200	(114)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,820	31.01.2030		95.300	(120)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	9,330	09.02.2034		108.200	221	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	10,150	18.05.2033		121.800	467	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,420	01.09.2030	CLP	1.005.150	83	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,410	01.09.2030		2.839.400	162	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,640	01.10.2028		4.335.000	131	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,695	14.02.2029		7.079.200	236	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,775	23.02.2026		46.910.600	534	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,800	13.02.2026		8.882.500	146	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,855	18.12.2033		5.907.500	130	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,920	13.02.2034		2.120.600	(85)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,940 %	01.10.2028	CLP	4.815.000	\$ (71)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,980	01.10.2028		6.035.000	(80)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	20.03.2033		5.309.140	203	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	23.02.2034		11.055.300	(257)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,160	01.10.2028		6.310.500	49	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,220	01.10.2028		4.896.800	25	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,230	17.11.2033		721.200	(9)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030		3.103.000	24	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	5,250	13.05.2033		6.921.100	11	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,260	17.11.2028		4.919.000	8	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	18.05.2033		2.475.470	9	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,313	25.04.2034		10.208.500	(62)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,350	01.09.2030		4.575.000	5	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,350	01.10.2034		6.370.000	(21)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	28.06.2026		47.053.000	87	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	18.05.2033		2.594.000	(5)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	26.04.2034		8.585.800	(18)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	01.04.2033		3.613.700	(12)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	16.11.2033		4.525.900	17	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,450	28.06.2034		11.513.000	(75)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,500	13.11.2028		8.851.800	(98)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,550	01.10.2028		3.722.930	41	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,690	01.09.2030		598.400	(11)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	5,750	13.05.2034		7.085.400	(10)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,780	03.10.2028		4.803.000	(90)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,790	06.10.2033		8.590.000	(316)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,820	01.09.2030		1.514.470	(31)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,870	11.10.2033		4.522.700	(183)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,920	02.10.2028		1.891.000	(47)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,940	20.10.2033		1.991.300	(92)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,990	20.10.2033		18.919.110	(955)	(0,04)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,000	02.10.2028		3.721.000	(103)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,146	30.10.2032		32.521.400	(1.928)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,235	26.10.2033		5.823.100	(409)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,524	16.02.2034	CZK	206.300	350	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,534	21.03.2029		497.900	457	0,02
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	3,645	01.02.2029		1.498.300	(1.435)	(0,05)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR	3,765	09.01.2029		425.000	(433)	(0,02)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR	3,850	10.05.2029		174.700	(23)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,070	23.11.2028		255.900	59	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,130	03.06.2029		335.900	(149)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,388	15.11.2028		293.500	339	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028		441.490	298	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	20.03.2044	€	100	(1)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054		12.600	3	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,650	08.01.2034		4.300	109	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,670	03.04.2034		1.400	28	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029		78.800	86	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	05.03.2034		400	(3)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034		67.700	(321)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054		2.200	(30)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	04.03.2034		2.700	(18)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	29.04.2034		4.400	(18)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029		2.000	(10)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,818	26.06.2029		900	4	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029		4.300	(12)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,860	24.04.2029		1.900	(3)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033		5.200	(94)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033		3.000	(61)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029		6.500	32	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033		4.300	(108)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033		3.700	(99)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026		34.800	72	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033		3.600	(120)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,100	20.09.2030		3.000	(34)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033		2.500	(98)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033		3.200	(130)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033		2.200	(116)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033		18.100	52	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033		500	(28)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,760	21.01.2030	HUF	1.296.900	302	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	2,420	02.08.2026		3.964.700	(975)	(0,04)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	2,680	29.06.2031		1.938.800	(713)	(0,03)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	4,790	17.01.2027		7.857.000	(914)	(0,03)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	5,440	15.01.2029		2.611.700	371	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	5,670	15.01.2027		2.079.600	187	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	5,735	14.03.2029		2.712.100	(219)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month HUF-BBR	5,880	08.02.2029		4.716.100	373	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month HUF-BBR	6,040	12.02.2034		163.400	20	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month HUF-BBR	6,080	12.02.2034		411.700	47	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month HUF-BBR	6,100	08.02.2034		2.716.000	301	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6,140	15.02.2034		1.757.500	(4)	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung		6-Month HUF-BBR	6,200 %	20.03.2029	HUF	2.642.600	\$ (70)	0,00
Erhalt		6-Month HUF-BBR	6,220	15.02.2026		8.649.500	103	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>		6-Month HUF-BBR	6,299	10.06.2029		2.872.900	(1)	0,00
Zahlung		6-Month HUF-BBR	6,400	28.03.2029		2.318.400	(4)	0,00
Erhalt		6-Month HUF-BBR	6,450	06.06.2029		3.099.500	(53)	0,00
Zahlung		6-Month HUF-BBR	6,500	02.04.2029		2.694.200	31	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>		6-Month HUF-BBR	6,590	07.05.2029		1.259.400	34	0,00
Zahlung		6-Month HUF-BBR	7,330	06.11.2028		4.993.600	266	0,01
Zahlung		6-Month HUF-BBR	7,610	03.11.2028		2.414.000	565	0,02
Zahlung		6-Month HUF-BBR	8,670	23.05.2029		1.828.200	517	0,02
Erhalt		6-Month HUF-BBR	8,700	16.01.2028		1.002.200	(191)	(0,01)
Zahlung		6-Month HUF-BBR	8,740	28.04.2028		1.920.800	175	0,01
Zahlung		6-Month HUF-BBR	9,230	26.08.2032		1.440.400	864	0,03
Zahlung		6-Month PLN-WIBOR	0,925	16.10.2030	PLN	1.500	(47)	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	1,460	28.05.2026		67.700	(247)	(0,01)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	2,585	14.10.2029		15.200	310	0,01
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	2,920	13.12.2031		3.800	109	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027		37.000	304	0,01
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,560	06.11.2028		82.100	(108)	0,00
Zahlung		6-Month PLN-WIBOR	4,660	19.02.2029		43.700	(200)	(0,01)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,680	03.11.2028		14.200	(57)	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,710	25.05.2027		73.900	232	0,01
Zahlung		6-Month PLN-WIBOR	4,730	16.02.2029		41.100	(157)	(0,01)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,735	09.10.2028		62.400	(164)	(0,01)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,740	25.10.2033		46.000	51	0,00
Zahlung		6-Month PLN-WIBOR	4,810	16.02.2029		49.600	(146)	(0,01)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	4,910	25.07.2027		29.920	(82)	0,00
Zahlung		6-Month PLN-WIBOR	4,923	22.03.2029		167.900	(155)	(0,01)
Zahlung		6-Month PLN-WIBOR	4,970	21.03.2029		96.300	(107)	0,00
Zahlung		6-Month PLN-WIBOR	5,020	21.03.2029		26.100	(10)	0,00
Zahlung		6-Month PLN-WIBOR	5,087	28.06.2034		19.700	(13)	0,00
Zahlung		6-Month PLN-WIBOR	5,158	22.03.2027		339.900	39	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	5,220	20.03.2033		4.100	(9)	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	5,310	21.03.2033		40.800	15	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	5,335	28.06.2026		82.400	20	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	5,870	22.04.2027		1.000	(4)	0,00
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	5,960	25.04.2027		67.900	(346)	(0,01)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	6,456	25.05.2027		20.800	(181)	(0,01)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	6,480	25.05.2027		45.100	(399)	(0,01)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	6,560	25.05.2027		15.800	(148)	(0,01)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024		52.600	(504)	(0,02)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	6,890	22.08.2024		119.500	(1.174)	(0,04)
Erhalt		6-Month PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027		15.300	(225)	(0,01)
Erhalt		28-Day MXN-TIE	8,035	31.05.2029	MXN	42.010	144	0,01
Zahlung		28-Day MXN-TIE	8,300	16.06.2028		437.770	(939)	(0,04)
Erhalt		28-Day MXN-TIE	8,400	23.11.2034		10.100	38	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIE	8,810	29.05.2031		354.500	497	0,02
Zahlung		28-Day MXN-TIE	9,270	23.03.2027		457.700	(326)	(0,01)
Erhalt		28-Day MXN-TIE	9,295	30.10.2028		217.600	223	0,01
Zahlung		28-Day MXN-TIE	9,345	10.04.2034		165.720	(43)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIE	9,440	04.03.2027		485.300	(359)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIE	9,620	30.05.2029		472.050	31	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIE	9,696	23.03.2026		377.300	(247)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIE	9,763	20.03.2026		1.101.900	(689)	(0,03)
Erhalt		28-Day MXN-TIE	9,800	15.06.2029		594.200	(303)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIE	10,055	04.03.2027		248.000	15	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIE	10,090	04.03.2027		130.800	14	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIE	10,285	20.04.2026		2.184.300	213	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>		28-Day MXN-TIE	10,310	08.06.2026		681.000	(20)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIE	10,900	04.06.2025		771.210	(13)	0,00
							\$ (21.558)	(0,81)
							\$ (21.558)	(0,81)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**OPTIONSKAUF****DEVIENSOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus INR	INR 92,600	16.06.2025	2.200	\$ 132	\$ 3	0,00
	Put - OTC USD versus INR	92,600	16.06.2025	2.200	132	200	0,01
	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 18,100	11.07.2024	14.281	95	96	0,00
	Put - OTC USD versus ZAR	18,300	11.07.2024	14.281	145	170	0,01
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,275	06.12.2024	1.994	239	507	0,02
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	06.12.2024	1.708	214	329	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Call - OTC USD versus CNH	CNH	06.12.2024	7.350	22	4	0,00
	Call - OTC USD versus CNH		06.12.2024	7.400	220	344	0,01
	Call - OTC USD versus CNH		14.01.2025	7.325	197	334	0,01
	Call - OTC USD versus CNH		14.01.2025	7.400	192	301	0,01
	Call - OTC USD versus CNH		23.01.2025	7.400	228	305	0,01
BRC	Call - OTC USD versus CNH		14.02.2025	7.300	122	173	0,01
CBK	Call - OTC USD versus CNH		14.01.2025	7.300	253	450	0,02
	Call - OTC USD versus CNH		14.02.2025	7.450	229	274	0,01
GLM	Call - OTC USD versus JPY	¥	05.11.2024	167.000	482	1.430	0,05
JPM	Put - OTC EUR versus PLN	PLN	22.08.2024	4.400	401	1.378	0,05
MBC	Call - OTC USD versus CNH	CNH	06.12.2024	7.350	197	373	0,02
	Call - OTC USD versus CNH		14.02.2025	7.300	11	16	0,00
	Call - OTC USD versus CNH		14.02.2025	7.375	233	323	0,01
MYI	Call - OTC USD versus JPY	¥	29.10.2024	168.000	153	217	0,01
SCX	Call - OTC USD versus CNH	CNH	14.02.2025	7.300	80	120	0,01
					\$ 3.957	\$ 7.347	0,28

### STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs <sup>(2)</sup>	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten <sup>(2)</sup>	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYI	Call - OTC 3-Month vs. 9-Month Forward Volatility Agreement	14,500 %	25.10.2024	12.200	\$ 0	\$ 14	0,00

### VERKAUFSOPTIONEN

#### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus TRY	TRY	01.11.2024	43.800	\$ (192)	\$ (109)	0,00
	Call - OTC USD versus TRY		28.01.2025	49.800	(601)	(450)	(0,02)
	Call - OTC USD versus TRY		01.05.2025	55.000	7.829	(293)	(0,01)
	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR	11.07.2024	17.840	(97)	(75)	0,00
	Put - OTC USD versus ZAR		11.07.2024	18.000	(144)	(137)	(0,01)
CBK	Call - OTC USD versus MXN	MXN	01.07.2024	17.450	(551)	(724)	(0,03)
	Put - OTC USD versus MXN		01.07.2024	17.450	(551)	0	0,00
	Put - OTC USD versus TRY	TRY	03.04.2025	39.000	(187)	(372)	(0,01)
DUB	Call - OTC USD versus TRY		28.10.2024	40.385	(330)	(75)	0,00
	Put - OTC USD versus TRY		28.10.2024	40.385	(329)	(355)	(0,01)
GLM	Put - OTC USD versus TRY		04.07.2024	33.000	(125)	(42)	0,00
	Put - OTC USD versus TRY		03.10.2024	35.500	(124)	(291)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY		30.10.2024	40.250	(333)	(79)	0,00
	Put - OTC USD versus TRY		30.10.2024	40.250	(333)	(346)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY		31.10.2024	39.800	(167)	(44)	0,00
	Put - OTC USD versus TRY		31.10.2024	39.800	(167)	(156)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY		07.11.2024	40.930	(161)	(41)	0,00
	Put - OTC USD versus TRY		07.11.2024	40.930	(161)	(194)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY		07.11.2024	41.150	(161)	(40)	0,00
	Put - OTC USD versus TRY		07.11.2024	41.150	(161)	(202)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY		11.11.2024	41.160	(161)	(43)	0,00
	Put - OTC USD versus TRY		11.11.2024	41.160	(161)	(196)	(0,01)
	Put - OTC USD versus TRY		03.01.2025	36.500	(236)	(166)	(0,01)
	Put - OTC USD versus TRY		07.01.2025	36.500	(223)	(163)	(0,01)
	Put - OTC USD versus TRY		09.01.2025	36.757	(211)	(180)	(0,01)
MYI	Call - OTC USD versus IDR	IDR	13.08.2024	15.370.000	(499)	(949)	(0,04)
	Put - OTC USD versus IDR		13.08.2024	15.370.000	(499)	(2)	0,00
					\$ (7.190)	\$ (5.724)	(0,22)

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	5.700	\$ (26)	\$ (7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	5.700	(26)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,700	05.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	100	0	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	7.000	(21)	(20)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	7.000	(21)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	1.500	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	1.500	(5)	(6)	0,00
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,610	15.07.2024	1.600	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	15.07.2024	1.600	(3)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	1.200	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	1.200	(5)	(1)	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	3.000	(5)	(7)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	3.000	(5)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	3.200	(13)	(10)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	3.200	(13)	(4)	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	4.200	(7)	(6)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	4.200	(7)	(3)	0,00
							\$ (170)	\$ (73)	0,00

## STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs <sup>(2)</sup>	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Prämie <sup>(2)</sup>	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYI	Put - OTC 3-Month vs. 9-Month Forward Volatility Agreement	14,500 %	25.10.2024	12.200	\$ 0	\$ 0	0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.06.2029	\$ 250	\$ 6	\$ 1	\$ 7	0,00
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	8.000	59	(24)	35	0,00
BRC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	20.450	473	134	607	0,02
	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	6.400	(125)	(4)	(129)	0,00
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	12.250	89	(35)	54	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	24.800	(724)	12	(712)	(0,03)
CBK	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	8.700	65	(27)	38	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.700	164	(170)	(6)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	8.000	194	43	237	0,01
MYC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	17.300	484	30	514	0,02
					\$ 685	\$ (40)	\$ 645	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2029	\$ 5.700	\$ (248)	\$ 17	\$ (231)	(0,01)
BRC	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2029	21.300	(1.006)	17	(989)	(0,04)
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2029	8.600	(376)	27	(349)	(0,01)
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	11.200	0	864	864	0,03
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2029	15.400	(561)	(65)	(626)	(0,02)
	Israel Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.100	4	(1)	3	0,00
	Israel Government International Bond	1,000	20.12.2025	13.800	15	(12)	3	0,00
	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.100	0	(1)	(1)	0,00
	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2029	200	(2)	(2)	(4)	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	6.500	(146)	163	17	0,00
	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2029	200	(2)	(2)	(4)	0,00
MYC	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2029	7.600	(368)	15	(353)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2029	7.250	(339)	2	(337)	(0,01)
					\$ (3.029)	\$ 1.022	\$ (2.007)	(0,07)

(1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	\$ 43.787	PHP 2.578.910	\$ (97)	\$ (386)	\$ (483)	(0,02)
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,063 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month IDR-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	36.500	IDR 596.123.530	(117)	274	157	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	\$ 8.261	PHP 486.106	\$ (20)	\$ (87)	\$ (107)	(0,01)
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,428% basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027		ARS 93.789	(3)	2.066	2.063	0,01
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	12.322	PHP 724.510	(21)	(113)	(134)	0,01
MBC	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS zzgl. 0,068 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	INR 1.830.291	\$ 21.852	49	120	169	0,06
SCX	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS zzgl. 0,068 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	3.679.294	43.906	133	121	254	0,01
						\$ (76)	\$ 1.995	\$ 1.919	0,07

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt <sup>(1)</sup>		3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	18.09.2029	MYR 55.370	\$ 92	\$ (16)	\$ 76	0,00
BRC	Zahlung		3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	ILS 28.900	0	(663)	(663)	(0,02)
BSH	Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	3,300	21.06.2029	CLP 3.450.000	0	315	315	0,01
	Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	3,750	22.03.2026	8.000.000	0	(261)	(261)	(0,01)
	Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	3,790	14.03.2026	3.885.000	7	(133)	(126)	0,00
CBK	Erhalt		3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	10.05.2029	COP 27.236.900	0	616	616	0,02
	Erhalt <sup>(1)</sup>		3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	MYR 27.710	36	2	38	0,00
	Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	3,763	24.05.2029	CLP 1.841.700	10	(137)	(127)	(0,01)
	Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	3,770	19.03.2026	64.800	0	(2)	(2)	0,00
GLM	Erhalt		1-Year BRL-CDI	11,730	02.01.2025	BRL 18.800	0	26	26	0,00
	Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	3,015	20.06.2026	CLP 5.555.000	0	250	250	0,01
	Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029	4.122.200	0	(386)	(386)	(0,01)
	Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	3,830	22.05.2029	7.729.900	0	(510)	(510)	(0,02)
	Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	4,095	01.06.2027	12.230.000	0	(411)	(411)	(0,02)
	Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	4,319	22.05.2029	19.808.000	0	(862)	(862)	(0,03)
GST	Zahlung		3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2027	MYR 476.920	64	(193)	(129)	0,00
	Zahlung		3-Month MYR-KLIBOR	3,868	20.12.2028	151.800	286	66	352	0,01
JPM	Erhalt <sup>(1)</sup>		3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	27.440	37	1	38	0,00
	Erhalt <sup>(1)</sup>		3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2029	51.970	(56)	2	(54)	0,00
	Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	3,540	04.06.2029	CLP 4.115.000	0	328	328	0,01
MYC	Zahlung		1-Year BRL-CDI	7,813	04.01.2027	BRL 12.200	17	(207)	(190)	(0,01)
SCX	Erhalt <sup>(1)</sup>		3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2029	MYR 91.170	(26)	(69)	(95)	0,00
							\$ 467	\$ (2.244)	\$ (1.777)	(0,07)

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
SCX	Erhalt	SOFR Index	k. A.	7,300 %	INR 10.000	01.10.2024	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
AZD	07.2024	NZD	18.195	\$	11.164	\$	77	0,00	
	07.2024	\$	899	NZD	1.469	\$	(4)	0,00	
	08.2024	NZD	1.469	\$	899	\$	4	0,00	
	10.2024	CNH	102.720		14.345		156	0,01	
BOA	07.2024	KRW	475.061		347		2	0,00	
	07.2024	PLN	107.075		26.377		0	(253)	(0,01)
	07.2024	SGD	7.427		5.501		21	0	0,00
	07.2024	\$	15.907	€	14.649		0	(207)	(0,01)
	07.2024		35.311	£	27.831		0	(130)	0,00
	07.2024		230	HKD	1.792		0	0	0,00
	07.2024		621	MYR	2.920		0	(1)	0,00
	07.2024		10.629	PLN	42.679		16	(31)	0,00
	07.2024		16.115	SGD	21.873		24	0	0,00
	07.2024		1.464	TRY	49.481		36	0	0,00
	07.2024	ZAR	10.739	\$	588		0	0	0,00
	08.2024	PEN	7.501		1.959		1	0	0,00
	08.2024	SGD	21.841		16.115		0	(24)	0,00
	08.2024	TRY	4.766		138		0	(1)	0,00
	08.2024	\$	115	PKR	33.178		3	0	0,00
	08.2024		9	TRY	332		0	0	0,00
	09.2024		12	INR	977		0	0	0,00
	11.2024	TRY	49.409	\$	1.248		0	(72)	0,00
	11.2024	ZMW	22.529		815		0	(72)	0,00
	12.2024	EGP	129.223		1.958		0	(545)	(0,02)
	01.2025	TRY	137.213		3.152		0	(216)	(0,01)
	02.2025	CNH	31.933		4.471		22	0	0,00
	05.2025	TRY	66.364		1.420		0	(79)	0,00
	03.2030	\$	12.534	IDR	246.110.438		718	0	0,03
BPS	07.2024	AUD	1.882	\$	1.254		0	(3)	0,00
	07.2024	CLP	13.242.047		14.026		0	0	0,00
	07.2024	€	14.589		15.808		172	0	0,01
	07.2024	£	53.802		68.727		716	0	0,03
	07.2024	INR	1.282.430		15.322		0	(59)	0,00
	07.2024	KRW	471.503		344		1	0	0,00
	07.2024	PLN	130.563		32.609		231	(93)	0,01
	07.2024	TRY	218.733		6.480		0	(24)	0,00
	07.2024	\$	16.759	BRL	88.294		0	(863)	(0,03)
	07.2024		7.325	CAD	10.045		16	0	0,00
	07.2024		14.030	CLP	13.242.047		0	(1)	0,00
	07.2024		8.286	€	7.714		5	(23)	0,00
	07.2024		1.115	£	877		0	(6)	0,00
	07.2024		50.692	IDR	827.804.914		0	(99)	0,00
	07.2024		13.824	¥	2.149.000		0	(464)	(0,02)
	07.2024		31.363	PLN	126.068		100	(109)	0,00
	07.2024		8.956	RON	41.572		0	(6)	0,00
	07.2024		177.018	THB	6.518.450		867	(45)	0,03
	08.2024	€	2.376	\$	2.545		0	(5)	0,00
	08.2024	\$	1.255	AUD	1.882		3	0	0,00
	08.2024		8.481	TRY	295.172		71	0	0,00
	09.2024	CNH	37.752	\$	5.262		61	0	0,00
	09.2024	COP	26.803.076		6.641		250	0	0,01
	09.2024	INR	54.644		651		0	(2)	0,00
	09.2024	TWD	44.364		1.379		8	0	0,00
	09.2024	\$	7.715	CLP	7.110.144		0	(187)	(0,01)
	09.2024		3.804	CNH	27.221		0	(54)	0,00
	10.2024		71.080		510.909		0	(506)	(0,02)
	12.2024		8.135		58.340		0	(48)	0,00
	12.2024		1.899	EGP	92.680		0	(104)	0,00
	01.2025	CNH	61.960	\$	8.674		61	0	0,00
BRC	05.2029	KWD	14.212		48.857		1.406	0	0,05
	07.2024	BRL	33.699		6.454		387	0	0,01
	07.2024	€	2.376		2.542		0	(4)	0,00
	07.2024	MXN	214.899		11.750		11	0	0,00
	07.2024	NOK	1.277		121		1	0	0,00
	07.2024	PLN	16.301		4.044		0	(11)	0,00
	07.2024	TRY	20.780		609		0	(6)	0,00
	07.2024	\$	49.382	CZK	1.139.762		0	(593)	(0,02)
	07.2024		9.082	INR	758.454		12	0	0,00
	07.2024		3.796	¥	589.900		0	(129)	0,00
	07.2024		10.913	PLN	43.603		13	(82)	0,00
	07.2024		23.874	RON	110.030		0	(187)	(0,01)
	07.2024		14.852	TRY	503.912		114	0	0,00
	08.2024		10.130		348.444		65	0	0,00
	09.2024	PEN	11.056	\$	2.925		39	0	0,00
	09.2024	TRY	23.054		623		0	(36)	0,00
	09.2024	\$	37.569	MXN	709.459		767	0	0,03
	09.2024		9.893	TRY	366.447		562	0	0,02
	10.2024	TRY	88.426	\$	2.275		0	(165)	(0,01)
	10.2024	\$	4.844	CNH	34.910		0	(22)	0,00
	11.2024		1.248	TRY	49.446		73	0	0,00
	01.2025	TRY	314.875	\$	7.553		0	(338)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2025	\$ 2.528	TRY 110.210	\$ 177	\$ 0	\$ 177	0,01
	02.2025	4.471	CNH 31.916	0	(24)	(24)	0,00
	04.2025	TRY 106.025	\$ 2.314	0	(133)	(133)	(0,01)
	05.2025	\$ 1.420	TRY 66.364	78	0	78	0,00
BSH	07.2024	6.732	CLP 6.330.014	0	(28)	(28)	0,00
	08.2024	PEN 17.214	\$ 4.510	17	0	17	0,00
CBK	07.2024	BRL 388.427	71.428	1.497	0	1.497	0,06
	07.2024	CHF 1.304	1.433	0	(18)	(18)	0,00
	07.2024	CLP 8.016.880	8.714	221	0	221	0,01
	07.2024	€ 14.364	15.557	163	0	163	0,01
	07.2024	£ 968	1.236	12	0	12	0,00
	07.2024	PEN 78.980	20.994	376	0	376	0,01
	07.2024	PLN 73.327	18.057	0	(180)	(180)	(0,01)
	07.2024	SEK 46.162	4.348	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	TRY 125.244	3.715	0	(17)	(17)	0,00
	07.2024	\$ 30.607	BRL 166.935	0	(553)	(553)	(0,02)
	07.2024	5.977	€ 5.487	0	(96)	(96)	0,00
	07.2024	6.689	£ 5.254	0	(47)	(47)	0,00
	07.2024	633	KES 87.354	40	0	40	0,00
	07.2024	12.116	MXN 217.065	0	(264)	(264)	(0,01)
	07.2024	435	NGN 679.196	14	0	14	0,00
	07.2024	3.262	NOK 34.430	0	(29)	(29)	0,00
	07.2024	8.437	PEN 32.162	0	(41)	(41)	0,00
	07.2024	3.462	PHP 203.003	11	0	11	0,00
	07.2024	36.461	PLN 144.660	57	(541)	(484)	(0,02)
	07.2024	2.791	SEK 29.180	0	(36)	(36)	0,00
	07.2024	4.152	TRY 140.591	60	0	60	0,00
	07.2024	4.354	UYU 171.654	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	4.406	ZAR 80.117	0	(24)	(24)	0,00
	07.2024	UYU 311.730	\$ 7.996	159	(15)	144	0,01
	07.2024	ZAR 73.029	3.963	0	(32)	(32)	0,00
	08.2024	COP 71.809.765	18.274	1.066	0	1.066	0,04
	08.2024	EGP 65.307	1.345	12	0	12	0,00
	08.2024	PEN 142.812	37.939	659	0	659	0,02
	08.2024	\$ 50.641	BRL 277.425	0	(875)	(875)	(0,03)
	09.2024	BRL 88.434	\$ 15.962	150	0	150	0,01
	09.2024	INR 4.763.920	56.982	23	(46)	(23)	0,00
	09.2024	MXN 396.187	21.167	0	(241)	(241)	(0,01)
	09.2024	PEN 59.508	15.972	439	0	439	0,02
	09.2024	TWD 16.104	500	2	0	2	0,00
	09.2024	UYU 82.268	2.080	37	0	37	0,00
	10.2024	\$ 13.610	BRL 74.690	0	(298)	(298)	(0,01)
	10.2024	7.613	COP 33.207.906	286	0	286	0,01
	11.2024	EGP 164.182	\$ 3.292	86	0	86	0,00
	12.2024	113.035	1.746	0	(444)	(444)	(0,02)
	12.2024	\$ 1.453	EGP 70.419	0	(90)	(90)	0,00
	01.2025	8.674	CNH 61.924	0	(67)	(67)	0,00
	01.2025	7.613	COP 33.558.104	269	0	269	0,01
	02.2025	UGX 3.866.311	\$ 931	0	(71)	(71)	0,00
	04.2025	\$ 7.613	COP 34.144.305	308	0	308	0,01
	04.2025	2.314	TRY 105.858	129	0	129	0,00
	05.2025	EGP 115.660	\$ 2.202	82	0	82	0,00
	05.2025	KES 573.480	3.888	0	(106)	(106)	0,00
	06.2025	EGP 602.821	11.315	334	0	334	0,01
	10.2025	\$ 3.831	COP 18.664.632	395	0	395	0,02
DUB	07.2024	BRL 66.914	\$ 12.793	747	0	747	0,03
	07.2024	CLP 22.434.595	24.258	493	0	493	0,02
	07.2024	KRW 257.702	187	0	0	0	0,00
	07.2024	NGN 1.580.256	1.274	228	0	228	0,01
	07.2024	\$ 173.546	BRL 874.497	0	(16.106)	(16.106)	(0,60)
	07.2024	3.275	EGP 156.716	0	(23)	(23)	0,00
	07.2024	98.296	MYR 463.442	16	0	16	0,00
	07.2024	162	PLN 644	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	€ 20.306	93.764	1.490	0	1.490	0,06
	08.2024	\$ 5.572	BRL 28.680	0	(428)	(428)	(0,02)
	08.2024	52	KES 7.095	1	0	1	0,00
	08.2024	2.174	PKR 627.199	60	0	60	0,00
	09.2024	KZT 810.316	\$ 1.732	46	0	46	0,00
	09.2024	PEN 47.050	12.644	363	0	363	0,01
	09.2024	\$ 699	KZT 332.420	0	(7)	(7)	0,00
	10.2024	1.118	TRY 45.133	95	0	95	0,00
	11.2024	¥ 1.030.144	\$ 7.297	769	0	769	0,03
	11.2024	ZMW 23.877	859	0	(81)	(81)	0,00
	02.2025	UGX 13.148.833	3.243	0	(168)	(168)	(0,01)
	02.2025	\$ 1.133	PKR 339.900	26	0	26	0,00
	03.2025	1.717	TRY 81.725	208	0	208	0,01
FAR	07.2024	€ 148.171	\$ 161.382	2.580	0	2.580	0,10
	07.2024	¥ 3.411.355	21.845	638	0	638	0,02
	07.2024	\$ 1.470	AUD 2.206	3	0	3	0,00
	07.2024	1.721	NZD 2.822	0	(2)	(2)	0,00
GLM	08.2024	NZD 2.822	\$ 1.721	2	0	2	0,00
	07.2024	BRL 634.813	116.851	2.563	0	2.563	0,10

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	CLP	19.570.280	\$ 21.317	\$ 586	\$ 0	0,02
	07.2024	DOP	704.049	11.974	63	0	0,00
	07.2024	PLN	14.928	3.791	78	0	0,00
	07.2024	\$	1	EGP 49	0	0	0,00
	07.2024		26.681	MXN 485.765	0	(167)	(0,01)
	07.2024		3.060	PLN 12.291	0	(3)	0,00
	07.2024		1.426	UYU 56.204	0	0	0,00
	07.2024	UYU	56.204	\$ 1.469	44	0	0,00
	07.2024	ZAR	650.530	35.557	0	(24)	0,00
	08.2024	DOP	796.425	13.360	3	(69)	0,00
	08.2024	\$	8.870	BRL 48.990	0	(82)	0,00
	08.2024		3.630	COP 15.688.860	129	0	0,00
	09.2024	DOP	1.388.925	\$ 23.131	0	(254)	(0,01)
	09.2024	KZT	788.112	1.684	44	0	0,00
	09.2024	\$	171	MXN 3.190	1	0	0,00
	09.2024		8.806	TRY 331.083	582	0	0,02
	09.2024		3.387	UYU 134.295	0	(55)	0,00
	10.2024		93.919	BRL 515.421	0	(2.058)	(0,08)
	10.2024		33.494	CNH 240.502	0	(272)	(0,01)
	10.2024		3.403	TRY 133.438	245	0	0,01
	11.2024		7.297	¥ 1.031.316	0	(761)	(0,03)
	11.2024		2.355	TRY 96.033	202	0	0,01
	12.2024		3.840	EGP 194.880	0	(81)	0,00
	01.2025		7.553	TRY 314.875	338	0	0,01
	03.2025		14.097	675.308	1.792	0	0,07
	04.2025		15.796	COP 72.164.026	946	0	0,04
	06.2025	EGP	205.248	\$ 3.840	113	0	0,00
IND	07.2024	¥	522.000	3.332	87	0	0,00
	07.2024	\$	18.375	PLN 72.553	0	(331)	(0,01)
JPM	07.2024	CNY	202	\$ 28	0	0	0,00
	07.2024	CZK	178.030	7.684	64	0	0,00
	07.2024	€	2.614	2.797	0	(4)	0,00
	07.2024	INR	1.687.407	20.156	0	(82)	0,00
	07.2024	KES	232.818	1.791	0	(4)	0,00
	07.2024	KRW	318.041	231	0	0	0,00
	07.2024	PLN	62.129	15.432	27	(47)	0,00
	07.2024	SGD	14.451	10.725	62	0	0,00
	07.2024	\$	14.311	CHF 12.739	0	(134)	(0,01)
	07.2024		1.546	CNY 11.027	0	(17)	0,00
	07.2024		3.278	COP 13.681.121	17	0	0,00
	07.2024		6.171	EGP 294.951	0	(88)	0,00
	07.2024		11.654	MXN 214.574	57	0	0,00
	07.2024		10.378	PLN 41.590	13	(47)	0,00
	07.2024		4.299	THB 157.922	10	0	0,00
	07.2024		1.340	UYU 52.667	0	(24)	0,00
	07.2024		3.934	ZAR 71.568	0	(20)	0,00
	07.2024	ZAR	1.232.245	\$ 66.938	0	(460)	(0,02)
	08.2024	CHF	6.116	6.840	9	0	0,00
	08.2024	CNY	11.034	1.546	0	0	0,00
	08.2024	€	5.922	PLN 25.519	0	(19)	0,00
	08.2024	KES	7.095	\$ 54	0	0	0,00
	08.2024	PLN	93.519	€ 20.306	0	(1.429)	(0,05)
	08.2024	TRY	200.346	\$ 5.690	0	(141)	(0,01)
	08.2024	\$	7.568	COP 32.729.708	275	0	0,01
	08.2024		415	NGN 605.627	0	(14)	0,00
	08.2024		950	PKR 272.666	20	0	0,00
	08.2024		1.862	TRY 64.745	29	0	0,00
	09.2024	COP	85.654.561	\$ 20.728	322	(16)	0,01
	09.2024	€	4.640	PLN 22.010	481	0	0,02
	09.2024	INR	902.844	\$ 10.779	0	(24)	0,00
	09.2024	PLN	10.106	€ 2.231	0	(113)	0,00
	09.2024	TWD	27.398	\$ 851	5	0	0,00
	09.2024	\$	6.557	CLP 5.934.965	0	(273)	(0,01)
	09.2024		1.262	EGP 62.644	0	(1)	0,00
	10.2024		49.801	CNH 356.343	0	(578)	(0,02)
	11.2024		2.727	TRY 107.614	137	0	0,01
	12.2024	CNH	58.368	\$ 8.135	44	0	0,00
	12.2024	EGP	99.707	1.628	0	(303)	(0,01)
	12.2024	\$	2.519	EGP 121.881	0	(158)	(0,01)
	01.2025		624	TRY 26.954	37	0	0,00
	03.2025		1.490	72.205	212	0	0,01
	03.2030	IDR	252.540.875	\$ 12.118	0	(1.480)	(0,06)
	03.2030	\$	11.598	IDR 246.110.438	1.654	0	0,06
MBC	07.2024	CAD	26.437	\$ 19.416	96	0	0,00
	07.2024	HUF	5.389.780	14.461	0	(156)	(0,01)
	07.2024	IDR	1.218.033	75	0	0	0,00
	07.2024	INR	49.763	594	0	(2)	0,00
	07.2024	¥	3.474.464	22.058	454	0	0,02
	07.2024	NOK	25.789	2.421	0	(1)	0,00
	07.2024	PLN	168.421	42.809	922	0	0,03
	07.2024	TRY	219.563	6.570	0	(35)	0,00
	07.2024	\$	3.523	AUD 5.297	14	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 11.980	CAD 16.400	\$ 6	\$ (1)	\$ 5	0,00
	07.2024	2.667	CHF 2.376	0	(23)	(23)	0,00
	07.2024	56.589	CZK 1.303.231	0	(803)	(803)	(0,03)
	07.2024	2.681	£ 2.102	0	(24)	(24)	0,00
	07.2024	14.106	¥ 2.241.600	0	(171)	(171)	(0,01)
	07.2024	156.730	PLN 630.586	247	(148)	99	0,00
	07.2024	4.153	UYU 161.488	0	(58)	(58)	0,00
	07.2024	102	ZAR 1.876	1	0	1	0,00
	07.2024	UYU 309.132	\$ 7.842	65	(5)	60	0,00
	08.2024	CAD 12.299	8.989	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	EGP 149.886	3.084	24	0	24	0,00
	08.2024	\$ 9.727	¥ 1.554.333	0	(19)	(19)	0,00
	08.2024	2.421	NOK 25.769	1	0	1	0,00
	09.2024	INR 1.288.359	\$ 15.387	0	(29)	(29)	0,00
	09.2024	TWD 2.508	78	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 267	MXN 4.996	3	0	3	0,00
	09.2024	2.095	UYU 82.233	0	(55)	(55)	0,00
	09.2024	UYU 191.054	\$ 4.861	121	0	121	0,00
	10.2024	CNH 27.343	3.789	12	0	12	0,00
	10.2024	\$ 27.360	CNH 196.442	0	(225)	(225)	(0,01)
	12.2024	CNH 55.945	\$ 7.838	83	0	83	0,00
	12.2024	\$ 7.838	CNH 55.924	0	(86)	(86)	0,00
	02.2025	UGX 11.592.306	\$ 2.875	0	(133)	(133)	(0,01)
MYI	07.2024	BRL 20.489	3.761	72	0	72	0,00
	07.2024	INR 1.299.718	15.528	0	(60)	(60)	0,00
	07.2024	NOK 7.364	691	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	PLN 38.841	9.806	147	0	147	0,01
	07.2024	\$ 82.459	BRL 436.709	0	(3.836)	(3.836)	(0,14)
	07.2024	14.322	€ 13.357	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	15.602	£ 12.309	0	(42)	(42)	0,00
	07.2024	3.853	¥ 576.967	0	(262)	(262)	(0,01)
	07.2024	4.270	NZD 6.963	0	(28)	(28)	0,00
	07.2024	33.079	PLN 130.945	16	(528)	(528)	(0,02)
	07.2024	1.610	SEK 17.003	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	122	ZAR 2.243	1	0	1	0,00
	08.2024	SEK 16.977	\$ 1.610	4	0	4	0,00
	08.2024	\$ 11.411	BRL 62.981	0	(113)	(113)	0,00
	08.2024	2.812	IDR 43.220.440	0	(172)	(172)	(0,01)
	08.2024	691	NOK 7.358	1	0	1	0,00
	09.2024	INR 444.449	\$ 5.315	0	(3)	(3)	0,00
	09.2024	MXN 141.692	7.538	0	(118)	(118)	0,00
	09.2024	TWD 10.899	340	3	0	3	0,00
	09.2024	\$ 131	MXN 2.388	0	(2)	(2)	0,00
	10.2024	5.795	¥ 887.695	0	(176)	(176)	(0,01)
RBC	12.2024	EGP 8.319	\$ 126	0	(35)	(35)	0,00
	07.2024	\$ 1.956	BRL 10.667	0	(36)	(36)	0,00
	07.2024	4.524	COP 18.645.708	0	(42)	(42)	0,00
	07.2024	8.112	£ 6.397	0	(26)	(26)	0,00
	08.2024	£ 6.397	\$ 8.113	25	0	25	0,00
	09.2024	MXN 165.869	8.762	0	(201)	(201)	(0,01)
RYL	07.2024	AUD 5.621	3.750	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	€ 4.744	5.075	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	\$ 2.972	NZD 4.802	0	(46)	(46)	0,00
SCX	10.2024	¥ 888.337	\$ 5.795	172	0	172	0,01
	07.2024	BRL 20.490	3.761	72	0	72	0,00
	07.2024	CNY 10.818	1.521	21	0	21	0,00
	07.2024	€ 136	146	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 2	2	0	0	0	0,00
	07.2024	INR 885.788	10.584	0	(40)	(40)	0,00
	07.2024	KRW 239.262	175	2	0	2	0,00
	07.2024	MXN 819.861	44.231	0	(518)	(518)	(0,02)
	07.2024	MYR 10.894	2.312	1	0	1	0,00
	07.2024	PLN 100.590	25.439	422	0	422	0,02
	07.2024	\$ 294	CZK 6.863	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	137.908	€ 128.657	38	(57)	(19)	0,00
	07.2024	11.732	¥ 1.850.300	0	(230)	(230)	(0,01)
	07.2024	1.056	KES 145.464	65	0	65	0,00
	07.2024	2.695	KRW 3.726.296	11	0	11	0,00
	07.2024	1.534	NGN 2.257.278	13	(53)	(40)	0,00
	07.2024	19.032	PEN 72.109	0	(208)	(208)	(0,01)
	07.2024	76.619	ZAR 1.411.919	607	0	607	0,02
	08.2024	€ 106.661	\$ 114.445	0	(36)	(36)	0,00
	08.2024	NGN 1.533.577	1.084	68	0	68	0,00
	08.2024	PEN 117.283	30.969	352	0	352	0,01
	08.2024	UGX 2.848.361	722	0	(40)	(40)	0,00
	08.2024	\$ 3.425	COP 14.823.400	127	0	127	0,00
	08.2024	294	EGP 16.735	46	0	46	0,00
	08.2024	650	NGN 927.950	0	(36)	(36)	0,00
	09.2024	AED 13.489	\$ 3.674	0	0	0	0,00
	09.2024	CNH 17.738	2.476	32	0	32	0,00
	09.2024	INR 5.132.560	61.325	0	(91)	(91)	0,00
	09.2024	KZT 357.759	761	16	0	16	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	09.2024	MXN	14.269	\$ 759	\$ 0	\$ (12)	0,00	
	09.2024	PEN	11.866	3.146	49	0	0,00	
	09.2024	PHP	2.029.362	34.590	0	(111)	0,00	
	09.2024	TWD	18.619	578	3	0	0,00	
	09.2024	\$	5.481	EGP 269.951	0	(48)	0,00	
	09.2024		754	KZT 357.759	0	(9)	0,00	
	12.2024	EGP	37.942	\$ 599	2	(138)	(0,01)	
	12.2024	\$	4.035	EGP 200.482	0	(160)	(0,01)	
	03.2030	IDR	239.680.000	\$ 10.700	0	(2.206)	(0,08)	
SOG	07.2024	\$	1.070	RSD 117.233	4	0	0,00	
	09.2024		4.030	EGP 198.484	0	(35)	0,00	
SSB	07.2024	BRL	426.642	\$ 78.833	2.022	0	0,08	
	07.2024	IDR	52.819.632	3.200	0	(28)	0,00	
	07.2024	\$	2.661	BRL 14.258	0	(94)	0,00	
	07.2024		18.473	€ 17.014	0	(238)	(0,01)	
	07.2024		5.473	PLN 22.013	1	0	0,00	
	08.2024		78.833	BRL 428.100	0	(2.038)	(0,08)	
	09.2024	PEN	11.600	\$ 3.139	111	0	0,00	
TOR	07.2024	CHF	61	68	0	0	0,00	
	07.2024	\$	1.310	NZD 2.139	0	(7)	0,00	
	07.2024		17.863	PLN 71.197	0	(156)	(0,01)	
	07.2024		2.858	ZAR 51.559	0	(38)	0,00	
	08.2024	NZD	2.139	\$ 1.310	7	0	0,00	
	08.2024	\$	13.590	COP 54.509.110	0	(528)	(0,02)	
UAG	07.2024	CHF	13.754	\$ 15.220	0	(86)	0,00	
	07.2024	\$	1.408	ILS 5.217	0	(22)	0,00	
	07.2024	ZAR	4.383	\$ 238	0	(2)	0,00	
	08.2024	TRY	273.814	7.990	0	(67)	0,00	
	08.2024	\$	16.664	€ 15.561	38	0	0,00	
					\$ 39.927	\$ (51.750)	\$ (11.823)	(0,44)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (11.479)	(0,43)	
Summe Anlagen						\$ 2.985.472	111,72	
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (313.242)	(11,72)	
Nettovermögen						\$ 2.672.230	100,00	

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,44 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 41	\$ 41	0,00
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	14.861	12.045	0,45
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	158	184	0,01
Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022	25.08.2021	2.759	108	0,00
		\$ 17.819	\$ 12.378	0,46

- (j) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 243.934 USD (31. Dezember 2023: 294.989 USD) und Barmittel in Höhe von 1.809 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurde zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 330 USD (31. Dezember 2023: 1.885 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 44.038 USD (31. Dezember 2023: 55.945 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 25.880 USD (31. Dezember 2023: 12.200 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.561.040	\$ 169.678	\$ 2.730.718
Investmentfonds	263.385	0	0	263.385
Pensionsgeschäfte	0	24.763	0	24.763
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(90)	(34.168)	864	(33.394)
<b>Summen</b>	<b>\$ 263.295</b>	<b>\$ 2.551.635</b>	<b>\$ 170.542</b>	<b>\$ 2.985.472</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.660.342	\$ 183.284	\$ 2.843.626
Investmentfonds	233.751	0	0	233.751
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.240	(1.601)	972	611
Einlagen bei Kreditinstituten	0	48.155	0	48.155
<b>Summen</b>	<b>\$ 234.991</b>	<b>\$ 2.706.896</b>	<b>\$ 184.256</b>	<b>\$ 3.126.143</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	3,850 %	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (23.136)	\$ (24.847)	(0,93)
	5,540	27.12.2023	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (4.861)	(5.001)	(0,19)
	5,850	11.12.2023	TBD <sup>(1)</sup>	PLN (37.669)	(9.685)	(0,36)
	5,900	11.12.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(48.671)	(12.512)	(0,47)
	5,900	01.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(21.930)	(5.591)	(0,21)
BRC	4,750	22.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	CZK (406.352)	(17.657)	(0,66)
	4,800	13.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(302.809)	(13.053)	(0,49)
	5,850	10.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	PLN (50.415)	(12.648)	(0,47)
	5,850	03.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(24.670)	(6.165)	(0,23)
	8,400	27.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	ZAR (296.578)	(16.257)	(0,61)
MBC	4,800	10.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	CZK (428.295)	(18.471)	(0,69)
	5,850	22.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	PLN (72.553)	(18.346)	(0,69)
	5,850	10.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(906)	(227)	(0,01)
MEI	8,400	05.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	ZAR (200.936)	(11.070)	(0,41)
	8,400	18.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(750.501)	(41.223)	(1,54)
SCX	5,250	19.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (13.364)	(13.513)	(0,50)
	5,570	21.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(10.697)	(10.865)	(0,41)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (237.131)</b>	<b>(8,87)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 233	\$ 0	\$ 233	\$ 46	\$ 0	\$ 46
BOA	(1.674)	3.990	2.316	(2.401)	(1.960)	(4.361)
BPS	3.236	(2.600)	636	382	(1.630)	(1.248)
BRC	(1.090)	1.500	410	13.436	(14.670)	(1.234)
BSH	(83)	100	17	(528)	470	(58)
CBK	2.580	(2.750)	(170)	(671)	(4.000)	(4.671)
DUB	(11.838)	10.300	(1.538)	1.073	(1.610)	(537)
FAR	3.221	(3.710)	(489)	(58)	0	(58)
GLM	3.184	(3.150)	34	2.281	(2.840)	(559)
GST	(165)	0	(165)	587	(490)	97
IND	(244)	360	116	(673)	500	(173)
JPM	(791)	70	(721)	100	0	100
MBC	950	(430)	520	(4.769)	5.390	621
MYC	(35)	310	275	(128)	310	182
MYI	(5.863)	5.440	(423)	(1.841)	560	(1.281)
RBC	(280)	290	10	116	0	116

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
RYL	\$ 104	\$ 0	\$ 104	\$ (19)	\$ 0	\$ (19)
SCX	(1.768)	2.020	252	(4.266)	4.300	34
SOG	(31)	0	(31)	942	(1.390)	(448)
SSB	(264)	260	(4)	(106)	(280)	(386)
TOR	(722)	880	158	(51)	180	129
UAG	(139)	360	221	95	490	585

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	77,96	80,36
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	21,43	14,63
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,80	3,72
Investmentfonds	9,85	8,11
Pensionsgeschäfte	0,93	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,81)	(0,14)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,43)	0,12
Einlagezertifikate	k. A.	1,67
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(8,87)	(9,77)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Argentinien	k. A.	0,00
Aserbaidschan	0,11	0,10
Brasilien	2,20	2,30
Cayman-Inseln	0,55	0,74
Chile	3,14	3,98
China	2,34	5,25
Kolumbien	5,69	3,74
Tschechische Republik	4,23	4,32
Dänemark	0,00	0,00
Dominikanische Republik	3,31	3,34
Ecuador	0,41	0,35
Ägypten	k. A.	0,22
Ungarn	4,10	1,52
Indien	0,62	k. A.
Indonesien	5,33	9,03
International	0,31	0,38
Irland	1,28	0,60
Israel	0,47	1,14
Italien	0,08	k. A.
Elfenbeinküste	1,16	0,21
Jersey, Kanalinseln	k. A.	0,24
Kasachstan	0,17	k. A.
Kenia	0,37	k. A.
Luxemburg	0,02	0,02
Malaysia	6,19	8,07
Mexiko	9,42	7,94
Paraguay	0,24	k. A.
Peru	5,94	1,88
Philippinen	1,01	0,10
Polen	2,45	7,51
Katar	0,63	0,62
Rumänien	3,36	2,78
Russland	k. A.	0,16
Serbien	0,12	0,11
Singapur	0,69	k. A.
Südafrika	12,95	12,85
Supranational	8,00	0,57
Tansania	0,51	0,93
Thailand	2,48	8,35
Türkei	2,46	0,76
Ukraine	0,17	0,14
Vereinigte Arabische Emirate	1,40	1,10
Großbritannien	1,17	0,22
USA	3,24	1,82
Uruguay	1,19	0,38
Usbekistan	0,29	k. A.
Sambia	0,17	0,16
Kurzfristige Instrumente	2,22	4,78
Investmentfonds	9,85	8,11
Pensionsgeschäfte	0,93	k. A.

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,08)
Zinsswaps	(0,81)	(0,06)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,28	0,08
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,22)	(0,48)
Zinsswapoptionen	0,00	(0,01)
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,02	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,07)	0,03
Cross-Currency Swaps	0,07	0,21
Zinsswaps	(0,07)	(0,02)
Total Return Swaps auf Indizes	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,44)	0,31
Einlagezertifikate	k. A.	1,67
Sonstige Aktiva und Passiva	(11,72)	(8,51)
Nettovermögen	100,00	100,00



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
<b>RUMÄNIEN</b>				<b>ASIATISCHE INFRASTRUKTURINVESTMENTBANK</b>				<b>URUGUAY</b>						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Asiatische Infrastrukturinvestmentbank</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
Romania Government International Bond				4,250 % fällig am 27.01.2027	PHP	600	\$ 10	0,01	Uruguay Government International Bond					
4,150 % fällig am 26.01.2028	RON	13.100	\$ 2.636	2,32	7,000 % fällig am 01.03.2029	INR	220.700	2,628	3,400 % fällig am					
4,250 % fällig am 28.04.2036		5.965	1.015	0,90	7,200 % fällig am 25.01.2029		51.400	614	16.05.2045 (d)	UYU	30.121	\$ 761	0,67	
4,750 % fällig am 11.10.2034		440	80	0,07	7,200 % fällig am 02.07.2031 (a)		37.000	443	8,500 % fällig am					
4,850 % fällig am 22.04.2026		4.400	928	0,82	<b>Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung</b>			15.03.2028		3.200		79	0,07	
5,250 % fällig am 30.05.2032	€	300	313	0,28	3,010 % fällig am 13.03.2028	PLN	600	137	9,750 % fällig am					
5,625 % fällig am 30.05.2037		300	311	0,27	5,080 % fällig am 15.12.2025	MXN	1.900	95	20.07.2033		22.100		562	0,50
7,900 % fällig am 24.02.2038	RON	900	211	0,19	<b>Europäische Investitionsbank</b>			Summe Uruguay				1.402	1,24	
8,000 % fällig am 29.04.2030		2.600	593	0,52	2,875 % fällig am 15.11.2029	PLN	10.823	2.349						
Summe Rumänien			6.087	5,37	6,950 % fällig am 01.03.2029	INR	18.400	219	0,19	<b>USBEKISTAN</b>				
<b>SERBIEN</b>				<b>Inter-American Development Bank</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>7,000 % fällig am 25.01.2029</b>				<b>National Bank of Uzbekistan</b>						
Serbia Government International Bond					<b>Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung</b>			<b>19,875 % fällig am</b>						
6,000 % fällig am 12.06.2034	\$	400	394	0,35	4,500 % fällig am 22.01.2026	ZAR	2.200	114	0,10	05.07.2027 (a)	UZS	4.070.000	324	0,29
<b>SINGAPUR</b>				<b>6,750 % fällig am 09.02.2029</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>6,750 % fällig am 22.07.2029</b>				<b>COMMERCIAL PAPER</b>						
Singapore Government International Bond					7,070 % fällig am 26.06.2029	MXN	1.400	69	0,06	<b>Global Payments, Inc.</b>				
1,875 % fällig am 01.10.2051	SGD	300	172	0,15	8,250 % fällig am 21.12.2026	ZAR	40.000	2.202	1,93	5,970 % fällig am				
3,250 % fällig am 01.06.2054		490	375	0,33	8,500 % fällig am 06.04.2026	MXN	2.300	122	0,11	01.07.2024	\$	600	600	0,53
Summe Singapur			547	0,48	9,750 % fällig am 21.01.2027	BRL	750	132	0,12	6,030 % fällig am				
<b>SÜDAFRIKA</b>				<b>Summe Supranational</b>				<b>18.07.2024</b>						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>7,000 % fällig am 25.01.2029</b>				<b>250</b>						
South Africa Government International Bond					<b>Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung</b>			<b>249</b>						
2,000 % fällig am					4,500 % fällig am 22.01.2026	ZAR	2.200	114	0,10	<b>849</b>				
31.01.2025 (d)	ZAR	8.998	485	0,43	4,750 % fällig am 21.01.2027	IDR	2.880.000	169	0,15	<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>				
6,250 % fällig am 31.03.2036		7.100	259	0,23	6,750 % fällig am 09.02.2029	ZAR	23.800	1.229	1,08	<b>25,548 % fällig am</b>				
7,000 % fällig am 28.02.2031		14.500	666	0,59	7,070 % fällig am 26.06.2029	MXN	1.400	69	0,06	<b>10.09.2024 (b)(c)</b>				
8,000 % fällig am 31.01.2030		77.600	3.898	3,44	8,250 % fällig am 21.12.2026	ZAR	40.000	2.202	1,93	<b>EGP</b>				
8,250 % fällig am 31.03.2032		16.800	803	0,71	8,500 % fällig am 06.04.2026	MXN	2.300	122	0,11	<b>35.775</b>				
8,500 % fällig am 31.01.2037		48.000	2.071	1,82	9,750 % fällig am 21.01.2027	BRL	750	132	0,12	<b>709</b>				
8,750 % fällig am 31.01.2044		21.500	883	0,78	Summe Thailand		2.940	2,59		<b>0,63</b>				
8,750 % fällig am 28.02.2048		3.900	159	0,14	<b>TÜRKEI</b>			<b>25,751 % fällig am</b>						
8,875 % fällig am 28.02.2035		6.200	288	0,25	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			<b>30.07.2024 (b)(c)</b>						
9,000 % fällig am 31.01.2040		20.400	881	0,77	<b>Türkiye Is Bankasi A/S</b>			<b>16.525</b>						
10,500 % fällig am 21.12.2026		35.100	1.995	1,76	<b>7,750 % fällig am 12.06.2029</b>			<b>25,751 % fällig am</b>						
Summe Südafrika			12.388	10,92	<b>\$</b>			<b>16.000</b>						
<b>SUPRANATIONAL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>25,851 % fällig am</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Türkey Government International Bond</b>				<b>26.11.2024 (b)(c)</b>						
Asian Development Bank					26,200 % fällig am					<b>27.08.2024 (b)(c)</b>				
6,000 % fällig am 05.02.2026	BRL	750	127	0,11	05.10.2033	TRY	19.200	575	0,50	<b>16.600</b>				
6,720 % fällig am 08.02.2028	INR	119.100	1.426	1,26	<b>Türkiye Government Bond</b>			<b>6.200</b>						
12,750 % fällig am 03.03.2025	COP	539.000	132	0,12	50,000 % fällig am					<b>117</b>				
					17.05.2028					<b>0,10</b>				
					Summe Türkei		1.995	1,76		<b>333</b>				
							1.695	1,49		<b>0,29</b>				
							1.995	1,76		<b>1.809</b>				
										<b>1,60</b>				
										<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				
										<b>5,390 % fällig am</b>				
										<b>08.10.2024 (b)(c)(f)</b>				
										<b>\$</b>				
										<b>1.400</b>				
										<b>1.380</b>				
										<b>1,22</b>				
										<b>Summe kurzfristige Instrumente</b>				
										<b>4.235</b>				
										<b>3,74</b>				
										<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>				
										<b>\$</b>				
										<b>112.555</b>				
										<b>99,26</b>				

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
MBC	5,400 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 4.800	U.S. Treasury Bonds 3,750 % fällig am 15.11.2043	\$ (4.884)	\$ 4.800	\$ 4.802	4,23
SSB	2,600	28.06.2024	01.07.2024	644	U.S. Treasury Notes 1,125 % - 4,125 % fällig am 28.02.2027 - 31.07.2028	(657)	644	644	0,57
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (5.541)	\$ 5.444	\$ 5.446	4,80

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	3	\$ (5)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	96	(9)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	11	(3)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	15	8	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	4	(4)	0,00
				\$ (13)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (13)	(0,01)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,700 %	28.03.2034	£ 100	\$ 3	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	300	2	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	600	(6)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	2.600	(21)	(0,02)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	18.09.2026	1.200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,000	20.03.2029	800	(12)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	18.09.2029	INR 27.280	1	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,384	20.06.2026	283.100	6	0,00
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,397	20.06.2034	72.500	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	18.09.2029	308.290	(20)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	19.06.2025	¥ 1.490.000	2	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,232	05.10.2025	1.490.000	(8)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,350	21.03.2026	575.000	(2)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	18.09.2029	SGD 2.950	12	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,250	18.09.2029	THB 61.760	17	0,01
Zahlung	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	20.03.2026	117.610	(17)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	18.09.2029	135.600	(16)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.09.2029	\$ 700	(4)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	25	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	3.100	(50)	(0,04)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.09.2054	200	(2)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2054	200	4	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.09.2026	2.900	12	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	1.350	(24)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	200	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	6.800	43	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	20.535	242	0,21
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	10.300	25	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	4.600	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	1.100	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	1.000	6	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	5.100	(101)	(0,09)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	200	2	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	900	(13)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	22.02.2029	300	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	17.04.2034	400	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,085	22.04.2034	400	5	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,130	03.05.2034	400	6	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,455	30.06.2026	20.300	11	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,783	04.01.2027	BRL 9.200	70	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,795	04.01.2027	8.500	(62)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,808	02.01.2026	18.000	(83)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,815	04.01.2027	5.800	(41)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,832	04.01.2027	5.200	(36)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,840	04.01.2027	6.600	(47)	(0,04)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	9,842	04.01.2027	12.100	(83)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,076	04.01.2027	1.100	(9)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,083	02.01.2026	110	(1)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,225	04.01.2027	4.100	(22)	(0,02)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,235	04.01.2027	4.100	(22)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,386	02.01.2029	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,512	04.01.2027	60.300	(408)	(0,36)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,529	02.01.2026	300	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,565	04.01.2027	1.400	(6)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,602	04.01.2027	900	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,660	02.01.2025	31.700	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,670	02.01.2025	25.600	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,671	04.01.2027	13.400	51	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,691	02.01.2026	1.100	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,751	02.01.2026	5.800	(25)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,768	04.01.2027	200	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,811	02.01.2025	1.310	(2)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,872	04.01.2027	500	2	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,880	04.01.2027	18.700	58	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,943	04.01.2027	11.500	33	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,980	04.01.2027	9.400	(26)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,064	04.01.2027	400	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,133	04.01.2027	10.200	24	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,169	04.01.2027	520	2	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,510	04.01.2027	6.800	8	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,600	04.01.2027	12.000	10	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,603	04.01.2027	8.400	7	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,736	04.01.2027	7.000	7	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,928	02.01.2029	4.800	(6)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,940	03.01.2033	6.600	(10)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024	900	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490 %	01.07.2024	BRL	900	\$ 0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024		900	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024		1.800	3	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,000	18.09.2029	CAD	1.500	(10)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,000	18.09.2054		300	(7)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	18.09.2034		1.200	15	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	18.09.2026		1.000	2	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,620	26.02.2034	COP	2.514.700	(18)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,705	26.03.2031		906.800	4	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,715	18.09.2030		83.500	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,800	30.06.2032		44.500	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,910	17.05.2029		2.930.600	10	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,990	12.06.2029		2.168.100	5	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,085	16.05.2029		3.710.700	(6)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,090	21.06.2029		818.000	1	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,152	25.04.2029		4.274.700	(7)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,155	24.06.2029		1.855.800	1	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,168	17.06.2029		1.156.400	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,190	13.06.2029		180.300	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,305	28.04.2028		39.570	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,340	26.02.2026		9.251.400	11	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,360	31.05.2029		2.764.700	(3)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,370	26.04.2029		4.552.000	(3)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,380	28.06.2034		1.255.000	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,415	04.06.2029		2.944.200	(5)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,470	21.06.2026		3.978.000	(2)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,500	04.04.2026		4.909.000	10	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,500	09.04.2026		622.000	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,510	29.04.2029		1.176.000	(2)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,515	09.04.2026		1.237.400	2	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,540	05.04.2026		2.232.000	4	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,580	28.06.2026		4.443.000	1	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,590	20.06.2026		3.292.000	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,600	11.04.2026		3.448.500	(5)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,650	17.06.2026		7.423.700	(2)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,653	11.04.2026		2.093.000	(2)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,860	12.04.2026		2.387.000	(1)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,920	12.04.2026		2.387.000	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,950	24.03.2030		81.280	(1)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,050	15.04.2026		1.510.200	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,300	26.03.2031		122.840	(2)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,370	17.03.2030		47.800	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,393	21.03.2030		53.400	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,410	26.03.2031		123.400	(2)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,423	17.03.2030		100.800	(1)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,500	19.10.2033		220.600	4	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,930	07.03.2033		34.420	(1)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,192	20.06.2034	KRW	511.760	1	0,00
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,302	20.06.2026		2.585.780	(1)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,860	22.11.2025	ZAR	600	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,881	09.02.2026		21.500	(4)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,100	05.06.2026		1.000	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,130	25.01.2029		10.200	5	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,140	16.11.2028		1.000	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,210	21.12.2026		700	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	10.11.2028		700	(1)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,599	05.06.2029		13.200	(12)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,735	31.01.2030		300	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,820	31.01.2030		37.370	(1)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	9,330	09.02.2034		4.600	9	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	10,150	18.05.2033		300	1	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,775	23.02.2026	CLP	2.136.100	25	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,855	18.12.2033		202.400	4	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	20.03.2033		5.340	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	23.02.2034		504.300	(12)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,070	24.06.2031		268.600	(4)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,200	13.06.2034		363.000	(5)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,230	17.11.2033		2.480.700	65	0,06
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	5,250	13.05.2033		295.900	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,260	17.11.2028		8.100	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,310	16.11.2028		5.600	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,320	16.11.2028		736.100	11	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	28.06.2026		1.806.000	3	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	26.04.2034		83.200	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	16.11.2033		13.100	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,450	28.06.2034		441.000	(3)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,631	23.08.2028		15.700	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,690	01.09.2030		1.800	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	5,750	13.05.2034		302.900	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,770	21.11.2027		28.300	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,780	03.10.2028		14.200	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,790	06.10.2033		15.000	(1)	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,855 %	05.10.2033	CLP 33.000	\$ (1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,870	11.10.2033	14.200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,920	02.10.2028	18.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,940	20.10.2033	6.100	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,990	20.10.2033	60.410	(3)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,000	02.10.2028	35.000	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,070	28.02.2028	55.800	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,146	30.10.2032	97.000	(6)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,235	26.10.2033	25.300	(2)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		3,534	21.03.2029	CZK 14.900	14	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		3,645	01.02.2029	42.100	(38)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR		3,765	09.01.2029	14.700	(15)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR		3,850	10.05.2029	6.300	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		4,130	03.06.2029	17.200	(8)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		2,500	18.09.2054	€ 800	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,670	03.04.2034	100	2	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	18.09.2029	5.000	3	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	18.09.2034	3.100	(15)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	20.03.2054	100	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,760	03.01.2029	100	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,827	06.05.2029	100	0	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,860	24.04.2029	1.300	(2)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,880	19.12.2028	3.600	(5)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		2,950	12.06.2029	100	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	18.09.2026	1.400	3	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,100	20.09.2030	1.300	1	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,300	03.10.2033	2.900	13	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR		5,735	14.03.2029	HUF 155.200	(13)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		6,140	15.02.2034	76.100	0	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR		6,220	15.02.2026	374.900	4	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month HUF-BBR		6,299	10.06.2029	120.400	0	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR		6,400	28.03.2029	61.700	0	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR		6,450	06.06.2029	97.200	(2)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR		6,500	02.04.2029	276.100	3	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR		7,610	03.11.2028	328.100	(38)	(0,03)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		10,570	22.08.2027	4.800	2	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		4,660	19.02.2029	PLN 1.600	(7)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,710	25.05.2027	600	2	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		4,730	16.02.2029	700	(3)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,735	09.10.2028	200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,740	25.10.2033	100	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		4,810	16.02.2029	800	(2)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,910	25.07.2027	170	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		4,923	22.03.2029	7.300	(7)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		4,970	21.03.2029	2.500	(3)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		5,020	21.03.2029	700	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		5,087	28.06.2034	800	(1)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		5,295	25.01.2028	15.750	90	0,08
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		5,335	28.06.2026	3.500	1	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,830	19.08.2024	100	(1)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,890	22.08.2024	300	(3)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		8,739	13.03.2034	MXN 4.500	11	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,900	21.05.2027	1.300	(2)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		8,994	03.09.2026	1.490	2	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		9,055	03.09.2026	300	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		9,270	23.03.2027	21.600	21	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	28-Day MXN-TIIE		9,440	29.05.2034	4.710	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		9,605	30.05.2029	3.080	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		9,620	30.05.2029	37.800	2	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		9,696	23.03.2026	61.400	(40)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		9,705	23.03.2026	30.700	(20)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		9,740	03.09.2026	8.500	5	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		9,760	23.03.2026	16.700	(10)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		9,763	20.03.2026	42.300	(26)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		9,800	15.06.2029	2.300	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		10,285	20.04.2026	88.600	9	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	28-Day MXN-TIIE		10,310	08.06.2026	29.100	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		10,560	19.06.2026	5.000	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		10,900	04.06.2025	32.160	(1)	0,00
						\$ (561)	(0,49)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (561)</b>	<b>(0,49)</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 18,100	11.07.2024	611	\$ 4	\$ 4	0,00
	Put - OTC USD versus ZAR	18,300	11.07.2024	611	6	8	0,01
MBC	Put - OTC USD versus MXN	MXN 17,540	09.07.2024	548	3	0	0,00
MYI	Call - OTC USD versus JPY	¥ 168,000	29.10.2024	73	7	9	0,01
SCX	Call - OTC USD versus JPY	167,000	05.11.2024	28	2	4	0,00
					\$ 22	\$ 25	0,02

##### STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs <sup>(2)</sup>	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten <sup>(2)</sup>	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYI	Call & Put - OTC 3-Month vs. 9-Month Forward Volatility Agreement	14,500 %	25.10.2024	400	\$ 0	\$ 1	0,00

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
BOA	Call - OTC USD versus TRY	TRY 43,800	01.11.2024	331	\$ (8)	\$ (5)	0,00	
	Call - OTC USD versus TRY	49,800	28.01.2025	794	(26)	(19)	(0,02)	
	Call - OTC USD versus TRY	55,000	01.05.2025	331	(14)	(12)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 17,840	11.07.2024	1.222	(4)	(3)	0,00	
	Put - OTC USD versus ZAR	18,000	11.07.2024	1.222	(6)	(6)	(0,01)	
CBK	Put - OTC USD versus TRY	TRY 39,000	03.04.2025	520	(8)	(6)	(0,01)	
GLM	Put - OTC USD versus TRY	33,000	04.07.2024	299	(4)	(1)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	35,500	03.10.2024	477	(5)	(12)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY	40,250	30.10.2024	10	(1)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	40,250	30.10.2024	10	(1)	(1)	0,00	
	Call - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	5	(1)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	5	(1)	0	0,00	
	Call - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	5	0	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	5	0	(1)	0,00	
	Call - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	5	(1)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	5	0	(1)	0,00	
	Call - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	5	(1)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	5	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	36,500	03.01.2025	302	(8)	(6)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY	36,500	07.01.2025	304	(8)	(6)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY	36,757	09.01.2025	305	(8)	(7)	(0,01)	
	MBC	Put - OTC USD versus MXN	MXN 17,180	09.07.2024	1.096	(2)	0	0,00
		Call - OTC USD versus MXN	18,725	09.07.2024	548	(5)	(2)	0,00
	MYI	Call - OTC USD versus IDR	IDR 15.370,000	13.08.2024	45	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC USD versus IDR	15.370,000	13.08.2024	45	(1)	0	0,00	
					\$ (115)	\$ (102)	(0,09)	

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	100	0	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	300	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	300	(1)	0	0,00
RYL	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	100	0	0	0,00
							\$ (6)	\$ (4)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

<sup>(2)</sup> Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>**

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.06.2029	\$ 600	\$ 14	\$ 4	\$ 18	0,01
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	300	2	(1)	1	0,00
BPS	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	700	20	1	21	0,02
BRC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	300	7	2	9	0,01
	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	200	(4)	0	(4)	0,00
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	500	4	(2)	2	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	850	(25)	0	(25)	(0,02)
CBK	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	400	3	(1)	2	0,00
GST	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	300	7	2	9	0,01
					\$ 28	\$ 5	\$ 33	0,03

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(2)</sup>**

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2029	\$ 200	\$ (9)	\$ 1	\$ (8)	(0,01)
BRC	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2029	900	(43)	1	(42)	(0,04)
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2029	400	(17)	1	(16)	(0,01)
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2029	700	(25)	(3)	(28)	(0,03)
JPM	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2029	300	(15)	1	(14)	(0,01)
MYC	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2029	300	(14)	0	(14)	(0,01)
					\$ (123)	\$ 1	\$ (122)	(0,11)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	\$ 2.133	PHP 125.690	\$ (5)	\$ (19)	\$ (24)	(0,02)
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	116	6.830	0	(1)	(1)	0,00
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	12	730	0	0	0	0,00
SCX	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS zzgl. 0,068 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	INR 134.714	\$ 1.608	5	4	9	0,01
						\$ 0	\$ (16)	\$ (16)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	18.09.2026	MYR 17.770	\$ (1)	\$ (2)	\$ (3)	0,00
	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	2.360	4	(1)	3	0,00
CBK	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	1.560	2	0	2	0,00
JPM	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	1.590	2	0	2	0,00
	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2029	2.960	(3)	0	(3)	0,00
						\$ 4	\$ (3)	\$ 1	0,00

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2024	DOP	1.189	\$ 20	\$ 0	\$ 0	0,00	
	07.2024	€	4.605	5.000	64	64	0,06	
	07.2024	HUF	45.195	123	0	0	0,00	
	07.2024	KRW	12.802	9	0	0	0,00	
	07.2024	NZD	783	478	1	0	0,00	
	07.2024	PLN	4.569	1.126	0	(11)	(0,01)	
	07.2024	SGD	202	149	1	0	1	0,00
	07.2024	\$	1.391	1.096	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024		195	HUF 72.054	0	0	0	0,00
	07.2024		1.053	PLN 4.282	12	0	12	0,01
	07.2024	ZAR	513	\$ 28	0	0	0	0,00
	08.2024	PEN	394	103	0	0	0	0,00
	08.2024	SGD	1.138	840	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$	96	PKR 27.696	3	0	3	0,00
	11.2024	TRY	2.096	\$ 53	0	(3)	(3)	0,00
	12.2024	EGP	2.340	35	0	(10)	(10)	(0,01)
	01.2025	TRY	5.867	135	0	(9)	(9)	(0,01)
	05.2025		2.804	60	0	(3)	(3)	0,00
	BPS	07.2024	AUD	83	55	0	0	0,00
		07.2024	BRL	618	114	3	0	3
07.2024		CAD	1.156	847	2	0	2	0,00
07.2024		CLP	521.527	552	0	0	0	0,00
07.2024		£	2.038	2.603	27	0	27	0,02
07.2024		¥	331.475	2.119	58	0	58	0,05
07.2024		KRW	12.705	9	0	0	0	0,00
07.2024		PLN	6.737	1.691	16	0	16	0,01
07.2024		SGD	314	232	0	0	0	0,00
07.2024		TRY	460	14	0	0	0	0,00
07.2024		\$	786	BRL 4.140	0	(41)	(41)	(0,04)
07.2024			311	CAD 426	1	0	1	0,00
07.2024			553	CLP 521.527	0	0	0	0,00
07.2024			1.199	€ 1.109	0	(10)	(10)	(0,01)
07.2024			5.791	MYR 27.285	0	(3)	(3)	0,00
07.2024			3.940	PLN 15.914	21	(3)	18	0,02
07.2024			7.196	THB 265.080	36	0	36	0,03
08.2024		TRY	3.288	\$ 94	0	(1)	(1)	0,00
08.2024		\$	55	AUD 83	0	0	0	0,00
08.2024			232	SGD 314	0	0	0	0,00
08.2024			186	TRY 6.486	1	0	1	0,00
09.2024		COP	1.376.276	\$ 341	13	0	13	0,01
09.2024		INR	7.173	86	0	0	0	0,00
09.2024		\$	629	CLP 580.715	0	(14)	(14)	(0,01)
09.2024			524	TWD 16.872	0	(3)	(3)	0,00
12.2024			52	EGP 2.554	0	(3)	(3)	0,00
05.2029		KWD	610	\$ 2.096	60	0	60	0,05
07.2024		\$	63	AUD 95	1	0	1	0,00
07.2024			942	¥ 147.000	0	(28)	(28)	(0,02)
07.2024			22	NOK 226	0	0	0	0,00
07.2024		3.767	PLN 14.847	0	(74)	(74)	(0,07)	
07.2024		596	RON 2.754	1	(4)	(3)	0,00	
07.2024		177	TRY 5.997	1	0	1	0,00	
08.2024	TRY	7.552	\$ 219	0	(2)	(2)	0,00	
08.2024	\$	209	TRY 7.131	1	0	1	0,00	
09.2024	TWD	55.700	\$ 1.711	0	(10)	(10)	(0,01)	
09.2024	\$	2.428	MXN 45.805	47	0	47	0,04	
09.2024		151	TRY 5.584	9	0	9	0,01	
10.2024	TRY	3.717	\$ 96	0	(7)	(7)	(0,01)	
11.2024	\$	53	TRY 2.098	3	0	3	0,00	
01.2025	TRY	11.397	\$ 273	0	(12)	(12)	(0,01)	
01.2025	\$	108	TRY 4.721	8	0	8	0,01	
04.2025	TRY	4.458	\$ 97	0	(6)	(6)	0,00	
05.2025	\$	60	TRY 2.804	3	0	3	0,00	
CBK	07.2024	BRL	3.559	\$ 662	21	0	21	0,02
	07.2024	CHF	57	63	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	CLP	261.280	284	7	0	7	0,01

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2024	€	677	\$	732	\$	7	0,01
	07.2024	£	37		47		1	0,00
	07.2024	¥	52.900		336		7	0,01
	07.2024	MXN	7.240		393		0	0,00
	07.2024	PEN	12.788		3.409		71	0,06
	07.2024	PLN	12.717		3.138		2	(0,02)
	07.2024	SEK	1.990		187		0	0,00
	07.2024	\$	1.426	BRL	7.776		0	(0,02)
	07.2024		679	COP	2.756.653		0	(0,01)
	07.2024		1.522	€	1.418		0	0,00
	07.2024		247	£	194		0	0,00
	07.2024		27	KES	3.726		2	0,00
	07.2024		597	MXN	10.800		0	(0,01)
	07.2024		311	PEN	1.186		0	0,00
	07.2024		193	PHP	11.317		1	0,00
	07.2024		2.671	PLN	10.714		6	(0,01)
	07.2024		121	SEK	1.260		0	0,00
	07.2024		116	TRY	3.931		2	0,00
	07.2024		165	UYU	6.502		0	0,00
	07.2024		183	ZAR	3.322		0	0,00
	07.2024	UYU	10.632	\$	273		6	0,00
	07.2024	ZAR	28.843		1.604		27	0,02
	08.2024	COP	3.064.273		780		45	0,04
	08.2024	EGP	2.783		57		0	0,00
	08.2024	PEN	789		206		0	0,00
	08.2024	\$	355	BRL	1.941		0	(0,01)
	09.2024	BRL	4.110	\$	742		7	0,01
	09.2024	CLP	1.984.939		2.145		43	0,04
	09.2024	INR	121.680		1.455		0	0,00
	09.2024	MXN	2.139		113		0	0,00
	09.2024	PEN	6.522		1.752		50	0,04
	09.2024	\$	192	TWD	6.201		0	0,00
	09.2024	UYU	2.175	\$	55		1	0,00
	10.2024	\$	24	COP	104.688		1	0,00
	11.2024	EGP	2.893	\$	58		1	0,00
	12.2024	\$	66	EGP	3.197		0	0,00
	01.2025		24	COP	105.792		1	0,00
	02.2025	UGX	415.500	\$	100		0	(0,01)
	04.2025	\$	24	COP	107.640		1	0,00
	04.2025		97	TRY	4.451		5	0,01
	05.2025	EGP	2.469	\$	47		2	0,00
	06.2025		26.573		499		15	0,01
	10.2025	\$	12	COP	58.464		1	0,00
GLM	07.2024	BRL	9.356	\$	1.723		39	0,03
	07.2024	CLP	849.282		925		25	0,02
	07.2024	DOP	51.660		868		2	(0,01)
	07.2024	TRY	11.371		333		0	(0,01)
	07.2024	\$	127	BRL	672		0	(0,01)
	07.2024		189	CLP	176.488		0	0,00
	07.2024		319	EGP	15.264		0	0,00
	07.2024		221	SGD	297		0	0,00
	07.2024		54	UYU	2.143		0	0,00
	07.2024	UYU	2.143	\$	56		2	0,00
	07.2024	ZAR	35.095		1.918		0	(0,01)
	08.2024	DOP	26.037		436		0	0,00
	08.2024	TRY	676		20		0	0,00
	08.2024	\$	11.101	BRL	58.734		0	(0,50)
	08.2024		10	COP	43.220		0	0,00
	09.2024	DOP	29.031	\$	483		0	0,00
	09.2024	KZT	61.776		132		3	0,00
	09.2024	\$	150	TRY	5.316		1	0,00
	09.2024		95	UYU	3.760		0	0,00
	10.2024		680	BRL	3.732		0	(0,01)
	10.2024		99	TRY	3.822		7	0,01
	11.2024		8		316		1	0,00
	12.2024		160	EGP	8.120		0	(0,01)
	01.2025		273	TRY	11.397		12	0,01
	03.2025		2.240		107.264		287	0,25
	04.2025		51	COP	232.994		3	0,00
JPM	06.2025	EGP	8.552	\$	160		5	0,00
	07.2024	AUD	239		159		0	0,00
	07.2024	CZK	7.927		342		3	0,00
	07.2024	HUF	44.397		120		0	0,00
	07.2024	KES	9.787		75		0	0,00
	07.2024	PLN	1.927		477		0	0,00
	07.2024	SGD	476		353		2	0,00
	07.2024	\$	148	BRL	746		0	(0,01)
	07.2024		308	CHF	276		0	0,00
	07.2024		134	COP	561.294		1	0,00
	07.2024		146	EGP	7.000		0	(0,01)
	07.2024		4.989	IDR	80.906.453		0	(0,04)
	07.2024		182	NZD	296		0	0,00
	07.2024		22	PLN	86		0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$	SGD 516	695	\$ 0	\$ (4)	0,00
	07.2024		THB 33	1.225	0	0	0,00
	07.2024		TRY 112	3.787	1	0	0,00
	07.2024		UYU 50	1.965	0	(1)	0,00
	07.2024		ZAR 228	4.142	0	(1)	0,00
	07.2024	ZAR	66.477	\$ 3.611	0	(25)	(0,02)
	08.2024	CHF	275	308	0	0	0,00
	08.2024	€	60	PLN 277	4	0	0,00
	08.2024	NZD	282	\$ 172	0	0	0,00
	08.2024	PLN	276	€ 60	0	(4)	0,00
	08.2024	TRY	13.176	\$ 369	0	(10)	(0,01)
	08.2024	\$	22	COP 95.145	1	0	0,00
	08.2024		44	PKR 12.558	1	0	0,00
	08.2024		66	TRY 2.262	0	0	0,00
	09.2024	COP	3.727.417	\$ 902	14	(1)	0,01
	09.2024	€	14	PLN 66	1	0	0,00
	09.2024	INR	27.072	\$ 323	0	(1)	0,00
	09.2024	MXN	66.741	3.688	82	0	0,07
	09.2024	PLN	30	€ 7	0	0	0,00
	09.2024	\$	122	COP 496.530	0	(4)	0,00
	09.2024		51	EGP 2.522	0	0	0,00
	09.2024		401	TWD 12.895	0	(2)	0,00
	12.2024	EGP	2.310	\$ 38	0	(7)	(0,01)
	01.2025	\$	26	TRY 1.144	2	0	0,00
MBC	07.2024	€	605	\$ 658	10	10	0,01
	07.2024	HUF	57.959	156	0	(2)	0,00
	07.2024	¥	85.957	558	23	0	0,02
	07.2024	NOK	1.176	110	0	0	0,00
	07.2024	PLN	3.265	819	7	0	0,01
	07.2024	TRY	3.922	117	0	(1)	0,00
	07.2024	\$	151	AUD 227	1	0	0,00
	07.2024		534	CAD 730	0	0	0,00
	07.2024		432	CHF 382	0	(7)	(0,01)
	07.2024		1.425	CZK 32.854	0	(18)	(0,02)
	07.2024		3.593	€ 3.360	8	0	0,01
	07.2024		273	£ 215	0	(1)	0,00
	07.2024		388	HUF 139.117	0	(10)	(0,01)
	07.2024		998	¥ 156.500	0	(25)	(0,02)
	07.2024		158	UYU 6.138	0	(2)	0,00
	07.2024	UYU	12.657	\$ 321	2	2	0,00
	08.2024	CAD	550	402	0	0	0,00
	08.2024	EGP	5.572	115	1	0	0,00
	08.2024	€	3.360	3.598	0	(8)	(0,01)
	08.2024	£	105	133	0	0	0,00
	08.2024	\$	110	NOK 1.175	0	0	0,00
	09.2024	INR	36.762	\$ 439	0	(1)	0,00
	09.2024	\$	51	UYU 2.005	0	(1)	0,00
	09.2024	UYU	6.178	\$ 157	4	0	0,00
	02.2025	UGX	715.708	178	0	(8)	(0,01)
MYI	07.2024	BRL	725	133	3	0	0,00
	07.2024	INR	210.044	2.509	0	(10)	(0,01)
	07.2024	MYR	8.033	1.699	0	(5)	0,00
	07.2024	NOK	336	31	0	0	0,00
	07.2024	\$	314	BRL 1.643	0	(18)	(0,02)
	07.2024		722	£ 570	0	(2)	0,00
	07.2024		160	¥ 23.959	0	(11)	(0,01)
	07.2024		1.052	PLN 4.149	0	(20)	(0,02)
	07.2024		69	SEK 730	0	0	0,00
	07.2024		114	THB 4.180	0	0	0,00
	07.2024		783	ZAR 14.625	18	0	0,02
	07.2024	ZAR	14.588	\$ 801	2	2	0,00
	08.2024	SEK	729	69	0	0	0,00
	08.2024	\$	78	BRL 431	0	(1)	0,00
	08.2024		8	IDR 122.960	0	(1)	0,00
	08.2024		31	NOK 335	0	0	0,00
	08.2024		801	ZAR 14.623	0	(2)	0,00
	09.2024	INR	11.888	\$ 142	0	0	0,00
	09.2024	\$	160	TWD 5.130	0	(1)	0,00
	10.2024		247	¥ 37.807	0	(8)	(0,01)
RYL	07.2024		127	NZD 205	0	(2)	0,00
	10.2024	¥	37.835	\$ 247	7	7	0,01
SCX	07.2024	BRL	725	133	2	2	0,00
	07.2024	KRW	5.543	4	0	0	0,00
	07.2024	MXN	6	0	0	0	0,00
	07.2024	MYR	538	114	0	0	0,00
	07.2024	\$	44	KES 6.061	3	0	0,00
	07.2024		121	NOK 1.285	0	0	0,00
	07.2024		1.089	PEN 4.127	0	(12)	(0,01)
	07.2024		591	ZAR 10.883	5	5	0,00
	08.2024	PEN	1.473	\$ 385	0	0	0,00
	08.2024	UGX	126.232	32	0	(2)	0,00
	08.2024	\$	9	COP 38.952	0	0	0,00
	08.2024		10	EGP 581	2	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	09.2024	INR	172.290	\$ 2.059	\$ 0	\$ (3)	0,00	
	09.2024	KZT	13.720	29	1	0	0,00	
	09.2024	PEN	972	258	4	0	0,00	
	09.2024	PHP	72.076	1.229	0	(4)	0,00	
	09.2024	\$	244	EGP 12.003	0	(2)	0,00	
	09.2024		29	KZT 13.720	0	0	0,00	
	09.2024		1.463	MXN 27.521	24	0	0,02	
	09.2024		231	TWD 7.457	0	(1)	0,00	
	12.2024	EGP	4.343	\$ 67	0	(17)	(0,01)	
	12.2024	\$	151	EGP 7.556	0	(5)	0,00	
SSB	07.2024	IDR	2.215.758	\$ 136	1	0	0,00	
	09.2024	PEN	400	108	4	0	0,00	
	09.2024	\$	136	TWD 4.381	0	(1)	0,00	
UAG	07.2024	CHF	601	\$ 665	0	(4)	0,00	
	07.2024	CZK	15.099	656	9	0	0,01	
	08.2024	TRY	11.524	336	0	(3)	0,00	
					\$ 1.366	\$ (1.354)	\$ 12	0,01
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						\$ (172)	(0,15)	
<b>Summe Anlagen</b>						\$ 117.253	103,41	
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						\$ (3.866)	(3,41)	
<b>Nettovermögen</b>						\$ 113.387	100,00	

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Wertpapier per Emissionstermin.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 14.067 USD (31. Dezember 2023: 8.738 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.
- Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 364 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.545 USD (31. Dezember 2023: 1.388 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 111.914	\$ 641	\$ 112.555
Pensionsgeschäfte	0	5.444	0	5.444
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(5)	(741)	0	(746)
<b>Summen</b>	<b>\$ (5)</b>	<b>\$ 116.617</b>	<b>\$ 641</b>	<b>\$ 117.253</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 83.869	\$ 0	\$ 83.869
Pensionsgeschäfte	0	15.600	0	15.600
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	17	447	0	464
Einlagen bei Kreditinstituten	0	134	0	134
<b>Summen</b>	<b>\$ 17</b>	<b>\$ 100.050</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 100.067</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
MEI	5,850 %	04.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	PLN (7.772)	\$ (1.942)	(1,71)
	5,900	11.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(5.842)	(1.472)	(1,30)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (3.414)</b>	<b>(3,01)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 1	\$ 0	\$ 1	\$ (23)	\$ 0	\$ (23)
BPS	173	0	173	111	0	111
BRC	(129)	152	23	70	0	70
CBK	180	0	180	(110)	0	(110)
GLM	(276)	212	(64)	115	(70)	45
GST	(19)	0	(19)	(6)	0	(6)
JPM	(26)	0	(26)	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	(30)	0	(30)	19	0	19
MYC	(16)	0	(16)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(49)	0	(49)	192	0	192
RYL	5	0	5	62	0	62
SCX	8	0	8	(89)	0	(89)
SSB	4	0	4	(21)	0	(21)
UAG	2	0	2	(86)	0	(86)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	85,49	73,55
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	12,39	7,67
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,38	0,67
Pensionsgeschäfte	4,80	15,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,49)	0,21
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,15)	0,23
Einlagezertifikate	k. A.	0,13
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(3,01)	(0,70)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Brasilien	0,17	k. A.
Chile	3,91	4,25
Kolumbien	5,87	4,56
Tschechische Republik	7,58	6,48
Dominikanische Republik	3,22	3,34
Ecuador	0,19	0,12
Deutschland	0,21	0,24
Ungarn	4,01	2,35
Indien	0,53	k. A.
Indonesien	5,06	7,61
Irland	0,57	k. A.
Italien	0,18	k. A.
Elfenbeinküste	1,21	k. A.
Malaysia	6,09	5,92
Mexiko	9,24	8,02
Paraguay	0,19	k. A.
Peru	6,11	1,93
Philippinen	0,77	k. A.
Polen	5,85	7,10
Rumänien	5,37	3,63
Serbien	0,35	k. A.
Singapur	0,48	k. A.
Südafrika	10,92	11,42
Supranational	11,56	2,89
Thailand	2,59	7,98
Türkei	1,76	0,01
Uruguay	1,24	0,39
Usbekistan	0,29	k. A.

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kurzfristige Instrumente	3,74	3,65
Pensionsgeschäfte	4,80	15,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,49)	0,21
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,02	0,01
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,09)	(0,03)
Zinsswapoptionen	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,03	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,11)	k. A.
Cross-Currency Swaps	(0,01)	(0,02)
Zinsswaps	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,01	0,28
Einlagezertifikate	k. A.	0,13
Sonstige Aktiva und Passiva	(3,41)	2,29
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				11,950 % fällig am 12.11.2023 ^ \$ 2.600 \$ 94 0,00			
<b>ANGOLA</b>				<b>BRAZIL</b>				Lima Metro Line Finance Ltd.			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Brazil Government International Bond				4,350 % fällig am 05.04.2036 509 466 0,01			
Angola Government International Bond				4,750 % fällig am 14.01.2050 \$ 3.700 \$ 2.662 0,06				5,875 % fällig am 05.07.2034 1.828 1.801 0,05			
8,000 % fällig am 26.11.2029 \$ 4.700 \$ 4.237 0,10				6,125 % fällig am 22.01.2032 10.400 10.283 0,25				Poinsettia Finance Ltd.			
8,250 % fällig am 09.05.2028 10.100 9.514 0,23				6,125 % fällig am 15.03.2034 9.800 9.436 0,23				6,625 % fällig am 17.06.2031 10.742 9.260 0,23			
9,125 % fällig am 26.11.2049 3.000 2.468 0,06				7,125 % fällig am 13.05.2054 8.900 8.618 0,21				QNB Finance Ltd.			
9,375 % fällig am 08.05.2048 5.800 4.866 0,12				8,250 % fällig am 20.01.2034 1.300 1.486 0,04				4,875 % fällig am 30.01.2029 19.300 19.061 0,46			
9,500 % fällig am 12.11.2025 6.100 6.203 0,15								Red Dorsal Finance Ltd.			
Summe Angola 27.288 0,66				Summe Brasilien 106.991 2,59				5,875 % fällig am 12.10.2031 4.336 4.229 0,10			
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>KAMERUN</b>				<b>SUCI</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Second Investment Co.</b>			
Argentina Government International Bond				Republic of Cameroon Government International Bond				5,171 % fällig am 05.03.2031 9.600 9.502 0,23			
0,750 % fällig am 09.07.2030 23.662 13.322 0,32				5,950 % fällig am 07.07.2032 € 9.880 8.239 0,20				6,000 % fällig am 25.10.2028 15.500 15.929 0,39			
1,000 % fällig am 09.07.2029 15.537 8.950 0,22				9,500 % fällig am 19.11.2025 \$ 4.845 4.797 0,12				Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % Bargeld oder 6,000 % PIK)			
3,500 % fällig am 09.07.2041 56.655 22.322 0,54				Summe Kamerun 13.036 0,32				5,000 % fällig am 30.09.2026 (b) 526 62 0,00			
3,625 % fällig am 09.07.2035 52.367 22.092 0,53				<b>CAYMAN INSELN</b>				Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK)			
4,250 % fällig am 09.01.2038 (k) 43.156 19.895 0,48				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				5,250 % fällig am 30.09.2027 (b) 527 53 0,00			
Provincia de Buenos Aires				Betony CLO Ltd.				Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK)			
6,375 % fällig am 01.09.2037 4.909 2.037 0,05				6,671 % fällig am 30.04.2031 1.538 1.540 0,04				5,500 % fällig am 30.09.2027 (b) 1.055 99 0,00			
Provincia de Cordoba				CIFC Funding Ltd.				Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % bar oder 6,750 % PIK)			
6,875 % fällig am 10.12.2025 1.145 1.062 0,03				6,589 % fällig am 18.04.2031 803 804 0,02				5,750 % fällig am 30.09.2028 (b) 1.584 136 0,00			
Provincia de la Rioja				Dryden CLO Ltd.				Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK)			
8,500 % fällig am 24.02.2028 6.321 3.397 0,08				6,710 % fällig am 15.01.2031 303 303 0,01				6,000 % fällig am 30.09.2029 (b) 1.586 119 0,00			
Summe Argentinien 93.077 2,25				Golub Capital Partners CLO Ltd.				Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK)			
<b>ASERBAIDSCHAN</b>				6,606 % fällig am 20.04.2031 675 676 0,02				6,250 % fällig am 30.09.2030 (b) 746 53 0,00			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				KKR CLO Ltd.				Zhongsheng Group Holdings Ltd.			
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				6,590 % fällig am 15.04.2031 839 840 0,02				3,000 % fällig am 13.01.2026 3.900 3.718 0,09			
7,230 % fällig am 17.03.2026 12.500 12.422 0,30				6,719 % fällig am 16.10.2030 955 955 0,02				163.306 3,95			
Southern Gas Corridor CJSC				Northwoods Capital Ltd.				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
6,875 % fällig am 24.03.2026 25.900 26.074 0,63				7,201 % fällig am 15.06.2031 848 850 0,02				<b>KSA Sukuk Ltd.</b>			
Summe Aserbaidschan 38.496 0,93				Voya CLO Ltd.				5,250 % fällig am 04.06.2034 15.000 15.019 0,36			
<b>BAHRAIN</b>				6,538 % fällig am 19.04.2031 702 703 0,02				Summe Cayman Inseln 197.490 4,78			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Wind River CLO Ltd.				<b>CHILE</b>			
Bahrain Government International Bond				6,639 % fällig am 18.07.2031 631 632 0,01				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,250 % fällig am 25.01.2028 11.300 10.616 0,26								AES Andes S.A.			
5,625 % fällig am 30.09.2031 700 659 0,01				Summe Bahrain 11.275 0,27				8,150 % fällig am 10.06.2055 12.100 12.124 0,29			
Summe Bahrain 11.275 0,27				<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				Banco del Estado de Chile			
<b>BENIN</b>				Meituan				7,950 % fällig am 02.05.2029 (g)(i) 6.400 6.616 0,16			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,000 % fällig am 27.04.2027 (d) 12.400 11.805 0,29				Corp. Nacional del Cobre de Chile			
Benin Government International Bond				Sunac China Holdings Ltd.				3,625 % fällig am 01.08.2027 7.100 6.751 0,16			
4,875 % fällig am 19.01.2032 € 2.567 2.312 0,05				1,000 % fällig am 30.09.2032 885 57 0,00				4,500 % fällig am 01.08.2047 3.200 2.554 0,06			
7,960 % fällig am 13.02.2038 \$ 3.000 2.795 0,07								4,875 % fällig am 04.11.2044 (k) 5.600 4.738 0,12			
Summe Benin 5.107 0,12				Summe Chile 11.862 0,29				5,125 % fällig am 02.02.2033 2.800 2.673 0,07			
<b>BERMUDA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,950 % fällig am 08.01.2034 600 601 0,01			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.				5,950 % fällig am 08.01.2034 (k) 3.800 3.809 0,09			
Torrey Pines Re Ltd.				0,000 % fällig am 05.06.2034 (d) 17.432 13.074 0,32				6,150 % fällig am 24.10.2036 1.000 1.018 0,03			
11,355 % fällig am 07.06.2032 300 301 0,01				Country Garden Holdings Co. Ltd.				6,300 % fällig am 08.09.2053 6.900 6.858 0,17			
12,605 % fällig am 07.06.2032 250 251 0,00				2,700 % fällig am 12.07.2026 ^ 500 43 0,00				6,440 % fällig am 26.01.2036 11.400 11.800 0,29			
14,355 % fällig am 05.06.2031 250 252 0,01				3,125 % fällig am 22.10.2025 ^ 400 35 0,00				Embotelladora Andina S.A.			
Summe Bermuda 804 0,02				5,400 % fällig am 27.05.2025 ^ 1.300 114 0,00				3,950 % fällig am 21.01.2050 3.900 2.866 0,07			
<b>BRASILIEN</b>				6,150 % fällig am 17.09.2025 ^ 900 79 0,00				Empresa de los Ferrocarriles del Estado			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				FWD Group Holdings Ltd.				3,068 % fällig am 18.08.2050 1.500 911 0,02			
Banco BTG Pactual S.A.				7,635 % fällig am 02.07.2031 (a) 10.700 10.882 0,26				3,830 % fällig am 14.09.2061 7.000 4.644 0,11			
6,250 % fällig am 08.04.2029 3.900 3.922 0,10				Gaci First Investment Co.				Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.			
Banco do Brasil S.A.				4,875 % fällig am 14.02.2035 1.300 1.230 0,03				3,650 % fällig am 07.05.2030 1.600 1.466 0,04			
3,250 % fällig am 30.09.2026 2.700 2.561 0,06				5,000 % fällig am 13.10.2027 (k) 22.200 22.064 0,54				Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A.			
8,500 % fällig am 29.07.2026 MXN 294.000 15.230 0,37				5,000 % fällig am 29.01.2029 400 395 0,01				4,875 % fällig am 30.10.2024 5.000 4.979 0,12			
Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais				5,125 % fällig am 14.02.2053 15.600 13.517 0,33				Empresa Nacional del Petroleo			
5,333 % fällig am 15.02.2028 \$ 20.076 19.777 0,48				5,375 % fällig am 29.01.2054 21.900 19.461 0,47				3,450 % fällig am 16.09.2031 8.700 7.451 0,18			
CSN Inova Ventures				ICD Funding Ltd.				4,500 % fällig am 14.09.2047 3.000 2.248 0,05			
6,750 % fällig am 28.01.2028 15.800 15.031 0,36				3,223 % fällig am 28.04.2026 8.230 7.883 0,19				5,250 % fällig am 06.11.2029 7.800 7.641 0,19			
Vale Overseas Ltd.				Interoceánica Finance Ltd.				6,150 % fällig am 10.05.2033 6.300 6.322 0,15			
6,400 % fällig am 28.06.2054 6.300 6.235 0,15				0,000 % fällig am 30.11.2025 (d) 311 294 0,01				Enel Americas S.A.			
Vale S.A.				0,000 % fällig am 30.11.2025 (d) 1.470 1.390 0,03				4,000 % fällig am 25.10.2026 2.000 1.922 0,05			
0,000 % (g) BRL 188.860 11.750 0,28				0,000 % fällig am 15.05.2030 (d) 316 259 0,01				Engie Energia Chile S.A.			
				7,860 % fällig am 15.05.2030 3.149 3.216 0,08				6,375 % fällig am 17.04.2034 3.000 3.041 0,07			
				Kaisa Group Holdings Ltd.				GNL Quintero S.A.			
				8,500 % fällig am 30.06.2022 ^ 600 22 0,00				4,634 % fällig am 31.07.2029 6.019 5.880 0,14			
				9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ 4.100 149 0,00				Summe Chile 108.913 2,64			
				9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ 3.200 108 0,00				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				11,250 % fällig am 09.04.2022 ^ 1.100 40 0,00				Chile Government International Bond			
				11,500 % fällig am 30.01.2023 ^ 200 7 0,00				3,100 % fällig am 07.05.2041 3.000 2.202 0,05			
				11,700 % fällig am 11.11.2025 ^ 3.300 116 0,00							



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Export-Import Bank of India				Windmill Re DAC				7,375 % fällig am 10.10.2047	\$ 700	\$ 597	0,01
3,375 % fällig am 05.08.2026	\$ 600	\$ 577	0,01	0,000 % fällig am 05.07.2028	€ 250	\$ 268	0,01	Summe Jordanien			13,628
Summe Indien		10,312	0,25			27,975	0,68	<b>KASACHSTAN</b>			
<b>INDONESIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ISLE OF MAN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT				AngloGold Ashanti Holdings PLC				KazMunayGas National Co. JSC			
5,280 % fällig am 05.04.2029	5.400	5.361	0,13	3,750 % fällig am 01.10.2030	3.600	3.145	0,08	3,500 % fällig am 14.04.2033	1.800	1.477	0,03
Indonesia Asahan Aluminium PT				6,500 % fällig am 15.04.2040	200	200	0,00	4,750 % fällig am 19.04.2027	16.600	16.072	0,39
5,450 % fällig am 15.05.2030	8.000	7.861	0,19	Summe Isle of Man		3.345	0,08	5,750 % fällig am 19.04.2047	15.790	13.781	0,33
5,800 % fällig am 15.05.2050	3.000	2.761	0,07	<b>ISRAEL</b>				6,375 % fällig am 24.10.2048	4.300	4.055	0,10
LLPL Capital Pte. Ltd.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				QazaqGaz NC JSC			
6,875 % fällig am 04.02.2039	1.703	1.717	0,04	Bank Hapoalim B.M.				4,375 % fällig am 26.09.2027	2.500	2.349	0,06
Pelabuhan Indonesia Persero PT				3,255 % fällig am 21.01.2032 (i)	9.900	8.909	0,21	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.			
5,375 % fällig am 05.05.2045	3.693	3.556	0,09	ICL Group Ltd.				3,250 % fällig am 15.08.2030	5.400	4.465	0,11
Pertamina Persero PT				6,375 % fällig am 31.05.2038	4.900	4.487	0,11	Summe Kasachstan			42,199
1,400 % fällig am 09.02.2026	600	561	0,01	Israel Electric Corp. Ltd.				<b>KENIA</b>			
4,175 % fällig am 21.01.2050	5.000	3.870	0,09	4,250 % fällig am 14.08.2028	5.000	4.613	0,11	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
5,625 % fällig am 20.05.2043	1.800	1.738	0,04	Leviathan Bond Ltd.				Republic of Kenya Government International Bond			
6,000 % fällig am 03.05.2042	16.000	16.087	0,39	6,125 % fällig am 30.06.2025	2.100	2.039	0,05	7,000 % fällig am 22.05.2027	7.800	7.438	0,18
6,450 % fällig am 30.05.2044	12.400	13.075	0,32	6,500 % fällig am 30.06.2027	6.000	5.633	0,14	7,250 % fällig am 28.02.2028	3.800	3.460	0,08
6,500 % fällig am 07.11.2048	9.500	10.144	0,25	Summe Israel		66,949	1,62	8,000 % fällig am 22.05.2032	2.600	2.265	0,06
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara						92,630	2,24	9,750 % fällig am 16.02.2031	3.300	3.170	0,08
4,000 % fällig am 30.06.2050	16.800	12.110	0,29	<b>ITALIEN</b>				Summe Kenia			16,333
4,125 % fällig am 15.05.2027	5.600	5.401	0,13	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>LETTLAND</b>			
4,375 % fällig am 05.02.2050	2.900	2.231	0,05	Israel Government International Bond				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
5,250 % fällig am 24.10.2042	2.300	2.080	0,05	5,000 % fällig am 30.10.2026 (k)	€ 39.500	42.996	1,04	Latvia Government International Bond			
5,250 % fällig am 15.05.2047	8.400	7.426	0,18	5,500 % fällig am 12.03.2034	\$ 16.700	15.932	0,39	5,125 % fällig am 30.07.2034	10.400	10.257	0,25
6,150 % fällig am 21.05.2048	2.700	2.667	0,06	5,750 % fällig am 12.03.2054	8.900	8.021	0,19	<b>LIBANON</b>			
6,250 % fällig am 25.01.2049	7.800	7.777	0,19			66,949	1,62	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Indonesien		106,423	2,57			92,630	2,24	Lebanon Government International Bond			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>ITALIEN</b>				<b>AKTIEN</b>			
Indonesia Government International Bond				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>LUXEMBURG</b>			
4,750 % fällig am 18.07.2047 (k)	1.000	920	0,02	Israel Government International Bond				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
5,350 % fällig am 11.02.2049	200	198	0,01	5,000 % fällig am 30.10.2026 (k)	€ 39.500	42.996	1,04	DrillCo Holding Lux S.A. (c)(j)	364.034	8.510	0,21
5,650 % fällig am 11.01.2053	800	813	0,02	5,500 % fällig am 12.03.2034	\$ 16.700	15.932	0,39	Foresea Holding S.A. 'A' (c)	143.033	3.343	0,08
6,625 % fällig am 17.02.2037	5.900	6.594	0,16	5,750 % fällig am 12.03.2054	8.900	8.021	0,19	Summe Stammaktien			11,853
6,750 % fällig am 15.01.2044	7.000	8.031	0,19			66,949	1,62	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,750 % fällig am 17.01.2038	1.000	1.231	0,03			92,630	2,24	Chile Electricity Lux MPC SARL			
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				<b>ELFENBEINKÜSTE</b>				6,010 % fällig am 20.01.2033	\$ 8.800	8.919	0,21
3,800 % fällig am 23.06.2050	7.000	5.340	0,13	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				Constellation Oil Services Holding S.A.			
Summe Indonesien		129,550	3,13	Elfenbeinküste				13,500 % fällig am 30.06.2025	1.295	1.313	0,03
<b>INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				6,852 % fällig am 07.03.2025	€ 22.400	23.947	0,58	Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)			
Project Mercury				8,908 % fällig am 19.03.2027	2.580	2.732	0,06	3,000 % fällig am 31.12.2026 (b)	3.822	3.144	0,08
0,400 % - 8,088 % fällig am 11.08.2030	€ 10.700	11.738	0,28			26,679	0,64	FORESEA Holding S.A.			
Republik Senegal				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				7,500 % fällig am 15.06.2030	6.316	5.889	0,14
9,489 % fällig am 22.12.2028	9.400	10.021	0,24	Ivory Coast Government International Bond				Greensaf Pipelines Bidco SARL			
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic				4,875 % fällig am 30.01.2032	12.919	11.628	0,28	6,129 % fällig am 23.02.2038	4.700	4.782	0,11
8,229 % fällig am 26.11.2024	\$ 250	249	0,01	5,250 % fällig am 22.03.2030	2.394	2.341	0,06	6,510 % fällig am 23.02.2042	4.600	4.789	0,12
Summe International		22,008	0,53	5,875 % fällig am 17.10.2031	3.070	2.974	0,07	Guara Norte SARL			
<b>IRAK</b>				6,625 % fällig am 22.03.2048	1.300	1.087	0,03	5,198 % fällig am 15.06.2034	12.919	11.916	0,29
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				6,875 % fällig am 17.10.2040	4.200	3.774	0,09	Petrorio Luxembourg Trading SARL			
Iraq Government International Bond				7,625 % fällig am 30.01.2033	\$ 10.050	9.779	0,24	6,125 % fällig am 09.06.2026	7.100	6.941	0,17
5,800 % fällig am 15.01.2028	3.000	2.811	0,07	8,250 % fällig am 30.01.2037	4.400	4.271	0,10	Raizen Fuels Finance S.A.			
<b>IRLAND</b>				Summe Elfenbeinküste		62,533	1,51	6,450 % fällig am 05.03.2034	7.700	7.826	0,19
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>JAMAICA</b>				6,950 % fällig am 05.03.2054	2.900	2.952	0,07
Avoca Static CLO DAC				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Unigel Luxembourg S.A.			
5,506 % fällig am 15.10.2030	€ 1.638	1.760	0,04	TransJamaican Highway Ltd.				8,750 % fällig am 01.10.2026 ^	3.900	1.107	0,03
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,750 % fällig am 10.10.2036	3.327	2.937	0,07	Summe Luxemburg			59,578
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				<b>JORDANIEN</b>				<b>MAZEDONIEN</b>			
5,950 % fällig am 15.04.2030 ^ (i)	\$ 6.600	396	0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Iridium Capital PLC				Jordan Government International Bond				North Macedonia Government International Bond			
9,250 % fällig am 18.06.2029	€ 20.500	22.163	0,54	4,950 % fällig am 07.07.2025	2.200	2.145	0,05	6,960 % fällig am 13.03.2027	€ 7.700	8.567	0,21
Saderea DAC				5,750 % fällig am 31.01.2027	2.400	2.287	0,06				
12,500 % fällig am 30.11.2026 ^	\$ 10.373	5.148	0,12	5,850 % fällig am 07.07.2030	2.800	2.514	0,06				
				6,125 % fällig am 29.01.2026	6.250	6.085	0,15				



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
6,900 % fällig am 12.08.2037	PEN 12.300	\$ 3.086	0,07	<b>SAUDI-ARABIEN</b>				5,375 % fällig am 24.07.2044	\$ 400	\$ 302	0,01
6,950 % fällig am 12.08.2031	6.800	1.824	0,04	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,750 % fällig am 30.09.2049	4.400	3.330	0,08
7,300 % fällig am 12.08.2033	3.300	885	0,02	Saudi Arabian Oil Co.				7,300 % fällig am 20.04.2052	5.300	4.801	0,11
8,750 % fällig am 21.11.2033	\$ 185	226	0,01	3,500 % fällig am 16.04.2029	\$ 3.000	\$ 2.790	0,06	10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 921.000	52.351	1,27
		<u>38.036</u>	<u>0,92</u>	3,500 % fällig am 24.11.2070	13.900	9.022	0,22			<u>77.441</u>	<u>1,87</u>
Summe Peru		<u>70.889</u>	<u>1,71</u>	3,500 % fällig am 24.11.2070 (k)	31.100	20.187	0,49	Summe Südafrika		<u>145.103</u>	<u>3,51</u>
						<u>31.999</u>	<u>0,77</u>				
<b>PHILIPPINEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>SÜDKOREA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Saudi Arabia Government International Bond				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Philippines Government International Bond				2,250 % fällig am 02.02.2033	1.700	1.359	0,03	Kodit Global Co. Ltd.			
2,650 % fällig am 10.12.2045	7.400	4.862	0,12	3,250 % fällig am 22.10.2030	6.000	5.398	0,13	4,954 % fällig am 25.05.2026	\$ 1.700	1.687	0,04
2,950 % fällig am 05.05.2045	1.600	1.110	0,03	3,450 % fällig am 02.02.2061	9.900	6.501	0,16	Mirae Asset Securities Co. Ltd.			
3,700 % fällig am 01.03.2041	650	531	0,01	3,750 % fällig am 21.01.2055	8.600	6.089	0,15	5,875 % fällig am 26.01.2027	2.100	2.100	0,05
5,000 % fällig am 17.07.2033	6.800	6.718	0,16	4,500 % fällig am 26.10.2046 (k)	22.500	19.095	0,46	6,000 % fällig am 26.01.2029	800	809	0,02
6,375 % fällig am 23.10.2034	847	928	0,02	4,625 % fällig am 04.10.2047	300	256	0,01	SK Hynix, Inc.			
9,500 % fällig am 02.02.2030	4.179	5.040	0,12	5,000 % fällig am 16.01.2034	20.800	20.447	0,49	6,500 % fällig am 17.01.2033	12.600	13.287	0,32
Total Philippinen		<u>19.189</u>	<u>0,46</u>			<u>59.145</u>	<u>1,43</u>			<u>17.883</u>	<u>0,43</u>
				Summe Saudi-Arabien		<u>91.144</u>	<u>2,20</u>	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>POLEN</b>				<b>SENEGAL</b>				Korea Electric Power Corp.			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				5,375 % fällig am 31.07.2026	10.000	10.032	0,24
Republic of Poland Government International Bond				Senegal Government International Bond				Korea National Oil Corp.			
3,625 % fällig am 11.01.2034 (k)	€ 2.800	2.974	0,07	4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 8.400	8.326	0,20	4,875 % fällig am 03.04.2028	15.800	15.706	0,38
4,125 % fällig am 11.01.2044 (k)	5.750	6.124	0,15	5,375 % fällig am 08.06.2037	25.500	19.956	0,48	4,875 % fällig am 03.04.2029	9.500	9.400	0,23
4,875 % fällig am 04.10.2033	\$ 4.900	4.787	0,12	7,750 % fällig am 10.06.2031	\$ 10.600	10.100	0,25			<u>35.138</u>	<u>0,85</u>
5,500 % fällig am 04.04.2053 (k)	9.500	9.335	0,22					Summe Südkorea		<u>53.021</u>	<u>1,28</u>
5,500 % fällig am 18.03.2054	7.750	7.532	0,18	Summe Senegal		<u>38.382</u>	<u>0,93</u>	<b>SPANIEN</b>			
Summe Polen		<u>30.752</u>	<u>0,74</u>	<b>SERBIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Banco Santander S.A.			
<b>KATAR</b>				Serbia Government International Bond				5,147 % fällig am 18.08.2025	13.600	13.498	0,33
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1,500 % fällig am 26.06.2029	€ 6.000	5.472	0,13	<b>SRI LANKA</b>			
QatarEnergy				6,000 % fällig am 12.06.2034 (k)	\$ 1.300	1.281	0,03	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
2,250 % fällig am 12.07.2031	9.000	7.528	0,18	6,000 % fällig am 12.06.2034	6.200	6.111	0,15	Sri Lanka Government International Bond			
3,125 % fällig am 12.07.2041	27.350	20.413	0,49	6,250 % fällig am 26.05.2028	9.600	9.726	0,24	5,750 % fällig am 18.04.2023 ^	4.990	2.869	0,07
3,300 % fällig am 12.07.2051	1.200	842	0,02	6,500 % fällig am 26.09.2033	450	457	0,01	5,875 % fällig am 25.07.2022 ^	2.050	1.170	0,03
3,300 % fällig am 12.07.2051 (k)	38.000	26.661	0,65	6,500 % fällig am 26.09.2033 (k)	24.000	24.376	0,59	6,125 % fällig am 03.06.2025 ^	5.100	3.025	0,07
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.				Summe Serbien		<u>47.423</u>	<u>1,15</u>	6,200 % fällig am 11.05.2027 ^	8.700	5.128	0,12
5,838 % fällig am 30.09.2027	934	943	0,02	<b>SINGAPUR</b>				6,350 % fällig am 28.06.2024 ^	1.420	819	0,02
6,332 % fällig am 30.09.2027	223	226	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,825 % fällig am 18.07.2026 ^	2.500	1.485	0,03
		<u>56.613</u>	<u>1,37</u>	Cathaylife Singapore Pte Ltd.				6,850 % fällig am 14.03.2024 ^	4.000	2.327	0,06
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				5,950 % fällig am 05.07.2034 (a)	9.500	9.532	0,23	6,850 % fällig am 03.11.2025 ^	7.400	4.386	0,11
Qatar Government International Bond				Flex Ltd.				7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	20.500	11.906	0,29
4,000 % fällig am 14.03.2029	8.800	8.532	0,21	4,875 % fällig am 15.06.2029	1.300	1.260	0,03	7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	5.500	3.275	0,08
4,400 % fällig am 16.04.2050	7.100	6.222	0,15	Singapore Airlines Ltd.				Summe Sri Lanka		<u>36.390</u>	<u>0,88</u>
4,625 % fällig am 02.06.2046	300	275	0,01	3,375 % fällig am 19.01.2029	7.800	7.250	0,17	<b>SUPRANATIONAL</b>			
4,817 % fällig am 14.03.2049	1.800	1.686	0,04	Yinson Production Financial Services Pte Ltd.				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
5,103 % fällig am 23.04.2048	11.680	11.389	0,27	9,625 % fällig am 03.05.2029	4.000	3.990	0,10	Ghana Government International Bond			
		<u>28.104</u>	<u>0,68</u>	Summe Singapur		<u>22.032</u>	<u>0,53</u>	10,750 % fällig am 14.10.2030	1.050	713	0,02
Summe Katar		<u>84.717</u>	<u>2,05</u>	<b>SLOWENIEN</b>				<b>TANSANIA</b>			
<b>RUMÄNIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KREDITBEITRÄGEN UND -ABTRETUNG</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Slovenia Government International Bond				The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania			
Romania Government International Bond				5,000 % fällig am 19.09.2033	12.500	12.422	0,30	TBD % fällig am 20.06.2030	8.000	7.942	0,19
2,000 % fällig am 08.12.2026 (k)	€ 5.600	5.749	0,14	<b>SÜDAFRIKA</b>				9,225 % fällig am 26.04.2028	€ 8.945	9.516	0,23
2,125 % fällig am 07.03.2028 (k)	3.600	3.565	0,09	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Tansania		<u>17.458</u>	<u>0,42</u>
2,625 % fällig am 02.12.2040 (k)	7.400	5.170	0,12	Entwicklungsbank für das südliche Afrika				<b>THAILAND</b>			
2,875 % fällig am 13.04.2042 (k)	3.400	2.372	0,06	8,600 % fällig am 21.10.2024 (j)	ZAR 467.300	25.435	0,62	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
5,000 % fällig am 27.09.2026 (k)	13.300	14.573	0,35	Eskom Holdings SOC Ltd.				Bangkok Bank PCL			
5,250 % fällig am 30.05.2032	10.100	10.545	0,25	4,314 % fällig am 23.07.2027	\$ 13.650	12.677	0,31	3,733 % fällig am 25.09.2034 (i)	\$ 800	710	0,02
5,625 % fällig am 30.05.2037	10.200	10.554	0,26	6,350 % fällig am 10.08.2028	14.400	13.984	0,34	PTTEP Treasury Center Co. Ltd.			
6,125 % fällig am 22.01.2044 (k)	\$ 4.050	3.856	0,09	7,125 % fällig am 11.02.2025	4.588	4.574	0,11	2,587 % fällig am 10.06.2027	1.300	1.205	0,03
6,375 % fällig am 18.09.2033 (k)	€ 11.400	12.720	0,31	8,450 % fällig am 10.08.2028	200	201	0,00	3,903 % fällig am 06.12.2059	550	420	0,01
6,375 % fällig am 30.01.2034	\$ 9.100	9.207	0,22	Sasol Financing USA LLC				Summe Thailand		<u>2.335</u>	<u>0,06</u>
7,625 % fällig am 17.01.2053 (k)	8.800	9.525	0,23	8,750 % fällig am 03.05.2029	10.600	10.791	0,26	<b>TRINIDAD UND TOBAGO</b>			
Summe Rumänien		<u>87.836</u>	<u>2,12</u>			<u>67.662</u>	<u>1,64</u>	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>RUSSLAND</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				National Gas Co. of Trinidad & Tobago Ltd.			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				South Africa Government International Bond				6,050 % fällig am 15.01.2036	3.970	3.659	0,09
Russia Government International Bond				4,300 % fällig am 12.10.2028	800	735	0,02				
7,500 % fällig am 31.03.2030	174	125	0,00	4,850 % fällig am 30.09.2029	9.500	8.712	0,21				
				5,000 % fällig am 12.10.2046	10.200	7.210	0,17				



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>NON-AGENCY-MBS</b>								<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH) UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. 4,407 % fällig am 15.11.2061	\$ 3.700	\$ 3.563	0,09	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2054	\$ 13.050	\$ 11.948	0,29	CLP Power Hong Kong Financing Ltd. 2,125 % fällig am 30.06.2030	\$ 5.300	\$ 4.518	0,11
Banc of America Mortgage Trust 4,875 % fällig am 25.02.2036	4	3	0,00	5,000 % fällig am 01.08.2054	16.600	16.042	0,39				
BCAP LLC Trust 4,325 % fällig am 26.05.2037	3.218	2.748	0,07	5,500 % fällig am 01.08.2054	16.100	15.878	0,38				
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 4,406 % fällig am 25.05.2047	79	69	0,00			56.284	1,36	<b>SAMBIA STAATSEMISSIONEN</b>			
5,075 % fällig am 25.01.2035	4	3	0,00	<b>US-SCHATZobligationen</b>				Zambia Government International Bond			
Bear Stearns ALT-A Trust 5,310 % fällig am 25.05.2035	52	48	0,00	U.S. Treasury Bonds 1,750 % fällig am 15.08.2041	12.300	8.131	0,20	0,500 % fällig am 31.12.2053	268	131	0,00
Benchmark Mortgage Trust 3,666 % fällig am 15.01.2051	1.700	1.595	0,04	2,375 % fällig am 15.02.2042	25.000	18.207	0,44	5,750 % fällig am 30.06.2033	323	284	0,01
4,261 % fällig am 10.10.2051	4.800	4.537	0,11	3,250 % fällig am 15.05.2042	113.500	94.416	2,28	Summe Sambia		415	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 4,660 % fällig am 25.09.2037	159	141	0,00	3,375 % fällig am 15.08.2042	14.700	12.420	0,30	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE KURZFRISTIGE SCHULDITEL</b>			
CitiMortgage Alternative Loan Trust 6,000 % fällig am 25.10.2036	943	700	0,02	U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2029	7.900	7.216	0,18	Gateway Re Ltd. 5,355 % fällig am 23.12.2028	3.000	2.805	0,07
Countrywide Alternative Loan Trust 5,810 % fällig am 25.05.2036	988	394	0,01	2,625 % fällig am 31.07.2029	30.000	27.648	0,67	<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>			
6,093 % fällig am 20.12.2035	544	486	0,01	3,125 % fällig am 31.08.2029	51.800	48.861	1,18	25,598 % fällig am 27.08.2024 (d)(e)	EGP 501.750	10.052	0,25
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,959 % fällig am 20.05.2036	76	70	0,00	3,500 % fällig am 15.02.2033	200	187	0,00	25,600 % fällig am 20.08.2024 (d)(e)	270.300	5.440	0,13
4,530 % fällig am 25.11.2037	398	360	0,01	4,000 % fällig am 28.02.2030	33.100	32.508	0,79	25,700 % fällig am 10.12.2024 (d)(e)	250.075	4.668	0,11
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 5,864 % fällig am 25.11.2034	157	141	0,00	4,625 % fällig am 30.04.2029	450	455	0,01	25,751 % fällig am 24.09.2024 (d)(e)	352.100	6.917	0,17
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust 6,120 % fällig am 25.08.2037	651	511	0,01	<b>OPTIONSSCHEINE</b>				25,851 % fällig am 26.11.2024 (d)(e)	398.300	7.506	0,18
GSMPs Mortgage Loan Trust 5,810 % fällig am 25.01.2036	130	104	0,00	Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071 (j)	5	0	0,00	25,899 % fällig am 10.09.2024 (d)(e)	288.200	5.715	0,14
GSR Mortgage Loan Trust 4,619 % fällig am 25.01.2036	20	18	0,00	Summe USA		424.883	10,28	25,943 % fällig am 27.08.2024 (d)(e)	109.100	2.186	0,05
HarborView Mortgage Loan Trust 7,153 % fällig am 19.10.2035	95	47	0,00	<b>AKTIEN</b>						42.484	1,03
HomeBanc Mortgage Trust 5,980 % fällig am 25.01.2036	168	157	0,00	<b>USBKISTAN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
Impac CMB Trust 6,100 % fällig am 25.03.2035	66	61	0,00	National Bank of Uzbekistan 4,850 % fällig am 21.10.2025	\$ 7.048	6.799	0,16	5,360 % fällig am 05.09.2024 (d)(e)(l)	\$ 18.900	18.720	0,45
IndyMac Mortgage Loan Trust 3,414 % fällig am 25.11.2037	194	156	0,00	8,500 % fällig am 05.07.2029 (a)	11.700	11.571	0,28	5,363 % fällig am 05.09.2024 (d)(e)(l)	1.000	990	0,02
5,820 % fällig am 25.02.2037	300	266	0,01	19,875 % fällig am 05.07.2027 (a)	UZS 67.050.000	5.339	0,13	Summe kurzfristige Instrumente		64.999	1,57
5,820 % fällig am 25.02.2037	943	930	0,02	Republic of Uzbekistan International Bond 5,375 % fällig am 29.05.2027	€ 10.700	11.450	0,28	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 4.416.127	106,82	
6,100 % fällig am 25.07.2045	309	239	0,01	Uzbekistan Government International Bond 3,700 % fällig am 25.11.2030	\$ 200	165	0,00	<b>AKTIEN</b>			
JPMorgan Resecuritization Trust 2,500 % fällig am 25.03.2056	154	148	0,00	3,900 % fällig am 19.10.2031	9.400	7.655	0,19	<b>INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Lehman XS Trust 5,840 % fällig am 25.09.2046	1.764	1.485	0,04	Uzbekneftegaz JSC 4,750 % fällig am 16.11.2028	6.100	5.146	0,12	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (h)	2.357.350	27.439	0,66
Residential Accredit Loans, Inc. Trust 6,000 % fällig am 25.08.2036	311	249	0,01	Summe Uzbekistan		48.125	1,16	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	5.208.864	51.909	1,26
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 4,984 % fällig am 25.09.2037	21	18	0,00	<b>VENEZUELA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)	384.360	5.294	0,13
Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,760 % fällig am 25.02.2037	661	597	0,02	Petroleos de Venezuela S.A. 5,375 % fällig am 12.04.2027	73.690	8.991	0,22	Summe Investmentfonds	\$ 84.642	2,05	
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 4,477 % fällig am 25.10.2037	434	368	0,01	5,500 % fällig am 12.04.2037	19.365	2.343	0,06	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
TBW Mortgage-Backed Trust 6,540 % fällig am 25.01.2037	1.245	279	0,01	6,000 % fällig am 16.05.2024	3.500	437	0,01	Venezuela Government International Bond 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	19.650	2.942	0,07
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,335 % fällig am 25.02.2037	144	123	0,00	8,500 % fällig am 27.10.2020	4.450	3.452	0,08	7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	20.130	3.065	0,07
4,580 % fällig am 25.03.2036	830	748	0,02	<b>VIETNAM STAATSEMISSIONEN</b>				8,250 % fällig am 13.10.2024 ^	12.483	2.028	0,05
5,830 % fällig am 25.05.2034	125	112	0,00	Vietnam Government International Bond 4,800 % fällig am 19.11.2024	500	497	0,01	9,000 % fällig am 07.05.2023 ^	9.878	1.654	0,04
6,223 % fällig am 25.01.2046	81	68	0,00			15.223	0,37	9,250 % fällig am 15.09.2027 ^	13.410	2.548	0,06
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 6,478 % fällig am 25.10.2036	293	270	0,01			14.285	0,34	9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	11.868	2.048	0,05
		21.812	0,53			29.508	0,71				
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>											
Fannie Mae 6,323 % fällig am 01.03.2036	13	13	0,00								
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.02.2038	1	1	0,00								

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2024	460	\$ 569	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	449	(788)	(0,02)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	246	92	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	252	128	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	2.358	547	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	4.361	3.701	0,09
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	116	(40)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	165	(101)	0,00
				\$ 4.108	0,10
				\$ 4.108	0,10

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000 %	21.09.2024	\$ 90.600	\$ 377	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	11.100	(1.002)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	21.06.2027	13.700	(2.005)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	400	(50)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.12.2031	5.700	(1.012)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,250	21.12.2046	1.200	607	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,500	15.06.2046	600	313	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	192.900	2.171	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	12.640	102	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	17.380	(122)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2054	36.400	783	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	3.300	(98)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	3.700	(107)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	2.100	26	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	39.800	401	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	95.000	(381)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	29.100	626	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	14.800	(352)	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2036	3.300	72	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2039	7.800	177	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2039	3.600	(112)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	2.300	14	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	1.900	25	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	2.300	34	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	300	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	4.500	41	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,155	02.10.2033	6.200	56	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,165	27.09.2033	7.200	71	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	8.900	92	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	5.300	57	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	4.000	59	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	2.200	35	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2034	58.400	1.257	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	2.400	43	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	400	12	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	3.800	132	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	9,842	04.01.2027	BRL 454.300	(3.133)	(0,08)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	11,550	04.01.2027	21.000	(20)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	11,570	04.01.2027	270.400	(242)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,850	02.01.2025	87.000	(80)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,240	02.01.2025	210.200	(185)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,055	04.01.2027	102.700	(473)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,216	02.01.2025	36.500	(131)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,241	02.01.2025	38.600	(142)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,427	02.01.2025	86.600	(369)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,428	02.01.2025	124.500	534	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	30.11.2024	ZAR 560.000	355	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,855	18.12.2033	CLP 10.615.700	(417)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,511	13.11.2033	11.556.400	(144)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	3,534	21.03.2029	CZK 1.145.200	(21)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR	3,675	08.01.2029	857.000	786	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR	3,765	09.01.2029	966.700	714	0,02
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR	3,769	09.01.2029	454.100	(126)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	3,960	15.04.2029	550.300	10	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,175 %	07.11.2028	CZK	1.701.000	\$ 2.483	0,06
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028		186.600	42	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	20.03.2044	€	2.500	78	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054		11.300	577	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029		3.600	(66)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034		54.100	(1.348)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033		5.100	314	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028		1.800	70	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028		8.200	350	0,01
						<b>\$ 1.757</b>	<b>0,04</b>
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						<b>\$ 1.757</b>	<b>0,04</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Chile Government International Bond	(1,000) %	20.12.2028	\$ 3.800	\$ (78)	\$ 1	\$ (77)	0,00
	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	2.300	76	(98)	(22)	0,00
BPS	Saudi Arabia Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	18.900	(286)	(93)	(379)	(0,01)
	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	2.590	(52)	0	(52)	0,00
	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	1.100	36	(47)	(11)	0,00
BRC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	27.200	(794)	13	(781)	(0,02)
	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	2.400	64	(87)	(23)	0,00
GST	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	7.800	(228)	4	(224)	(0,01)
	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	190	(4)	0	(4)	0,00
HUS	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	2.000	15	(6)	9	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	5.900	(172)	3	(169)	(0,01)
JPM	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	3.600	(12)	(3)	(15)	0,00
	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	4.500	(91)	0	(91)	0,00
MYC	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.500	(2)	(4)	(6)	0,00
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	12.000	74	(21)	53	0,00
	South Africa Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	27.250	1.274	(1.334)	(60)	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2025	6.300	608	(581)	27	0,00
MYC	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	6.320	(128)	0	(128)	0,00
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	4.600	34	(14)	20	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	800	135	(121)	14	0,00
					<b>\$ 469</b>	<b>\$ (2.388)</b>	<b>\$ (1.919)</b>	<b>(0,05)</b>

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - Schutzverkauf<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens	
BOA	Chile Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 700	\$ 4	\$ 8	\$ 12	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2027	5.000	(18)	118	100	0,00	
	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.300	(156)	144	(12)	0,00	
	Nigeria Government International Bond	1,000	20.12.2028	1.300	(289)	77	(212)	(0,01)	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.900	26	12	38	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2031	2.000	(84)	72	(12)	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	9.600	(526)	560	34	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2028	14.000	(1.126)	271	(855)	(0,02)	
	BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.500	(171)	152	(19)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.400	6	18	24	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	6.800	39	78	117	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.000	(182)	375	193	0,01	
	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(24)	22	(2)	0,00	
Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	12.000	65	(17)	48	0,00		
Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.900	6	40	46	0,00		
Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	32.100	116	299	415	0,01		
BRC	Serbia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.800	(160)	143	(17)	0,00	
China Government International Bond	1,000	20.06.2029	72.300	1.001	85	1.086	0,03		
Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	3.200	24	28	52	0,00		
Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.687	(277)	343	66	0,00		
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.000	(237)	239	2	0,00	
Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.300	8	7	15	0,00		
Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	6.000	11	45	56	0,00		
Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	7.100	(8)	38	30	0,00		
Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.900	0	20	20	0,00		
Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.200	19	9	28	0,00		
Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.200	(41)	46	5	0,00		
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	16.000	0	1.234	1.234	0,03	
GLM	Nigeria Government International Bond	1,000	20.12.2028	1.250	(270)	66	(204)	0,00	
Qatar Government International Bond	1,000	20.06.2029	60.800	1.754	(165)	1.589	0,04		
Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2028	10.400	(836)	201	(635)	(0,01)		

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Nicht realisierte		Markt- wert	% des Nettovermögens	
					Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Wertzunahme/ (-abnahme)			
GST	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 600	\$ (32)	\$ 34	\$ 2	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.600	33	29	62	0,00	
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2029	77.850	1.078	(317)	761	0,02	
	Israel Government International Bond	1,000	20.12.2024	6.100	8	(2)	6	0,00	
	Israel Government International Bond	1,000	20.12.2025	19.300	21	(16)	5	0,00	
	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2026	3.850	0	(1)	(1)	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	1	0	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	700	(7)	7	0	0,00	
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.000	73	(23)	50	0,00	
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2025	10.000	22	26	48	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	29.100	118	258	376	0,01	
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	4.200	38	30	68	0,00	
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.413	36	(22)	14	0,00	
	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	9.800	(220)	245	25	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	7.700	41	91	132	0,00	
	JPM	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.000	(178)	371	193	0,01
		Nigeria Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.950	(244)	215	(29)	0,00
Nigeria Government International Bond		1,000	20.12.2025	8.700	(442)	164	(278)	(0,01)	
Nigeria Government International Bond		1,000	20.12.2028	5.000	(1.158)	342	(816)	(0,02)	
Panama Government International Bond		1,000	20.12.2024	10.000	47	(14)	33	0,00	
Peru Government International Bond		1,000	20.06.2026	1.500	13	6	19	0,00	
Philippines Government International Bond		1,000	20.06.2029	11.200	205	(52)	153	0,01	
Poland Government International Bond		1,000	20.06.2028	1.300	(3)	24	21	0,00	
Poland Government International Bond		1,000	20.06.2029	17.500	221	35	256	0,01	
Brazil Government International Bond		1,000	20.06.2027	9.100	(564)	545	(19)	0,00	
Mexico Government International Bond		1,000	20.12.2024	4.100	(15)	31	16	0,00	
Mexico Government International Bond		1,000	20.06.2027	200	(1)	3	2	0,00	
Mexico Government International Bond		1,000	20.06.2028	500	(10)	12	2	0,00	
Nigeria Government International Bond		1,000	20.12.2028	5.000	(1.138)	322	(816)	(0,02)	
Peru Government International Bond		1,000	20.06.2026	37.300	105	377	482	0,01	
MYC		Peru Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.000	(10)	52	42	0,00
		Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.300	77	18	95	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2028	20.200	(1.826)	591	(1.235)	(0,03)	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.700	23	12	35	0,00	
					\$ (5.016)	\$ 7.962	\$ 2.946	0,07	

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2024	NZD	17.038	\$ 10.455	\$ 72	\$ 72	0,00	
	07.2024	\$	1.919	NZD 3.134	0	(10)	0,00	
	08.2024	NZD	3.134	\$ 1.919	10	0	0,00	
BOA	07.2024	DOP	47.868	805	0	(4)	0,00	
	07.2024	€	10.700	11.617	149	0	149	0,00
	07.2024	HUF	1.800.368	4.894	11	0	11	0,00
	07.2024	KRW	387.723	283	2	0	2	0,00
	07.2024	PLN	8.912	2.208	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	\$	1.500	€ 1.376	0	(26)	(26)	0,00
	07.2024		1.023	HKD 7.981	0	0	0	0,00
	07.2024		2.437	SEK 25.390	0	(40)	(40)	0,00
	09.2024		29.451	INR 2.467.018	69	0	69	0,00
	02.2025	NGN	1.075.951	\$ 758	88	0	88	0,00
BPS	07.2024	AUD	3.941	2.626	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	CAD	3.400	2.479	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	€	25.255	27.372	305	0	305	0,01
	07.2024	£	20.063	25.629	267	0	267	0,01
	07.2024	INR	2.641.014	31.545	0	(131)	(131)	0,00
	07.2024	KRW	384.819	280	1	0	1	0,00
	07.2024	PLN	82.217	20.306	19	(161)	(142)	0,00
	07.2024	\$	10.236	BRL 53.416	0	(619)	(619)	(0,01)
	07.2024		2.364	CAD 3.226	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024		1.357	¥ 211.900	0	(39)	(39)	0,00
	07.2024		17.271	PLN 69.986	134	0	134	0,00
	07.2024		762	SGD 1.034	1	0	1	0,00
	08.2024	SGD	1.033	\$ 762	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	TRY	501	14	0	0	0	0,00
	08.2024	\$	2.628	AUD 3.941	6	0	6	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2024	CNH	10.525	\$ 1.469	\$ 19	\$ 0	0,00
	09.2024	COP	17.230.401	4.131	23	0	0,00
	09.2024	INR	84.554	1.008	0	(4)	0,00
	09.2024	TWD	66.224	2.058	13	0	0,00
	10.2024	CNH	4.232	591	7	0	0,00
	05.2029	KWD	5.486	18.859	543	0	0,01
BRC	07.2024	THB	65	2	0	0	0,00
	07.2024	TRY	17.512	518	0	(3)	0,00
	07.2024	\$	434	4.568	0	(5)	0,00
	07.2024		19.276	TRY 669.783	865	0	0,02
	08.2024		6.324	220.214	57	0	0,00
	09.2024	MXN	22.883	\$ 1.202	0	(35)	0,00
	09.2024	\$	2.431	TRY 89.570	121	0	0,00
CBK	07.2024	AUD	3.112	\$ 2.076	0	(3)	0,00
	07.2024	BRL	243.526	44.692	849	0	0,02
	07.2024	CHF	1.213	1.333	0	(17)	0,00
	07.2024	COP	13.322.000	3.196	0	(6)	0,00
	07.2024	€	22.737	24.622	255	(1)	0,01
	07.2024	MXN	188.689	10.450	151	0	0,00
	07.2024	SEK	35.426	3.337	0	(8)	0,00
	07.2024	THB	162.588	4.442	6	0	0,00
	07.2024	\$	77	BRL 419	0	(2)	0,00
	07.2024		4.491	£ 3.541	0	(15)	0,00
	07.2024		2.826	NOK 29.825	0	(25)	0,00
	07.2024		2.459	PHP 144.190	8	0	0,00
	07.2024		411	PLN 1.644	0	(2)	0,00
	07.2024		784	TRY 26.438	4	0	0,00
	07.2024		2.681	ZAR 48.753	0	(15)	0,00
	07.2024	ZAR	2.163	\$ 118	0	0	0,00
	08.2024	\$	44.692	BRL 244.344	0	(861)	(0,02)
	09.2024	MXN	3.025	\$ 161	0	(2)	0,00
	09.2024	PEN	29.209	7.760	136	0	0,00
	09.2024	TWD	24.915	773	3	0	0,00
	09.2024	\$	41.491	INR 3.468.824	33	(17)	0,00
	11.2024	EGP	185.830	\$ 3.726	98	0	0,00
	02.2025		295.869	5.790	201	0	0,01
	02.2025	NGN	2.146.466	1.466	130	0	0,00
	05.2025	EGP	82.779	1.576	59	0	0,00
	06.2025		274.142	5.141	153	0	0,00
DUB	07.2024	KRW	210.324	153	0	0	0,00
	07.2024	MYR	4.130	876	0	0	0,00
	07.2024	\$	2.051	CLP 1.897.215	0	(42)	0,00
	07.2024		1.787	EGP 85.509	0	(13)	0,00
	08.2024		6.403	BRL 32.955	0	(491)	(0,01)
	09.2024	PEN	19.255	\$ 5.175	148	0	0,00
	03.2025	\$	293	TRY 13.932	35	0	0,00
FAR	07.2024	€	273.146	\$ 297.498	4.754	0	0,12
	07.2024	\$	2.722	AUD 4.086	7	0	0,00
	07.2024		3.673	NZD 6.022	0	(3)	0,00
	08.2024	NZD	6.022	\$ 3.673	3	0	0,00
GLM	07.2024	CAD	2.842	2.079	2	0	0,00
	07.2024	DOP	91.895	1.558	4	0	0,00
	07.2024	€	5.893	6.380	64	0	0,00
	07.2024	MXN	22.293	1.201	0	(16)	0,00
	07.2024	\$	1	EGP 49	0	0	0,00
	07.2024		9	MYR 43	0	0	0,00
	07.2024		401	TRY 13.705	11	0	0,00
	07.2024	ZAR	467.214	\$ 25.537	0	(18)	0,00
	08.2024	DOP	885.085	14.886	4	(42)	0,00
	08.2024	\$	1.969	TRY 67.964	12	0	0,00
	09.2024	DOP	671.921	\$ 11.237	0	(68)	0,00
	09.2024	MXN	2.008.955	111.204	2.648	0	0,06
	09.2024	\$	2.126	TRY 81.260	178	0	0,00
	12.2024		2.950	EGP 149.713	0	(62)	0,00
JPM	06.2025	EGP	157.678	\$ 2.950	87	0	0,00
	07.2024	CNY	111	16	0	0	0,00
	07.2024	€	9.396	10.182	112	0	0,00
	07.2024	HUF	840.719	2.273	0	(7)	0,00
	07.2024	IDR	858.621	53	0	0	0,00
	07.2024	KRW	259.571	188	0	0	0,00
	07.2024	PLN	9.243	2.315	16	0	0,00
	07.2024	SGD	1.078	801	6	0	0,00
	07.2024	\$	2.851	BRL 15.102	0	(132)	0,00
	07.2024		15.670	CHF 14.062	0	(21)	0,00
	07.2024		339	CZK 7.865	0	(3)	0,00
	07.2024		254	PLN 1.029	2	0	0,00
	07.2024		2.090	ZAR 38.077	0	(8)	0,00
	07.2024	ZAR	885.003	\$ 48.075	0	(330)	(0,01)
	08.2024	CHF	14.010	15.670	20	0	0,00
	08.2024	\$	16	CNY 111	0	0	0,00
	08.2024		52.087	TRY 1.798.225	357	0	0,01
	09.2024	INR	1.070	\$ 13	0	0	0,00
	09.2024	TWD	42.389	1.317	7	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	09.2024	\$ 1.297	EGP 64.408	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	09.2024	6.048	INR 506.757	16	0	16	0,00
	10.2024	CNH 6.240	\$ 872	10	0	10	0,00
	02.2025	EGP 295.985	5.790	198	0	198	0,01
	03.2025	\$ 254	TRY 12.309	36	0	36	0,00
MBC	07.2024	CAD 25.168	\$ 18.484	91	0	91	0,00
	07.2024	CZK 236.384	10.249	131	0	131	0,00
	07.2024	€ 4.665	5.039	40	0	40	0,00
	07.2024	HUF 699.667	1.877	0	(20)	(20)	0,00
	07.2024	NOK 51.952	4.864	0	(16)	(16)	0,00
	07.2024	\$ 1.973	AUD 2.967	8	0	8	0,00
	07.2024	20.598	CAD 28.201	12	0	12	0,00
	07.2024	131.757	€ 123.218	302	0	302	0,01
	07.2024	2.873	£ 2.252	0	(26)	(26)	0,00
	07.2024	16	SGD 21	0	0	0	0,00
	07.2024	1.240	TRY 41.179	8	0	8	0,00
	08.2024	CAD 28.182	\$ 20.598	0	(13)	(13)	0,00
	08.2024	€ 123.218	131.949	0	(302)	(302)	(0,01)
	08.2024	\$ 2.834	NOK 30.168	1	0	1	0,00
	09.2024	TWD 1.034	\$ 32	0	0	0	0,00
	02.2025	\$ 1.923	NGN 3.115.260	16	0	16	0,00
MYI	07.2024	€ 1.460	\$ 1.565	1	0	1	0,00
	07.2024	£ 81	102	0	0	0	0,00
	07.2024	INR 518.066	6.189	0	(24)	(24)	0,00
	07.2024	NOK 8.622	809	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 30.782	BRL 159.003	0	(2.156)	(2.156)	(0,05)
	07.2024	162	€ 151	0	0	0	0,00
	07.2024	383	£ 302	0	0	0	0,00
	07.2024	951	SEK 10.049	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	105	SGD 142	0	0	0	0,00
	08.2024	SEK 10.033	\$ 951	3	0	3	0,00
	08.2024	\$ 809	NOK 8.615	1	0	1	0,00
	09.2024	TWD 16.862	\$ 526	5	0	5	0,00
	09.2024	\$ 3.777	INR 315.823	2	0	2	0,00
RBC	07.2024	18.096	£ 14.270	0	(57)	(57)	0,00
	08.2024	£ 14.270	\$ 18.099	57	0	57	0,00
RYL	07.2024	€ 24.298	25.987	0	(54)	(54)	0,00
	07.2024	\$ 2.054	NZD 3.318	0	(32)	(32)	0,00
SCX	07.2024	€ 251	\$ 270	1	0	1	0,00
	07.2024	INR 3.470.360	41.467	0	(155)	(155)	0,00
	07.2024	KRW 195.275	143	1	0	1	0,00
	07.2024	MXN 1.235.631	66.662	0	(780)	(780)	(0,02)
	07.2024	PEN 43.724	11.663	249	0	249	0,01
	07.2024	SGD 6	4	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 16	CNY 111	0	0	0	0,00
	07.2024	271.778	€ 253.668	90	0	90	0,00
	07.2024	2.481	KRW 3.430.404	11	0	11	0,00
	07.2024	2.456	NOK 26.180	3	0	3	0,00
	08.2024	€ 253.207	\$ 271.685	0	(85)	(85)	0,00
	08.2024	\$ 2.092	¥ 334.300	0	(4)	(4)	0,00
	09.2024	AED 17.190	\$ 4.682	0	0	0	0,00
	09.2024	CNH 3.816	532	6	0	6	0,00
	09.2024	PHP 350.511	5.974	0	(19)	(19)	0,00
	09.2024	TWD 25.654	796	3	0	3	0,00
	09.2024	\$ 1.069	EGP 52.661	0	(9)	(9)	0,00
	12.2024	1.476	74.907	0	(31)	(31)	0,00
	02.2025	NGN 2.163.812	\$ 1.501	154	0	154	0,00
	02.2025	\$ 1.404	NGN 2.270.970	9	0	9	0,00
	09.2024	2.497	EGP 122.963	0	(22)	(22)	0,00
SOG	07.2024	IDR 41.034.252	\$ 2.486	0	(22)	(22)	0,00
SSB	07.2024	7.541	1.867	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	\$ 2.868	BRL 15.520	0	(74)	(74)	0,00
	07.2024	3.333	IDR 54.680.841	9	0	9	0,00
	09.2024	COP 13.983.620	\$ 3.325	0	(9)	(9)	0,00
TOR	07.2024	CHF 57	63	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2.796	NZD 4.564	0	(14)	(14)	0,00
	08.2024	NZD 4.564	\$ 2.796	14	0	14	0,00
	08.2024	\$ 3.689	COP 14.796.339	0	(143)	(143)	0,00
	09.2024	CLP 2.353.850	\$ 2.500	8	0	8	0,00
UAG	07.2024	CHF 12.799	14.164	0	(80)	(80)	0,00
	07.2024	HUF 710	2	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.212	ILS 4.492	0	(19)	(19)	0,00
	08.2024	29.766	€ 27.796	68	0	68	0,00
				\$ 14.909	\$ (7.513)	\$ 7.396	0,18

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD 1.635	\$ 1.089	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	07.2024	\$ 1.460	AUD 2.191	4	0	4	0,00
	08.2024	1.090	1.635	3	0	3	0,00
BOA	07.2024	1	2	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	AUD 1.635	\$ 1.090	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	\$ 8	AUD 12	0	0	0	0,00
	08.2024	1.091	1.635	3	0	3	0,00
BRC	07.2024	1	2	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	AUD 88	\$ 58	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1	AUD 1	0	0	0	0,00
FAR	07.2024	AUD 1.512	\$ 1.008	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 1.104	AUD 1.657	3	0	3	0,00
	08.2024	1.009	1.512	1	0	1	0,00
GLM	07.2024	1	2	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	AUD 23	\$ 15	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 37	AUD 55	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	AUD 5	\$ 4	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	\$ 649	AUD 975	3	0	3	0,00
				\$ 17	\$ (7)	\$ 10	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 24.605	CHF 22.132	\$ 25	\$ 0	\$ 25	0,00
CBK	07.2024	2.534	2.306	32	0	32	0,00
JPM	07.2024	CHF 27.045	\$ 30.136	40	0	40	0,00
	08.2024	\$ 30.136	CHF 26.945	0	(39)	(39)	0,00
SCX	07.2024	957	860	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	29.538	26.681	154	0	154	0,00
UAG	07.2024	CHF 26.902	\$ 29.983	46	0	46	0,00
	07.2024	\$ 29.152	CHF 26.344	164	0	164	0,01
	08.2024	29.983	26.802	0	(45)	(45)	0,00
				\$ 461	\$ (84)	\$ 377	0,01

Zum 30. Juni 2024 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 481.195	€ 443.213	\$ 0	\$ (6.181)	\$ (6.181)	(0,15)
BPS	07.2024	€ 414.336	\$ 443.174	0	(891)	(891)	(0,02)
	07.2024	\$ 408.566	€ 377.391	0	(4.098)	(4.098)	(0,10)
	08.2024	443.822	414.336	891	0	891	0,02
BRC	07.2024	160	149	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	€ 198	\$ 216	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 444	€ 414	0	(1)	(1)	0,00
FAR	07.2024	468.191	429.867	0	(7.481)	(7.481)	(0,18)
GLM	07.2024	315	291	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07.2024	8	8	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	€ 427.002	\$ 456.598	3	(1.045)	(1.042)	(0,03)
	07.2024	\$ 335	€ 312	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	456.722	426.499	1.046	0	1.046	0,03
MYI	07.2024	48	45	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	8	7	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	269	251	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	€ 426.120	\$ 456.545	0	(149)	(149)	0,00
	07.2024	\$ 303	€ 282	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	457.216	426.120	144	0	144	0,00
SSB	07.2024	16.734	15.426	0	(201)	(201)	0,00
UAG	08.2024	€ 30	\$ 32	0	0	0	0,00
				\$ 2.087	\$ (20.052)	\$ (17.965)	(0,43)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 19.663	\$ 24.864	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	07.2024	\$ 49.033	£ 38.477	0	(394)	(394)	(0,01)
	08.2024	24.868	19.663	0	(8)	(8)	0,00
BRC	07.2024	£ 7	\$ 9	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.444	£ 1.136	0	(8)	(8)	0,00
CBK	07.2024	38	30	0	0	0	0,00
	07.2024	25.701	20.142	0	(239)	(239)	(0,01)
MBC	07.2024	£ 20.209	\$ 25.569	22	0	22	0,00
	07.2024	\$ 227	£ 179	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	25.557	20.197	0	(22)	(22)	0,00
RBC	07.2024	£ 20.119	\$ 25.512	81	0	81	0,00
	08.2024	\$ 25.517	£ 20.119	0	(80)	(80)	0,00
RYL	07.2024	81	63	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 111	\$ (753)	\$ (642)	(0,02)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 11.638	\$ 8.574	\$ 0	\$ (13)	\$ (13)	0,00
	07.2024	\$ 7.790	SGD 10.514	0	(32)	(32)	0,00
	08.2024	SGD 118	\$ 87	0	0	0	0,00
BPS	08.2024	\$ 8.574	SGD 11.621	13	0	13	0,00
	07.2024	SGD 11.721	\$ 8.642	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	\$ 8.642	SGD 11.704	7	0	7	0,00
BRC	07.2024	9	12	0	0	0	0,00
	07.2024	439	592	0	(2)	(2)	0,00
GLM	07.2024	SGD 180	\$ 134	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 107	SGD 144	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2024	SGD 22	\$ 16	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 8.602	SGD 11.578	0	(59)	(59)	0,00
MBC	07.2024	SGD 73	\$ 54	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 67	SGD 91	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	5	6	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	SGD 32	\$ 24	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 8.597	SGD 11.584	0	(50)	(50)	0,00
UAG	07.2024	SGD 61	\$ 45	0	0	0	0,00
				\$ 21	\$ (163)	\$ (142)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (9.939) (0,24)

Summe Anlagen

\$ 4.496.695 108,77

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (362.578) (8,77)

Nettovermögen

\$ 4.134.117 100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(h) Mit dem Fonds verbunden.

(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(j) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,91 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 460	\$ 460	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071	10.06.2022	0	0	0,00
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	31.381	25.435	0,62
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	7.281	8510	0,21
		\$ 39.122	\$ 34.405	0,84

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

(k) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 323.725 USD (31. Dezember 2023: 422.139 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(l) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 2.785 USD (31. Dezember 2023: null USD) und Barmittel in Höhe von 13.462 USD (31. Dezember 2023: 4.980 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 824 USD (31. Dezember 2023: 4.698 USD) und Barmittel in Höhe von 2.444 USD (31. Dezember 2024: 3.381 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 30.808 USD (31. Dezember 2023: 27.700 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 4.288.630	\$ 127.497	\$ 4.416.127
Investmentfonds	84.642	0	0	84.642
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(126)	(5.182)	1.234	(4.074)
<b>Summen</b>	<b>\$ 84.516</b>	<b>\$ 4.283.448</b>	<b>\$ 128.731</b>	<b>\$ 4.496.695</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 3.834.962	\$ 99.009	\$ 3.933.972
Investmentfonds	192.346	0	0	192.346
Pensionsgeschäfte	0	2.599	0	2.599
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.938)	28.322	1.389	27.773
Einlagen bei Kreditinstituten	0	60.900	0	60.900
<b>Summen</b>	<b>\$ 190.409</b>	<b>\$ 3.926.783</b>	<b>\$ 100.398</b>	<b>\$ 4.217.590</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens	
BPS	3,750 %	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (2.057)	\$ (2.209)	(0,05)	
	3,800	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(39.257)	(42.158)	(1,02)	
	4,300	15.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (484)	(490)	(0,01)	
	4,500	22.11.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(714)	(734)	(0,02)	
	5,330	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(8.227)	(8.250)	(0,20)	
	5,450	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(8.010)	(8.033)	(0,19)	
	5,540	14.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(16.862)	(16.906)	(0,41)	
	5,600	15.05.2024	15.07.2024	(16.192)	(16.310)	(0,39)	
	4,750	31.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(10.047)	(10.088)	(0,24)	
	4,750	05.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(705)	(707)	(0,02)	
BRC	5,000	15.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(13.182)	(13.433)	(0,32)	
	5,000	31.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.499)	(2.509)	(0,06)	
	5,150	27.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(632)	(644)	(0,02)	
	5,450	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(29.117)	(29.201)	(0,71)	
	5,480	10.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(21.801)	(22.073)	(0,53)	
	3,800	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (8.339)	(8.955)	(0,22)	
	GSC	5,460	23.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (15.109)	(15.267)	(0,37)
		5,470	23.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(6.015)	(6.078)	(0,15)
	IND	3,000	21.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(1.007)	(1.008)	(0,02)
		5,000	05.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(197)	(199)	0,00
5,000		06.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.254)	(2.261)	(0,05)	
5,200		12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(8.190)	(8.212)	(0,20)	
5,250		12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(1.202)	(1.206)	(0,03)	
5,350		10.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.449)	(2.479)	(0,06)	
5,350		12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(6.753)	(6.772)	(0,16)	
5,300		04.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(3.526)	(3.540)	(0,09)	
NOM	5,300	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(7.026)	(7.046)	(0,17)	
	5,300	13.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(6.187)	(6.203)	(0,15)	
	5,450	28.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(9.397)	(9.401)	(0,23)	
	5,550	27.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(4.172)	(4.174)	(0,10)	
	SCX	3,850	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (38.334)	(41.169)	(1,00)
		5,200	08.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (640)	(645)	(0,02)
		5,250	13.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(697)	(699)	(0,02)
5,300	13.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(1.909)	(1.914)	(0,05)		
5,580	17.11.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(9.151)	(9.473)	(0,23)		
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>				<b>\$ (310.446)</b>	<b>(7,51)</b>		

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 76	\$ 0	\$ 76	\$ 88	\$ 0	\$ 88
BOA	(7.333)	7.839	506	(1.075)	1.740	665
BPS	(4.164)	4.500	336	4.872	(7.810)	(2.938)
BRC	1.957	(1.780)	177	1.009	(1.900)	(891)
BSH	k. A.	k. A.	k. A.	(158)	0	(158)
CBK	1.292	(1.420)	(128)	(696)	1.140	444
DUB	632	(730)	(98)	1.429	(1.270)	159
FAR	(2.717)	(3.700)	(6.417)	0	(290)	(290)
GLM	3.551	(4.590)	(1.039)	(1.718)	940	(778)
GST	1.227	(1.220)	7	705	(690)	15
HUS	(15)	0	(15)	13	(150)	(137)
JPM	(148)	0	(148)	(659)	620	(39)
MBC	234	0	234	2.577	(4.680)	(2.103)
MYC	(1.525)	1.430	(95)	180	(380)	(200)
MYI	(2.136)	1.870	(266)	1.515	(1.480)	35
RBC	1	0	1	(2)	0	(2)
RYL	(87)	0	(87)	(32)	0	(32)
SCX	(612)	316	(296)	(779)	540	(239)
SOG	(22)	0	(22)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	(306)	292	(14)	(23)	0	(23)
TOR	22	(310)	(288)	135	0	135
UAG	134	(280)	(146)	9	0	9

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	90,61	91,76
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	14,91	10,19
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,30	0,33
Investmentfonds	2,05	5,00
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	0,37
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,04	0,16
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,24)	0,19
Einlagezertifikate	k. A.	1,58
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(7,51)	(10,47)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Angola	0,66	1,02
Argentinien	2,25	2,00
Aserbaidschan	0,93	1,11
Bahrain	0,27	0,29
Benin	0,12	k. A.
Bermuda	0,02	k. A.
Brasilien	2,59	2,00
Bulgarien	k. A.	0,27
Kamerun	0,32	0,29
Kanada	k. A.	0,03
Cayman-Inseln	4,78	3,24
Chile	3,70	2,72
China	0,00	0,03
Kolumbien	2,34	2,27
Costa Rica	0,23	0,25
Tschechische Republik	0,32	k. A.
Dominikanische Republik	3,71	3,67
Ecuador	1,03	1,10
Ägypten	1,92	2,20
El Salvador	0,78	0,44
Gabun	0,13	0,02
Georgien	0,01	0,01
Ghana	0,69	0,57
Guatemala	0,84	0,78
Hongkong	0,95	1,02
Ungarn	2,27	1,82
Indien	0,25	0,23
Indonesien	3,13	3,74
International	0,53	0,21
Irak	0,07	0,08
Irland	1,12	0,66

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Insel Man	0,08	k. A.
Israel	2,24	1,73
Italien	0,07	k. A.
Elfenbeinküste	1,51	0,24
Jamaika	0,07	0,07
Japan	k. A.	0,43
Jersey, Kanalinseln	k. A.	0,65
Jordanien	0,33	0,30
Kasachstan	1,02	1,03
Kenia	0,40	0,22
Lettland	0,25	k. A.
Libanon	0,02	0,02
Luxemburg	1,73	1,79
Mazedonien	0,21	0,23
Malaysia	0,57	0,65
Mexiko	10,99	8,34
Mongolei	k. A.	0,03
Marokko	0,79	0,54
Multinational	0,24	0,25
Namibia	k. A.	0,15
Niederlande	0,39	0,31
Nigeria	0,98	1,32
Oman	1,29	1,46
Pakistan	0,90	0,85
Panama	2,53	1,79
Paraguay	0,70	0,40
Peru	1,71	1,22
Philippinen	0,46	0,53
Polen	0,74	1,11
Katar	2,05	2,51
Rumänien	2,12	1,58
Russland	0,00	0,01
Saudi-Arabien	2,20	3,19
Senegal	0,93	0,63
Serbien	1,15	1,23
Singapur	0,53	0,22
Slowenien	0,30	0,33
Südafrika	3,51	4,48
Südkorea	1,28	0,85
Spanien	0,33	0,35
Sri Lanka	0,88	0,72
Supranational	0,02	0,18
Schweiz	k. A.	0,30
Tansania	0,42	1,02
Thailand	0,06	0,06
Trinidad und Tobago	0,23	0,16
Tunesien	0,46	0,66
Türkei	4,17	5,34
Ukraine	0,75	0,46
Vereinigte Arabische Emirate	3,59	2,55
Großbritannien	1,81	1,15
USA	10,28	10,62
Usbekistan	1,16	0,37
Venezuela	0,71	0,69
Vietnam	0,01	0,01
Jungferninseln (Britisch)	0,11	0,12
Sambia	0,01	0,01
Kurzfristige Instrumente	1,57	4,75
Investmentfonds	2,05	5,00
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	0,37
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,04	0,16
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,05)	(0,05)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,07	0,22
Devisenterminkontrakte	0,18	(0,30)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,44)	0,32
Einlagenzertifikate	k. A.	1,58
Sonstige Aktiva und Passiva	(8,77)	(9,65)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026 \$ 1.000 \$ 953 0,03			
Argentina Government International Bond				Betony CLO Ltd.				Summe Cayman Inseln			
0,750 % fällig am 09.07.2030	\$ 13.162	\$ 7.410	0,26	6,671 % fällig am 30.04.2031	\$ 769	\$ 770	0,03				
1,000 % fällig am 09.07.2029	4.194	2.416	0,08	Golub Capital Partners CLO Ltd.							
3,500 % fällig am 09.07.2041	100.729	39.687	1,38	6,606 % fällig am 20.04.2031	675	676	0,02				
3,625 % fällig am 09.07.2035	4.979	2.101	0,07	KKR CLO Ltd.							
4,250 % fällig am 09.01.2038 (i)	11.313	5.215	0,18	6,590 % fällig am 15.04.2031	839	840	0,03				
Provincia de Buenos Aires				6,719 % fällig am 16.10.2030	636	637	0,02				
6,375 % fällig am 01.09.2037	6.872	2.852	0,10	Northwoods Capital Ltd.							
Provincia de la Rioja				7,201 % fällig am 15.06.2031	848	850	0,03				
8,500 % fällig am 24.02.2028	425	229	0,01	Voya CLO Ltd.							
Provincia de Neuquen				6,538 % fällig am 19.04.2031	702	702	0,03				
6,750 % fällig am 27.04.2030	296	249	0,01			4.475	0,16				
Summe Argentinien		60.159	2,09	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>							
<b>BAHAMAS</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				Meituan			
Bahamas Government International Bond				9,000 % fällig am 16.06.2029				0,000 % fällig am 27.04.2027 (c)			
	4.400	4.202	0,15		9.500	9.044	0,31				
<b>BAHRAIN</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				Sunac China Holdings Ltd.			
Bahrain Government International Bond				4,250 % fällig am 25.01.2028				1,000 % fällig am 30.09.2032			
4,250 % fällig am 25.01.2028	16.900	15.878	0,55		358	23	0,00				
5,250 % fällig am 25.01.2033	3.000	2.677	0,09			9.067	0,31				
5,625 % fällig am 30.09.2031	9.200	8.654	0,30	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
6,000 % fällig am 19.09.2044	1.300	1.072	0,04	Adib Sukuk Co. Ltd.							
Summe Bahrain		28.281	0,98	5,695 % fällig am 15.11.2028				10.000			
<b>BENIN</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				10.175			
Benin Government International Bond				4,875 % fällig am 19.01.2032				0,35			
4,875 % fällig am 19.01.2032	€ 3.000	2.701	0,09	Alibaba Group Holding Ltd.				5.000			
4,950 % fällig am 22.01.2035	16.200	13.757	0,48	2,700 % fällig am 09.02.2041 (i)				3.362			
6,875 % fällig am 19.01.2052	900	764	0,03	Baidu, Inc.				1.900			
7,960 % fällig am 13.02.2038	\$ 1.900	1.770	0,06	2,375 % fällig am 23.08.2031				1.580			
Summe Benin		18.992	0,66	Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.				4.394			
<b>BERMUDA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3.295			
Star Energy Geothermal Darajat				4,850 % fällig am 14.10.2038				0,000 % fällig am 05.06.2034 (c)			
	3.800	3.487	0,12	CIFI Holdings Group Co. Ltd.				2.900			
<b>BRASILIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				326			
Banco do Brasil S.A.				6,000 % fällig am 18.03.2031				4,450 % fällig am 17.08.2026 ^			
6,000 % fällig am 18.03.2031	7.400	7.248	0,25	Country Garden Holdings Co. Ltd.				2.300			
Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais				2,700 % fällig am 12.07.2026 ^				198			
5,333 % fällig am 15.02.2028	9.044	8.909	0,31	3,875 % fällig am 22.10.2030 ^				158			
CSN Inova Ventures				FWD Group Holdings Ltd.				7.300			
6,750 % fällig am 28.01.2028	8.300	7.896	0,27	7,635 % fällig am 02.07.2031 (a)				7.425			
Rede D'or Finance SARL				Hongkong Land Finance Cayman Islands Co. Ltd.				13.000			
4,500 % fällig am 22.01.2030	263	238	0,01	2,250 % fällig am 15.07.2031				10.674			
St Marys Cement, Inc. Canada				IHS Holding Ltd.				1.500			
5,750 % fällig am 02.04.2034	10.500	10.316	0,36	5,625 % fällig am 29.11.2026				1.425			
Suzano Austria GmbH				Interoceanica Finance Ltd.				17			
3,125 % fällig am 15.01.2032	3.000	2.458	0,09	0,000 % fällig am 30.11.2025 (c)				119			
Summe Brasilien		96.769	3,36	0,000 % fällig am 30.11.2025 (c)				2.150			
<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				7.860			
Brazil Government International Bond				4,750 % fällig am 14.01.2050				7,860 % fällig am 15.05.2030			
4,750 % fällig am 14.01.2050	17.675	12.719	0,44	Kaisa Group Holdings Ltd.				2.360			
5,000 % fällig am 27.01.2045	8.495	6.558	0,23	9,375 % fällig am 30.06.2024 ^				1.850			
6,125 % fällig am 22.01.2032	9.000	8.899	0,31	9,750 % fällig am 28.09.2023 ^				300			
6,125 % fällig am 15.03.2034	700	674	0,02	11,250 % fällig am 09.04.2022 ^				1.000			
6,250 % fällig am 18.03.2031	29.000	28.821	1,00	11,500 % fällig am 30.01.2023 ^				200			
7,125 % fällig am 13.05.2054	2.100	2.033	0,07	11,650 % fällig am 01.06.2026 ^				3.600			
Summe Brasilien		59.704	2,07	11,700 % fällig am 11.11.2025 ^				1.450			
<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				11,950 % fällig am 12.11.2023 ^			
Brazil Government International Bond				3,000 % fällig am 15.01.2032				Lima Metro Line Finance Ltd.			
3,000 % fällig am 15.01.2032	3.000	2.458	0,09	5,875 % fällig am 05.07.2034 (i)				429			
Summe Brasilien		96.769	3,36	MAF Sukuk Ltd.				429			
<b>CHINA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3.490			
Chile Government International Bond				6,000 % fällig am 30.09.2029 (b)				3.600			
2,550 % fällig am 27.01.2032	21.400	18.001	0,62	Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % Bargeld oder 6,000 % PIK)				3.490			
3,100 % fällig am 07.05.2041	11.700	8.589	0,30	5,000 % fällig am 30.09.2026 (b)				420			
3,100 % fällig am 22.01.2061	7.900	4.897	0,17	Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK)				420			
3,250 % fällig am 21.09.2071	4.800	2.979	0,10	5,250 % fällig am 30.09.2027 (b)				842			
3,500 % fällig am 25.01.2050	8.600	6.208	0,22	Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK)				79			
3,500 % fällig am 15.04.2053	13.600	9.644	0,33	Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % bar oder 6,750 % PIK)				1.264			
4,340 % fällig am 07.03.2042 (i)	7.700	6.657	0,23	5,750 % fällig am 30.09.2028 (b)				109			
4,850 % fällig am 22.01.2029 (i)	20.900	20.682	0,72	Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK)				1.266			
4,950 % fällig am 05.01.2036	2.000	1.922	0,07	6,000 % fällig am 30.09.2029 (b)				95			
Summe Chile		137.954	4,78	Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK)				595			
<b>CHINA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7.530			
Yango Justice International Ltd.				6,500 % fällig am 07.11.2033				10.500			
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^	3.300	17	0,00	Xiaomi Best Time International Ltd.				4.100			
7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	2.000	10	0,00	4,100 % fällig am 14.07.2051				7.530			
Summe China		27	0,00	Summe China				7.530			
<b>KOLUMBIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,26			
Banco Davivienda S.A.				6,650 % fällig am 22.04.2031				0,26			
6,650 % fällig am 22.04.2031	9.220	6.823	0,24	Colombia Government International Bond				300			
Summe Kolumbien		80.082	2,78	3,000 % fällig am 30.01.2030				246			
<b>COSTA RICA</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				6.495			
Costa Rica Government International Bond				4,500 % fällig am 15.03.2029				7.100			
5,625 % fällig am 30.04.2043	22.450	20.250	0,70	8,000 % fällig am 14.11.2035				40.100			
6,550 % fällig am 03.04.2034	1.200	1.238	0,04	8,750 % fällig am 14.11.2053				23.900			
7,158 % fällig am 12.03.2045	2.400	2.497	0,09	Summe Kolumbien				80.082			
7,300 % fällig am 13.11.2054	4.200	4.415	0,16	Summe Kolumbien				80.082			
Summe Costa Rica		28.400	0,99	Summe Kolumbien				80.082			







BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Türkiye İs Bankası A/S 7,750 % fällig am 12.06.2029	\$ 8.900	\$ 8.915	0,31
		18.008	0,63
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Export-Credit Bank of Turkey 5,750 % fällig am 06.07.2026	10.800	10.519	0,37
Turkey Government International Bond 4,875 % fällig am 16.04.2043	8.200	5.820	0,20
5,750 % fällig am 11.05.2047	20.400	15.696	0,54
5,875 % fällig am 21.05.2030	€ 9.500	10.200	0,35
7,625 % fällig am 15.05.2034 (i)	\$ 10.900	10.995	0,38
9,125 % fällig am 13.07.2030	21.600	23.574	0,82
		76.804	2,66
Summe Türkei		94.812	3,29
<b>UKRAINE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
NPC Ukrenergo 6,875 % fällig am 09.11.2028	6.400	2.352	0,08
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
State Agency of Roads of Ukraine 6,250 % fällig am 24.06.2030	7.900	2.192	0,08
Ukraine Government International Bond 6,876 % fällig am 21.05.2031	20.700	6.003	0,21
7,253 % fällig am 15.03.2035	23.400	6.774	0,24
7,375 % fällig am 25.09.2034	8.400	2.436	0,08
7,750 % fällig am 01.09.2024	3.900	1.264	0,04
7,750 % fällig am 01.09.2025	6.800	2.171	0,08
7,750 % fällig am 01.09.2026	12.300	3.850	0,13
7,750 % fällig am 01.09.2027	6.800	2.101	0,07
7,750 % fällig am 01.09.2029	8.300	2.552	0,09
7,750 % fällig am 01.08.2041	12.000	5.916	0,21
8,994 % fällig am 01.02.2026	7.300	2.402	0,08
9,750 % fällig am 01.11.2030	4.500	1.447	0,05
		39.108	1,36
Summe Ukraine		41.460	1,44
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 5,500 % fällig am 12.01.2029	7.500	7.598	0,26
First Abu Dhabi Bank PJSC 4,774 % fällig am 06.06.2028	6.500	6.429	0,22
Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. 4,875 % fällig am 25.07.2033 (i)	18.000	17.435	0,61
MDGH GMTN RSC Ltd. 3,700 % fällig am 07.11.2049	3.000	2.295	0,08
3,950 % fällig am 21.05.2050	800	638	0,02
5,084 % fällig am 22.05.2053 (i)	2.000	1.899	0,07
5,875 % fällig am 01.05.2034	9.900	10.451	0,36
NBK SPC Ltd. 5,500 % fällig am 06.06.2030	14.600	14.751	0,51
Sweihan PV Power Co. PJSC 3,625 % fällig am 31.01.2049	4.841	3.884	0,14
		65.380	2,27
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
NMC Opco Ltd. 11,585 % fällig am 25.03.2027	AED 14.587	4.011	0,14
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,125 % fällig am 30.09.2049	\$ 800	560	0,02
3,875 % fällig am 16.04.2050	1.500	1.196	0,04
5,500 % fällig am 30.04.2054	9.700	9.864	0,34
Emirate of Dubai Government International Bond 3,900 % fällig am 09.09.2050	700	515	0,02
Finanzministerium der Regierung von Schardscha 6,125 % fällig am 06.03.2036	15.000	14.911	0,52
6,500 % fällig am 23.11.2032	18.700	19.386	0,67
		46.432	1,61
Summe Vereinigte Arabische Emirate		115.823	4,02

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>GROSSBRITANNIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
NatWest Group PLC 5,076 % fällig am 27.01.2030	\$ 300	\$ 295	0,01
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC 7,875 % fällig am 15.07.2028	6.500	4.607	0,16
8,250 % fällig am 09.07.2026	3.100	2.356	0,08
Ukreximbank Via Biz Finance PLC 9,750 % fällig am 22.01.2025	325	307	0,01
		7.565	0,26
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Canada Square Funding PLC 6,083 % fällig am 17.01.2059	£ 1.667	2.109	0,08
Polaris PLC 6,510 % fällig am 23.05.2059	3.396	4.314	0,15
Rochester Financing PLC 5,934 % fällig am 18.12.2044	1.608	2.029	0,07
Tower Bridge Funding PLC 5,954 % fällig am 20.12.2063	682	862	0,03
		9.314	0,33
Summe Großbritannien		16.879	0,59
<b>USA FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. 5,940 % fällig am 25.02.2037	\$ 570	546	0,02
6,585 % fällig am 25.11.2035	526	515	0,02
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 3,181 % fällig am 25.01.2037	2.251	646	0,02
Long Beach Mortgage Loan Trust 5,760 % fällig am 25.09.2036	762	477	0,02
MASTR Asset-Backed Securities Trust 5,900 % fällig am 25.11.2036	850	499	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 6,255 % fällig am 25.03.2034	666	670	0,02
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 5,610 % fällig am 25.07.2036	144	131	0,01
Option One Mortgage Loan Trust 5,680 % fällig am 25.05.2037	214	126	0,00
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 6,240 % fällig am 25.09.2035	1.000	870	0,03
Saxon Asset Securities Trust 5,770 % fällig am 25.09.2037	37	35	0,00
Soundview Home Loan Trust 5,640 % fällig am 25.02.2037	189	53	0,00
6,360 % fällig am 25.10.2037	115	90	0,00
		4.658	0,16
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bank of America Corp. 0,981 % fällig am 25.09.2025	8.700	8.603	0,30
Credit Suisse AG AT1 Claim	2.100	252	0,01
Ford Motor Co. 3,250 % fällig am 12.02.2032	12.000	9.923	0,34
Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. 5,000 % fällig am 27.07.2028	14.200	14.184	0,49
Morgan Stanley 0,864 % fällig am 21.10.2025	2.500	2.462	0,09
Rutas 2 and 7 Finance Ltd. 0,000 % fällig am 30.09.2036 (c)	4.333	2.988	0,10
Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % fällig am 09.09.2026	12.000	11.946	0,41
SK Battery America, Inc. 4,875 % fällig am 23.01.2027	9.300	9.179	0,32
Unigel S.A. 8,750 % fällig am 01.03.2030	1.669	1.669	0,06
		61.206	2,12
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
Ziraat Bank TBD % fällig am 15.06.2034	8.200	8.203	0,28

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. 4,407 % fällig am 15.11.2061	\$ 3.300	\$ 3.178	0,11
Benchmark Mortgage Trust 4,261 % fällig am 10.10.2051	4.400	4.159	0,14
CitiMortgage Alternative Loan Trust 6,000 % fällig am 25.10.2036	70	52	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust 5,810 % fällig am 25.05.2036	114	45	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 3,199 % fällig am 30.11.2037	519	464	0,02
IndyMac Mortgage Loan Trust 3,414 % fällig am 25.11.2037	194	156	0,01
5,820 % fällig am 25.02.2037	240	237	0,01
6,100 % fällig am 25.07.2045	51	40	0,00
JPMorgan Resecuritization Trust 2,500 % fällig am 25.03.2056	22	21	0,00
Lehman XS Trust 5,840 % fällig am 25.09.2046	188	158	0,01
5,960 % fällig am 25.08.2037	662	621	0,02
Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,760 % fällig am 25.02.2037	364	328	0,01
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 4,477 % fällig am 25.10.2037	48	41	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,580 % fällig am 25.03.2036	175	158	0,01
		9.658	0,34
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053 - 01.10.2053	85.924	83.115	2,88
<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.02.2042	8.600	6.263	0,22
3,250 % fällig am 15.05.2042 (i)	58.600	48.747	1,69
3,375 % fällig am 15.08.2042	25.500	21.545	0,74
4,375 % fällig am 15.08.2043	6.800	6.566	0,23
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2029	27.400	25.846	0,90
		108.967	3,78
Summe USA		275.807	9,56
<b>URUGUAY STAATSEMISSIONEN</b>			
Uruguay Government International Bond 5,750 % fällig am 28.10.2034 (i)	24.900	25.983	0,90
<b>USBEKISTAN STAATSEMISSIONEN</b>			
National Bank of Uzbekistan 4,850 % fällig am 21.10.2025	3.078	2.969	0,10
8,500 % fällig am 05.07.2029 (a)	7.300	7.220	0,25
Republic of Uzbekistan International Bond 5,375 % fällig am 29.05.2027	€ 7.900	8.454	0,30
Summe Usbekistan		18.643	0,65
<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH) UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	\$ 6.029	6.070	0,21
<b>SAMBIA STAATSEMISSIONEN</b>			
Zambia Government International Bond 0,500 % fällig am 31.12.2053	248	122	0,00
5,750 % fällig am 30.06.2033	300	263	0,01
Summe Sambia		385	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>							
25,600 % fällig am				25,751 % fällig am			
20.08.2024 (c)(d)	EGP 228.900	\$ 4.607	0,16	17.09.2024 (c)(d)	EGP 500.000	\$ 9.867	0,34
25,651 % fällig am				25,851 % fällig am			
31.12.2024 (c)(d)	152.375	2.809	0,10	26.11.2024 (c)(d)	312.600	5.891	0,21
25,700 % fällig am				25,899 % fällig am			
10.12.2024 (c)(d)	299.925	5.599	0,19	10.09.2024 (c)(d)	217.500	4.313	0,15
				Summe kurzfristige Instrumente		33.086	1,15
				Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 3.191.625	110,68

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 797	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (813)	\$ 797	\$ 797	0,03
SAL	5,270	28.06.2024	01.07.2024	2.600	U.S. Treasury Notes 4,875 % fällig am 30.11.2025	(2.662)	2.600	2.601	0,09
	5,340	28.06.2024	01.07.2024	8.400	U.S. Treasury Notes 5,000 % fällig am 30.09.2025	(8.673)	8.400	8.404	0,29
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (12.148)	\$ 11.797	\$ 11.802	0,41

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	667	\$ (377)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	496	(870)	(0,03)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	152	182	0,01
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	430	211	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	3.015	1.053	0,04
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	2.128	1.011	0,03
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	81	42	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	106	(478)	(0,02)
				\$ 774	0,03
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 774	0,03

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000 %	21.09.2024	\$ 63.400	\$ 264	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.12.2031	1.800	(320)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	70.600	773	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	9.250	74	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	33.840	515	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2054	26.100	561	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	2.300	(69)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	2.700	(78)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	6.600	(81)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	14.200	207	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	68.100	(273)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	21.900	231	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	14.400	(148)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2036	5.700	124	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	1.700	10	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	1.400	18	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	1.700	25	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.06.2026	68.700	1.175	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	1.300	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	3.400	31	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,155	02.10.2033	4.500	40	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,165	27.09.2033	5.500	54	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	5.900	61	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	4.000	43	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220 %	20.10.2033	\$ 3.100	\$ 46	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	2.800	44	0,00	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2034	9.100	367	0,01	
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2034	23.700	398	0,01	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	2.200	39	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	200	6	0,00	
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	2.500	87	0,00	
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	9,842	04.01.2027	BRL 350.200	(2.415)	(0,08)	
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	11,550	04.01.2027	14.300	(14)	0,00	
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	11,570	04.01.2027	184.700	(165)	(0,01)	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,850	02.01.2025	68.400	(63)	0,00	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,240	02.01.2025	160.300	(141)	(0,01)	
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,055	04.01.2027	81.200	(374)	(0,01)	
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,216	02.01.2025	28.100	(101)	0,00	
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,241	02.01.2025	28.200	(104)	0,00	
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,427	02.01.2025	66.100	(282)	(0,01)	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,428	02.01.2025	93.200	400	0,01	
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	30.11.2024	ZAR 346.600	220	0,01	
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,855	18.12.2033	CLP 8.000.000	(314)	(0,01)	
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,511	13.11.2033	8.456.600	(105)	0,00	
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR	3,675	08.01.2029	560.000	514	0,02	
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR	3,769	09.01.2029	38.300	(11)	0,00	
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,175	07.11.2028	1.243.200	1.807	0,06	
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	139.300	31	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	20.03.2044	€ 1.800	56	0,00	
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	8.600	440	0,02	
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	14.300	25	0,00	
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	34.700	(892)	(0,03)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	3.700	228	0,01	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028	1.000	39	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028	4.300	184	0,01	
						\$ 3.185	0,11
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 3.185</b>	<b>0,11</b>

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Chile Government International Bond	(1,000) %	20.12.2028	\$ 2.800	\$ (58)	\$ 1	\$ (57)	0,00	
	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	2.200	72	(93)	(21)	0,00	
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	4.300	714	(638)	76	0,00	
BPS	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	1.740	(35)	0	(35)	0,00	
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	8.800	35	4	39	0,00	
	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	700	23	(30)	(7)	0,00	
BRC	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	6.900	(142)	3	(139)	(0,01)	
	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	3.400	91	(124)	(33)	0,00	
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	1.200	(35)	1	(34)	0,00	
CBK	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	14.400	57	6	63	0,00	
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	2.800	466	(417)	49	0,00	
GST	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	60	(1)	0	(1)	0,00	
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	16.100	70	0	70	0,00	
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	57.200	(1.669)	27	(1.642)	(0,06)	
JPM	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	3.600	(73)	0	(73)	0,00	
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	8.500	52	(15)	37	0,00	
MYC	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2028	4.800	(97)	0	(97)	0,00	
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	10.200	48	(3)	45	0,00	
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	4.300	(126)	3	(123)	0,00	
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	2.500	422	(378)	44	0,00	
						\$ (186)	\$ (1.653)	\$ (1.839)	(0,07)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - Schutzverkauf<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Egypt Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 1.000	\$ (120)	\$ 111	\$ (9)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	18.100	13	60	73	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	6.400	26	57	83	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2031	10.700	(451)	386	(65)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	1.200	(66)	70	4	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(20)	17	(3)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festszinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 10.400	\$ (639)	\$ 644	\$ 5	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2027	8.200	(589)	526	(63)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.000	5	13	18	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2029	12.000	(432)	(56)	(488)	(0,02)
	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(24)	22	(2)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.100	(5)	13	8	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	6.100	54	25	79	0,00
	Serbia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.600	(142)	127	(15)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	32.000	(2.760)	1.966	(794)	(0,03)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.800	(751)	652	(99)	0,00
BRC	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.500	14	29	43	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2025	17.500	360	(178)	182	0,01
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	6.500	49	56	105	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	3	0	3	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2029	12.200	(440)	(56)	(496)	(0,02)
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.300	0	14	14	0,00
DUB	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2034	5.000	(573)	(15)	(588)	(0,02)
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.100	18	9	27	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.000	140	(51)	89	0,00
GLM	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	(108)	100	(8)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2026	900	(15)	17	2	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	10.400	(638)	605	(33)	0,00
GST	Qatar Government International Bond	1,000	20.06.2029	8.300	239	(22)	217	0,01
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	200	(11)	12	1	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2028	8.900	17	168	185	0,01
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	14.000	(34)	82	48	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2029	7.200	(259)	(34)	(293)	(0,01)
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2029	11.700	162	(48)	114	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	13.700	99	78	177	0,01
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	8.500	77	60	137	0,01
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	4.300	(840)	728	(112)	0,00
	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	8.000	(179)	199	20	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2028	1.100	(38)	24	(14)	0,00
	Hungary Government International Bond	1,000	20.06.2027	5.700	(290)	313	23	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2024	7.400	60	(30)	30	0,00
MYC	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	900	(2)	17	15	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.400	6	5	11	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2026	15.000	208	17	225	0,01
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	16.300	112	168	280	0,01
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2029	13.300	(478)	(63)	(541)	(0,02)
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.800	19	0	19	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2034	5.000	(573)	(15)	(588)	(0,02)
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	9.800	45	82	127	0,01
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2026	20.000	80	203	283	0,01
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.900	57	13	70	0,00
MYI	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.600	(206)	191	(15)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.800	(356)	309	(47)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.300	11	6	17	0,00
					\$ (9.165)	\$ 7.626	\$ (1.539)	(0,05)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückterlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückterlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD 12.985	\$ 7.968	\$ 55	\$ 0	\$ 55	0,00
	07.2024	\$ 1.416	NZD 2.311	0	(7)	(7)	0,00
	08.2024	NZD 2.311	\$ 1.416	7	0	7	0,00
BOA	07.2024	DOP 25.985	437	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	€ 13.237	14.360	174	0	174	0,01
	07.2024	HUF 1.075.875	2.925	7	0	7	0,00
	07.2024	KRW 376.248	275	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 10.551	€ 9.677	0	(180)	(180)	(0,01)
	07.2024	1.669	NOK 17.875	10	0	10	0,00
	07.2024	181	PLN 733	1	0	1	0,00
	08.2024	505	TRY 17.693	6	0	6	0,00
	09.2024	CLP 3.318.147	\$ 3.514	17	(16)	1	0,00
	09.2024	\$ 1.950	INR 163.364	5	0	5	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	AUD 5.147	\$ 3.432	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	07.2024	CAD 2.009	1.465	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	€ 15.519	16.805	172	0	172	0,01
	07.2024	£ 15.012	19.176	200	0	200	0,01
	07.2024	INR 2.692.753	32.172	0	(124)	(124)	(0,01)
	07.2024	KRW 373.428	272	1	0	1	0,00
	07.2024	PLN 63.199	15.609	14	(123)	(109)	0,00
	07.2024	\$ 2.036	CAD 2.779	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	4.202	€ 3.895	0	(27)	(27)	0,00
	07.2024	12.812	PLN 51.918	100	0	100	0,00
	07.2024	1.193	SGD 1.618	1	0	1	0,00
	08.2024	SGD 1.616	\$ 1.193	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	TRY 660	19	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 1.964	AUD 2.945	4	0	4	0,00
	09.2024	COP 12.221.030	\$ 2.930	16	0	16	0,00
	09.2024	TWD 49.115	1.526	9	0	9	0,00
	05.2029	KWD 4.233	14.553	419	0	419	0,01
BRC	07.2024	THB 50	1	0	0	0	0,00
	07.2024	TRY 23.964	709	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	\$ 1.563	BRL 8.524	0	(28)	(28)	0,00
	07.2024	1.484	CHF 1.317	0	(18)	(18)	0,00
	07.2024	1.849	NOK 19.456	0	(22)	(22)	0,00
	07.2024	14.338	TRY 497.462	614	0	614	0,02
	08.2024	27.136	944.960	261	0	261	0,01
	09.2024	MXN 265.541	\$ 14.158	0	(190)	(190)	(0,01)
	09.2024	\$ 3.026	TRY 109.433	57	0	57	0,00
	11.2024	294	11.619	15	0	15	0,00
CBK	07.2024	BRL 188.832	\$ 34.654	658	0	658	0,02
	07.2024	CHF 967	1.062	0	(14)	(14)	0,00
	07.2024	€ 15.743	17.051	178	0	178	0,01
	07.2024	MXN 125.750	6.964	101	0	101	0,00
	07.2024	SEK 34.088	3.211	0	(8)	(8)	0,00
	07.2024	THB 124.797	3.410	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 2.052	PHP 120.324	7	0	7	0,00
	07.2024	304	PLN 1.217	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	2.087	SEK 21.820	0	(27)	(27)	0,00
	07.2024	562	TRY 18.955	3	0	3	0,00
	07.2024	35.082	ZAR 646.059	264	(10)	254	0,01
	07.2024	ZAR 1.613	\$ 88	0	0	0	0,00
	08.2024	PEN 3.474	920	13	0	13	0,00
	08.2024	\$ 34.654	BRL 189.466	0	(667)	(667)	(0,02)
	09.2024	MXN 1.094	\$ 58	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	PEN 36.362	9.744	252	0	252	0,01
	09.2024	TWD 18.476	573	3	0	3	0,00
	09.2024	\$ 31.905	INR 2.667.335	25	(13)	12	0,00
	11.2024	EGP 145.846	\$ 2.924	77	0	77	0,00
	02.2025	215.131	4.210	146	0	146	0,01
	05.2025	61.717	1.175	44	0	44	0,00
	06.2025	112.705	2.110	63	0	63	0,00
DUB	07.2024	KRW 204.099	148	0	0	0	0,00
	07.2024	MYR 2.440	518	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2.032	CLP 1.879.420	0	(41)	(41)	0,00
	07.2024	966	EGP 46.212	0	(7)	(7)	0,00
	08.2024	5.474	BRL 28.176	0	(420)	(420)	(0,02)
	03.2025	213	TRY 10.122	26	0	26	0,00
FAR	07.2024	€ 298.957	\$ 325.611	5.203	0	5.203	0,18
	07.2024	\$ 1.974	AUD 2.963	5	0	5	0,00
	07.2024	2.709	NZD 4.442	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	NZD 4.442	\$ 2.709	2	0	2	0,00
GLM	07.2024	CAD 1.998	1.462	2	0	2	0,00
	07.2024	€ 5.654	6.121	62	0	62	0,00
	07.2024	MXN 15.990	861	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	MYR 21	4	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 222	EGP 10.632	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	304	TRY 10.375	8	0	8	0,00
	07.2024	ZAR 348.433	\$ 19.045	0	(13)	(13)	0,00
	08.2024	DOP 732.505	12.313	1	(39)	(38)	0,00
	08.2024	\$ 2.597	TRY 89.613	16	0	16	0,00
	09.2024	DOP 477.015	\$ 7.961	0	(68)	(68)	0,00
	09.2024	MXN 869.673	48.600	1.607	0	1.607	0,05
	09.2024	\$ 1.363	TRY 51.359	93	0	93	0,00
	12.2024	2.110	EGP 107.083	0	(45)	(45)	0,00
	03.2025	242	TRY 11.590	31	0	31	0,00
	06.2025	EGP 112.780	\$ 2.110	62	0	62	0,00
IND	07.2024	\$ 1.508	¥ 236.300	0	(39)	(39)	0,00
JPM	07.2024	HUF 733.765	\$ 1.984	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	INR 418.577	5.000	0	(20)	(20)	0,00
	07.2024	KRW 251.887	183	0	0	0	0,00
	07.2024	PLN 7.137	1.788	13	0	13	0,00
	07.2024	SGD 1.618	1.202	8	0	8	0,00
	07.2024	\$ 1.468	AUD 2.202	3	0	3	0,00
	07.2024	1.804	BRL 9.556	0	(84)	(84)	0,00
	07.2024	11.020	CHF 9.889	0	(15)	(15)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
	07.2024	\$	CZK	7.977	\$	(3)	0,00			
	07.2024		IDR	28.494.252		(15)	0,00			
	07.2024	ZAR	\$	35.853		(247)	(0,01)			
	08.2024	AUD		1.469		(3)	0,00			
	08.2024	CHF		11.020	14	14	0,00			
	08.2024	TRY		324		(1)	0,00			
	08.2024	\$	TRY	414.114	148	148	0,01			
	09.2024	TWD	\$	976	5	5	0,00			
	09.2024	\$	EGP	37.396		(1)	0,00			
	09.2024		INR	363.825	11	11	0,00			
	02.2025	EGP	\$	4.210	144	144	0,01			
	03.2025	\$	TRY	8.943	26	26	0,00			
MBC	07.2024	CAD	\$	13.933	69	69	0,00			
	07.2024	CZK		6.624	84	84	0,00			
	07.2024	€		3.935	34	34	0,00			
	07.2024	HUF		1.775	0	(19)	0,00			
	07.2024	INR		15.322	0	(63)	0,00			
	07.2024	NOK		2.726	0	(1)	0,00			
	07.2024	\$	AUD	2.188	6	6	0,00			
	07.2024		CAD	20.212	9	9	0,00			
	07.2024		€	15.340	0	(255)	(0,01)			
	07.2024		£	2.112	0	(7)	0,00			
	07.2024		SEK	15.985	0	(9)	0,00			
	08.2024	CAD	\$	14.762	0	(9)	0,00			
	08.2024	\$	NOK	29.016	1	1	0,00			
	09.2024	TWD	\$	24	0	0	0,00			
MYI	07.2024	€		2.207	1	1	0,00			
	07.2024	£		102	0	0	0,00			
	07.2024	INR		5.311	0	(21)	0,00			
	07.2024	NOK		778	0	(1)	0,00			
	07.2024	SEK		352	1	1	0,00			
	07.2024	\$	BRL	170.700	0	(2.314)	(0,08)			
	07.2024		€	257	0	0	0,00			
	07.2024		£	1.616	0	(1)	0,00			
	08.2024		NOK	8.286	1	1	0,00			
	08.2024		SEK	3.716	0	(1)	0,00			
	09.2024	TWD	\$	390	3	3	0,00			
	09.2024	\$	INR	242.851	2	2	0,00			
RBC	07.2024		£	11.119	0	(45)	0,00			
	08.2024	£	\$	14.102	44	44	0,00			
RYL	07.2024	AUD		1.472	0	(2)	0,00			
	07.2024	€		19.045	0	(35)	0,00			
	07.2024	\$	£	1.781	0	(28)	0,00			
	07.2024		NZD	2.865	0	(27)	0,00			
SCX	07.2024	KRW	\$	139	1	1	0,00			
	07.2024	MXN		24.101	0	(282)	(0,01)			
	07.2024	\$	€	359.040	125	(10)	0,00			
	07.2024		£	95	0	0	0,00			
	07.2024		KRW	2.574.532	8	8	0,00			
	08.2024	€	\$	381.261	0	(120)	0,00			
	08.2024	PEN		1.067	14	14	0,00			
	09.2024	AED		3.249	0	0	0,00			
	09.2024	PHP		4.396	0	(14)	0,00			
	09.2024	TWD		590	3	3	0,00			
	09.2024	\$	EGP	35.321	0	(6)	0,00			
	09.2024		INR	1.484.941	26	26	0,00			
	12.2024		EGP	53.592	0	(22)	0,00			
SOG	09.2024			80.157	0	(14)	0,00			
SSB	07.2024	€	\$	16.642	200	200	0,01			
	07.2024	IDR		1.465	6	6	0,00			
	07.2024	PLN		1.431	0	(7)	0,00			
	07.2024	\$	IDR	24.018.227	4	4	0,00			
	09.2024	COP	\$	2.049	0	(6)	0,00			
TOR	07.2024	CHF		50	0	0	0,00			
	07.2024	\$	NZD	3.367	0	(11)	0,00			
	08.2024	NZD	\$	2.062	11	11	0,00			
	08.2024	\$	COP	9.070.242	0	(88)	0,00			
UAG	07.2024	CHF	\$	11.286	0	(64)	0,00			
	07.2024	HUF		2	0	0	0,00			
	07.2024	ILS		785	12	12	0,00			
	08.2024	\$	€	15.549	38	38	0,00			
				\$	12.198	\$	(6.061)	\$	6.137	0,21

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 184.546	CHF 166.011	\$ 187	\$ 0	\$ 187	0,01
BRC	07.2024	CHF 189	\$ 211	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 634	CHF 564	0	(6)	(6)	0,00
CBK	07.2024	16.243	14.782	207	0	207	0,01
GLM	07.2024	151.340	136.271	308	0	308	0,01
MBC	07.2024	189.249	170.400	427	(48)	379	0,01
	08.2024	175	157	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	CHF 458	\$ 511	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 606	CHF 542	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2024	6.229	5.596	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 1.132	\$ (58)	\$ 1.074	0,04

Zum 30. Juni 2024 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 6.474	\$ 7.056	\$ 118	\$ 0	\$ 118	0,00
	07.2024	\$ 431.487	€ 397.428	0	(5.544)	(5.544)	(0,19)
BPS	07.2024	€ 353.774	\$ 378.415	16	(758)	(742)	(0,03)
	07.2024	\$ 365.336	€ 337.462	0	(3.661)	(3.661)	(0,13)
	08.2024	377.741	352.646	759	0	759	0,03
BRC	07.2024	€ 2.998	\$ 3.208	0	(5)	(5)	0,00
CBK	07.2024	9.037	9.839	154	0	154	0,01
FAR	07.2024	\$ 419.623	€ 385.274	0	(6.706)	(6.706)	(0,23)
GLM	07.2024	€ 3.677	\$ 3.980	40	0	40	0,00
JPM	07.2024	318	341	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2024	367.179	392.656	23	(892)	(869)	(0,03)
	08.2024	\$ 389.732	€ 363.942	893	0	893	0,03
MYI	07.2024	€ 12.862	\$ 13.760	0	(25)	(25)	0,00
RBC	07.2024	15.456	16.788	223	0	223	0,01
SCX	07.2024	364.435	390.455	0	(128)	(128)	0,00
	08.2024	\$ 391.021	€ 364.427	123	0	123	0,01
SSB	07.2024	17.406	16.046	0	(209)	(209)	(0,01)
UAG	08.2024	€ 10.846	\$ 11.614	0	(26)	(26)	0,00
				\$ 2.349	\$ (17.955)	\$ (15.606)	(0,54)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 35.125	\$ 44.417	\$ 15	\$ 0	\$ 15	0,00
	07.2024	\$ 83.958	£ 65.883	0	(676)	(676)	(0,02)
	08.2024	44.359	35.074	0	(14)	(14)	0,00
BRC	07.2024	44	35	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2024	£ 79	\$ 101	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 2.971	£ 2.336	0	(18)	(18)	0,00
	08.2024	£ 24	\$ 30	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	\$ 44.017	£ 34.496	0	(410)	(410)	(0,02)
MBC	07.2024	£ 34.649	\$ 43.840	39	0	39	0,00
	07.2024	\$ 199	£ 157	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	43.681	34.519	0	(37)	(37)	0,00
				\$ 55	\$ (1.157)	\$ (1.102)	(0,04)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Investor NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2024	\$ 149	NOK 1.572	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
CBK	07.2024	149	1.566	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2024	NOK 1.235	\$ 116	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 5	NOK 53	0	0	0	0,00
	08.2024	116	1.234	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	NOK 1.577	\$ 148	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 135	NOK 1.427	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	148	1.576	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Investor SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SEK 12	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 2	SEK 23	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	SEK 11	\$ 1	0	0	0	0,00
BRC	07.2024	9.606	906	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 906	SEK 9.591	1	0	1	0,00
CBK	07.2024	SEK 198	\$ 19	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 907	SEK 9.632	2	0	2	0,00
DUB	07.2024	SEK 8.522	\$ 805	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 805	SEK 8.509	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	SEK 45	\$ 4	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 873	SEK 9.168	0	(7)	(7)	0,00
	08.2024	22	229	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	SEK 9.559	\$ 905	2	0	2	0,00
	08.2024	\$ 905	SEK 9.544	0	(2)	(2)	0,00
RYL	07.2024	SEK 52	\$ 5	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 873	SEK 9.176	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07.2024	SEK 17	\$ 2	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	\$ 2	SEK 25	0	0	0	0,00
				\$ 5	\$ (16)	\$ (11)	0,00
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						\$ (12.891)	(0,45)
<b>Summe Anlagen</b>						\$ 3.194.490	110,78
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						\$ (310.865)	(10,78)
<b>Nettovermögen</b>						\$ 2.883.625	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,51 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Entwicklungsbank für das südliche Afrika	8,600 %	21.10.2024	07.10.2021	\$ 17.010	\$ 13.787	0,48

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 329.621 USD (31. Dezember 2023: 228.436 USD) und Barmittel in Höhe von 130 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurde zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 55.830 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 1.394 USD (31. Dezember 2023: 301 USD) und Barmittel in Höhe von 664 USD (31. Dezember 2023: 6.296 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 430 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 25.401 USD (31. Dezember 2023: 19.878 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 17.180 USD (31. Dezember 2023: 3.680 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.136.848	\$ 54.777	\$ 3.191.625
Pensionsgeschäfte	0	11.797	0	11.797
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(854)	(8.078)	0	(8.932)
<b>Summen</b>	\$ (854)	\$ 3.140.567	\$ 54.777	\$ 3.194.490

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.794.082	\$ 39.430	\$ 2.833.512
Pensionsgeschäfte	0	13.694	0	13.694
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(3.078)	27.272	0	24.194
Einlagen bei Kreditinstituten	0	45.181	0	45.181
<b>Summen</b>	<b>\$ (3.078)</b>	<b>\$ 2.880.229</b>	<b>\$ 39.430</b>	<b>\$ 2.916.581</b>

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	3,830 %	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (4.682)	\$ (5.028)	(0,17)
	4,300	05.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (1.381)	(1.395)	(0,05)
	5,000	15.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.406)	(2.451)	(0,09)
	5,400	10.11.2023	TBD <sup>(1)</sup>	£ (3.224)	(4.217)	(0,15)
BRC	3,830	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (30.240)	(32.475)	(1,13)
	3,850	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(15.917)	(17.093)	(0,59)
	4,500	10.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (2.528)	(2.544)	(0,09)
	5,000	31.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(1.851)	(1.859)	(0,06)
GSC	5,150	27.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(316)	(322)	(0,01)
	5,250	23.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(9.763)	(9.861)	(0,34)
	3,750	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (3.874)	(4.160)	(0,14)
	5,300	14.06.2024	20.09.2024	\$ (5.702)	(5.717)	(0,20)
JML	5,550	14.06.2024	20.09.2024	(2.331)	(2.337)	(0,08)
	5,450	27.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(8.428)	(8.550)	(0,30)
MEI	4,000	05.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.918)	(2.946)	(0,10)
MYI	5,000	05.04.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(4.722)	(4.775)	(0,17)
NOM	4,000	07.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(5.370)	(5.403)	(0,19)
	4,750	04.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(1.406)	(1.427)	(0,05)
	5,200	04.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.263)	(2.302)	(0,08)
	5,300	04.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.547)	(2.557)	(0,09)
	5,300	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.238)	(2.244)	(0,08)
	5,300	13.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.210)	(2.215)	(0,08)
	5,320	27.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(6.456)	(6.575)	(0,23)
	5,500	30.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(38.811)	(39.001)	(1,35)
	5,500	31.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(41.718)	(41.916)	(1,45)
	5,550	27.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(22.839)	(22.853)	(0,79)
SCX	3,850	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (42.880)	(46.050)	(1,60)
	5,200	08.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (394)	(397)	(0,01)
	5,250	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(410)	(411)	(0,01)
	5,560	26.06.2024	03.07.2024	(44.579)	(44.613)	(1,55)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>				<b>\$ (323.694)</b>	<b>(11,23)</b>	

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 55	\$ 0	\$ 55	\$ 46	\$ 0	\$ 46
BOA	(5.134)	5.500	366	(842)	1.300	458
BPS	(5.025)	5.360	335	501	(3.470)	(2.969)
BRC	796	(580)	216	1.850	(2.610)	(760)
CBK	602	(300)	302	2.051	(2.440)	(389)
DUB	(891)	260	(631)	1.098	(740)	358
FAR	(1.498)	1.820	322	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	2.268	(2.820)	(552)	2.503	(2.430)	73
GST	(1.316)	1.300	(16)	(1.574)	1.570	(4)
IND	(39)	0	(39)	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	14	(360)	(346)	(871)	810	(61)
MBC	237	(730)	(493)	1.641	(3.320)	(1.679)
MYC	(307)	330	23	1.203	(1.190)	13
MYI	(2.339)	2.000	(339)	3.748	(4.290)	(542)
RBC	222	(260)	(38)	(1)	0	(1)
RYL	(98)	0	(98)	11	0	11
SCX	(284)	350	66	64	(310)	(246)
SOG	(14)	0	(14)	k. A.	k. A.	k. A.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
SSB	\$ (12)	\$ 0	\$ (12)	\$ 208	\$ (360)	\$ (152)
TOR	(88)	0	(88)	47	0	47
UAG	(40)	260	220	76	0	76

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	92,88	93,42
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	16,42	11,74
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,38	0,01
Pensionsgeschäfte	0,41	0,51
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,03	0,33
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,11	0,14
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,45)	0,44
Einlagenzertifikate	k. A.	1,68
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(11,23)	(7,97)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(2,10)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Argentinien	2,09	2,10
Armenien	k. A.	0,24
Bahamas	0,15	0,16
Bahrain	0,98	0,97
Benin	0,66	0,59
Bermuda	0,12	0,13
Brasilien	3,36	2,40
Bulgarien	k. A.	0,53
Cayman-Inseln	2,41	2,32
Chile	4,78	3,07
China	0,00	0,00
Kolumbien	2,78	3,17
Costa Rica	0,99	1,00
Zypern	0,25	0,26
Tschechische Republik	0,26	k. A.
Dominikanische Republik	3,73	4,46
Ecuador	1,85	1,87
Ägypten	2,58	2,63
El Salvador	1,14	0,87
Gabun	0,19	0,02
Georgien	0,33	0,37
Ghana	1,58	1,29
Guernsey, Kanalinseln	0,09	0,12
Hongkong	1,30	1,70
Ungarn	3,77	3,71
Indien	1,42	1,43
Indonesien	2,28	2,70
International	0,40	0,20
Irland	0,68	0,02
Italien	0,08	k. A.
Elfenbeinküste	2,30	0,95
Jamaika	0,13	0,15
Jersey, Kanalinseln	k. A.	0,46
Jordanien	0,61	0,68
Kasachstan	k. A.	0,93
Kenia	0,69	0,39
Lettland	0,24	k. A.
Luxemburg	1,29	0,52
Mazedonien	0,38	0,42
Malaysia	0,11	0,49
Mauritius	k. A.	0,35
Mexiko	6,74	4,83
Mongolei	0,29	0,31
Marokko	0,59	0,66
Multinational	0,02	0,02
Namibia	k. A.	0,08
Niederlande	1,25	1,24
Oman	1,44	2,80
Pakistan	0,49	0,44
Panama	2,63	3,08
Paraguay	1,13	0,93
Peru	2,43	1,31
Philippinen	1,70	1,39
Polen	1,84	1,26

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Katar	3,59	1,37
Rumänien	4,16	3,48
Russland	0,01	0,01
Senegal	0,78	0,59
Serbien	2,17	1,63
Singapur	0,60	0,40
Slowenien	k. A.	0,34
Südafrika	1,71	2,81
Südkorea	6,20	5,62
Spanien	k. A.	0,35
Sri Lanka	1,14	0,98
Supranational	0,72	1,22
Schweiz	k. A.	0,43
Tansania	0,51	0,94
Trinidad und Tobago	0,15	0,17
Tunesien	0,57	0,62
Türkei	3,29	2,56
Ukraine	1,44	0,99
Vereinigte Arabische Emirate	4,02	3,03
Großbritannien	0,59	1,17
USA	9,56	10,31
Uruguay	0,90	1,89
Usbekistan	0,65	0,11
Vietnam	k. A.	0,04
Jungfernseln (Britisch)	0,21	0,23
Sambia	0,01	0,01
Kurzfristige Instrumente	1,15	1,85
Pensionsgeschäfte	0,41	0,51
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,03	0,33
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,11	0,14
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,07)	(0,09)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,05)	0,07
Devisenterminkontrakte	0,21	(0,25)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,54)	0,71
Einlagenzertifikate	k. A.	1,68
Sonstige Aktiva und Passiva	(10,78)	(8,27)
Nettovermögen	100,00	100,00







**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 540	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.01.2026	\$ (551)	\$ 540	\$ 540	0,36
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (551)</b>	<b>\$ 540</b>	<b>\$ 540</b>	<b>0,36</b>

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	20	\$ (37)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	91	31	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	1	0	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	15	7	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	7	(2)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	31	(19)	(0,01)
				<b>\$ (20)</b>	<b>(0,01)</b>
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (20)</b>	<b>(0,01)</b>

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2029	€ 2.700	\$ 11	0,01

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000 %	18.09.2029	£ 2.700	\$ (35)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	21.06.2047	\$ 1.700	304	0,21
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2025	16.600	61	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	300	4	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	8.300	58	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,131	04.01.2027	BRL 6.500	(46)	(0,03)
Zahlung <sup>(3)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	18.12.2025	CAD 21.800	(16)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	18.09.2029	CNY 2.580	(3)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	20.03.2029	AUD 2.200	(18)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK 12.800	8	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	€ 3.100	(44)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,207	19.06.2028	MXN 6.900	(20)	(0,02)
					<b>\$ 253</b>	<b>0,17</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 264</b>	<b>0,18</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.06.2029	\$ 1.400	\$ (41)	\$ 1	\$ (40)	(0,03)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	America Movil S.A.B. de C.V.	1,000 %	20.12.2025	\$ 1.200	\$ (30)	\$ 39	\$ 9	0,01
GST	Israel Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	0	0	0	0,00
	Israel Government International Bond	1,000	20.12.2025	700	1	(1)	0	0,00
	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2026	100	0	0	0	0,00
JPM	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.06.2029	1.500	8	(1)	7	0,00
	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	400	(9)	10	1	0,00
					\$ (30)	\$ 47	\$ 17	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	\$ 229	PHP 13.460	\$ (1)	\$ (2)	\$ (3)	0,00
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	15	890	0	0	0	0,00
						\$ (1)	\$ (2)	\$ (3)	0,00

#### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	18.09.2029	MYR 3.200	\$ 6	\$ (2)	\$ 4	0,00

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	\$ 94	NZD 153	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	NZD 153	\$ 94	0	0	0	0,00
BOA	07.2024	HKD 712	91	0	0	0	0,00
	07.2024	HUF 67.349	183	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 18.795	14	0	0	0	0,00
	07.2024	PLN 311	77	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 796	€ 731	0	(14)	(14)	(0,01)
	08.2024	13	TRY 449	0	0	0	0,00
	09.2024	CLP 86.058	\$ 92	1	0	1	0,00
BPS	07.2024	AUD 108	72	0	0	0	0,00
	07.2024	CAD 990	725	1	0	1	0,00
	07.2024	KRW 18.655	14	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 44	SGD 60	0	0	0	0,00
	08.2024	SGD 60	\$ 44	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	\$ 72	AUD 108	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	9	TRY 310	0	0	0	0,00
	09.2024	CNH 4.833	\$ 674	9	0	9	0,01
	09.2024	COP 700.728	168	1	0	1	0,00
	09.2024	TWD 2.496	78	0	0	0	0,00
	10.2024	CNH 1.666	233	3	0	3	0,00
BRC	07.2024	\$ 94	CHF 83	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	42	NOK 437	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	408	TRY 14.389	28	0	28	0,02
	08.2024	11	401	0	0	0	0,00
	09.2024	MXN 11.100	\$ 592	0	(7)	(7)	(0,01)
	11.2024	\$ 13	TRY 499	1	0	1	0,00
CBK	07.2024	CHF 51	\$ 56	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	€ 748	810	8	0	8	0,01
	07.2024	£ 582	740	5	0	5	0,00
	07.2024	PEN 2.585	684	9	0	9	0,01
	07.2024	SEK 1.764	166	0	0	0	0,00
	07.2024	THB 8.051	220	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 239	BRL 1.303	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	339	PEN 1.293	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	106	PHP 6.216	0	0	0	0,00
	07.2024	10	PLN 40	0	0	0	0,00
	07.2024	108	SEK 1.130	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	BRL 1.307	\$ 239	5	0	5	0,00
	09.2024	MXN 2.543	135	0	(2)	(2)	0,00
	09.2024	PEN 346	92	2	0	2	0,00
	09.2024	TWD 952	30	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 424	INR 35.440	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	BRL 886	\$ 169	11	0	11	0,01
	07.2024	KRW 10.196	7	0	0	0	0,00
	07.2024	MYR 1.826	387	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 73	CLP 67.777	0	(1)	(1)	0,00
FAR	07.2024	€ 8.355	\$ 9.100	146	0	146	0,10
	07.2024	NZD 671	413	5	0	5	0,00
	07.2024	\$ 180	NZD 295	0	0	0	0,00
GLM	08.2024	NZD 295	\$ 180	0	0	0	0,00
	07.2024	BRL 416	77	2	0	2	0,00
	07.2024	DOP 29.609	502	1	0	1	0,00
	07.2024	€ 172	186	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 249	MYR 1.172	0	0	0	0,00
	07.2024	ZAR 6.224	\$ 340	0	0	0	0,00
	08.2024	DOP 17.302	291	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 348	BRL 1.785	0	(29)	(29)	(0,02)
	08.2024	43	COP 185.846	2	0	2	0,00
	09.2024	MXN 2.952	\$ 166	6	0	6	0,00
	09.2024	\$ 36	TRY 1.424	5	0	5	0,00
JPM	07.2024	CAD 45	\$ 33	0	0	0	0,00
	07.2024	CNY 8.984	1.260	15	0	15	0,01
	07.2024	HUF 35.776	97	0	0	0	0,00
	07.2024	PLN 367	92	1	0	1	0,00
	07.2024	SGD 60	44	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 569	CHF 510	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	23	CNY 164	0	0	0	0,00
	07.2024	90	IDR 1.462.035	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	ZAR 11.789	\$ 640	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	CHF 508	569	1	0	1	0,00
	08.2024	\$ 1.260	CNY 8.990	0	0	0	0,00
	08.2024	88	COP 380.578	3	0	3	0,00
	08.2024	36	TRY 1.231	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 1.619	\$ 50	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 58	INR 4.834	0	0	0	0,00
	10.2024	CNH 2.870	\$ 401	5	0	5	0,00
MBC	07.2024	CZK 6.809	295	4	0	4	0,00
	07.2024	HUF 25.023	67	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	INR 20.789	248	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	NOK 1.075	101	0	0	0	0,00
	07.2024	PLN 489	122	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 164	AUD 246	1	0	1	0,00
	07.2024	756	CAD 1.036	0	0	0	0,00
	07.2024	738	£ 582	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	78	SEK 825	0	0	0	0,00
	08.2024	CAD 1.035	\$ 756	0	0	0	0,00
	08.2024	£ 454	574	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 101	NOK 1.074	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	INR 42.827	\$ 512	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	NOK 307	29	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 191	18	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 135	€ 126	0	0	0	0,00
	08.2024	29	NOK 307	0	0	0	0,00
	08.2024	18	SEK 191	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 644	\$ 20	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 30	INR 2.504	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	AUD 138	\$ 92	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SCX	07.2024	€ 484	\$ 518	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2024	IDR 1.683.785		102	(1)	(1)	0,00
	07.2024	KRW 9.467		7	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.239	CNY 8.814	0	(18)	(18)	(0,01)
	07.2024	9.673	€ 9.028	3	0	3	0,00
	07.2024	95	KRW 131.354	0	0	0	0,00
	07.2024	1	MXN 12	0	0	0	0,00
	07.2024	89	NOK 945	0	0	0	0,00
	07.2024	91	ZAR 1.682	1	0	1	0,00
	08.2024	€ 9.028	\$ 9.687	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	\$ 40	COP 173.120	1	0	1	0,00
	09.2024	CNH 1.983	\$ 276	3	0	3	0,00
	09.2024	PHP 13.748	234	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	TWD 936	29	0	0	0	0,00
	SSB	09.2024	\$ 262	INR 21.904	0	0	0
07.2024		107	IDR 1.755.431	0	0	0	0,00
TOR	09.2024	COP 449.999	\$ 107	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 137	NZD 223	0	(1)	(1)	0,00
UAG	08.2024	NZD 223	\$ 137	1	0	1	0,00
	07.2024	CHF 542	600	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	ILS 258	70	1	0	1	0,00
	08.2024	€ 74	79	0	0	0	0,00
				\$ 293	\$ (106)	\$ 187	0,12

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 2.679	CHF 2.410	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
CBK	07.2024	CHF 41	\$ 45	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 270	CHF 246	3	0	3	0,00
GLM	07.2024	27	25	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	CHF 2.871	\$ 3.199	4	0	4	0,00
	08.2024	\$ 3.199	CHF 2.860	0	(4)	(4)	0,00
MBC	07.2024	CHF 45	\$ 51	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	\$ 88	CHF 79	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	3.152	2.847	17	0	17	0,01
UAG	07.2024	CHF 2.856	\$ 3.183	5	0	5	0,01
	07.2024	\$ 3.116	CHF 2.816	18	0	18	0,01
	08.2024	3.183	2.845	0	(5)	(5)	0,00
				\$ 50	\$ (10)	\$ 40	0,03

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 1	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 42.561	€ 39.202	0	(547)	(547)	(0,35)
BPS	07.2024	€ 36.671	\$ 39.224	0	(79)	(79)	(0,05)
	07.2024	\$ 36.216	€ 33.453	0	(363)	(363)	(0,24)
	08.2024	39.225	36.619	79	0	79	0,05
CBK	07.2024	€ 48	\$ 52	1	0	1	0,00
FAR	07.2024	\$ 41.323	€ 37.940	0	(660)	(660)	(0,44)
GLM	07.2024	€ 40	\$ 44	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	5	6	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	37.505	40.104	0	(92)	(92)	(0,06)
	08.2024	\$ 40.162	€ 37.505	92	0	92	0,06
RYL	07.2024	€ 10	\$ 11	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	37.483	40.159	0	(13)	(13)	(0,01)
	08.2024	\$ 40.217	€ 37.482	12	0	12	0,01
SSB	07.2024	1.268	1.169	0	(15)	(15)	(0,01)
UAG	08.2024	€ 5	\$ 5	0	0	0	0,00
				\$ 184	\$ (1.769)	\$ (1.585)	(1,04)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (1.380) (0,91)

Summe Anlagen

\$ 163.984 108,73

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (13.160) (8,73)

Nettovermögen

\$ 150.824 100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,79 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 39	\$ 39	0,02
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	1.498	1.214	0,81
Invepar Holdings LLC 1,000 % fällig am 31.12.2049	16.11.2018	0	0	0,00
OAS S.A. - Exp. 16.05.2039	16.11.2018	5	0	0,00
		<u>\$ 1.542</u>	<u>\$ 1.253</u>	<u>0,83</u>

(j) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 7.949 USD (31. Dezember 2023: 177 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 916 USD (31. Dezember 2023: 1.731 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.070 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 156.592	\$ 3.285	\$ 159.877
Investmentfonds	4.703	0	0	4.703
Pensionsgeschäfte	0	540	0	540
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(37)	(1.099)	0	(1.136)
Summen	\$ 4.666	\$ 156.033	\$ 3.285	\$ 163.984

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 296	\$ 145.730	\$ 2.249	\$ 148.275
Investmentfonds	6.763	100	0	6.863
Pensionsgeschäfte	0	993	0	993
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	4	1.007	0	1.011
Einlagen bei Kreditinstituten	0	2.753	0	2.753
Summen	\$ 7.063	\$ 150.583	\$ 2.249	\$ 159.895

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BPS	1,250 %	27.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (363)	\$ (389)	(0,26)
	3,800	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(717)	(770)	(0,51)
	5,000	18.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (1.024)	(1.039)	(0,69)
	5,150	18.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(545)	(553)	(0,37)
	5,200	18.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(1.442)	(1.464)	(0,97)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften		% des Nettovermögens
					\$	\$	
	5,200 %	20.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (867)	\$ (872)	(0,58)	
	5,200	29.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(547)	(550)	(0,36)	
BRC	3,850	28.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (738)	(791)	(0,53)	
	5,150	18.03.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (678)	(689)	(0,46)	
MEI	3,850	28.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (398)	(427)	(0,28)	
	3,900	28.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(371)	(398)	(0,26)	
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (7.942)</b>	<b>(5,27)</b>	

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ (4)	\$ 0	\$ (4)
BOA	(557)	620	63	(103)	0	(103)
BPS	(345)	430	85	71	0	71
BRC	(11)	0	(11)	139	(340)	(201)
CBK	20	0	20	107	0	107
DUB	10	0	10	5	0	5
FAR	(509)	(320)	(829)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(15)	0	(15)	107	0	107
GST	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
JPM	27	0	27	(10)	0	(10)
MBC	1	0	1	(87)	0	(87)
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
MYI	(2)	20	18	330	(540)	(210)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(146)	0	(146)
RYL	(1)	0	(1)	(1)	0	(1)
SCX	(16)	0	(16)	(37)	0	(37)
SSB	(15)	0	(15)	(1)	0	(1)
TOR	17	0	17	(3)	0	(3)
UAG	16	0	16	172	(390)	(218)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	78,27	77,71
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	27,15	16,30
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,57	k. A.
Investmentfonds	3,12	4,35
Pensionsgeschäfte	0,36	0,63
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	(0,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,18	0,33
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,91)	0,35
Einlagenzertifikate	k. A.	1,75
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(5,27)	(0,11)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	2,36	1,79
Unternehmensanleihen und Wechsel	89,95	75,63
Wandelanleihen & Wechsel	0,48	0,26
US-Regierungsbehörden	2,23	2,18
US-Schatzobligationen	4,12	4,19
Non-Agency-MBS	0,57	0,60
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,25	0,89
Staatsemissionen	4,41	5,26
Stammaktien	0,02	0,26
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	1,60	2,95
Investmentfonds	3,12	4,35
Pensionsgeschäfte	0,36	0,63
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	(0,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,01	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,10
Zinsswaps	0,17	0,20

<b>Anlagen zum Marktwert</b>	<b>30. Jun. 2024 (%)</b>	<b>31. Dez. 2023 (%)</b>
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,03)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,01)
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,12	(0,26)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,01)	0,62
Einlagezertifikate	k. A.	1,75
Sonstige Aktiva und Passiva	(8,73)	(1,38)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>ANGOLA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Angola Government International Bond			
8,750 % fällig am 14.04.2032	\$ 3.700	\$ 3.284	1,03
<b>BENIN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Benin Government International Bond			
7,960 % fällig am 13.02.2038	600	559	0,18
<b>BRASILIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco BTG Pactual S.A.			
8,300 % fällig am 15.08.2024	BRL 10.000	1.796	0,57
Banco do Brasil S.A.			
8,500 % fällig am 29.07.2026	MXN 29.000	1.502	0,47
Oi S.A.			
0,000 % fällig am 25.02.2035	BRL 350	7	0,00
Vale Overseas Ltd.			
6,400 % fällig am 28.06.2054	\$ 3.200	3.167	0,99
Vale S.A.			
0,000% (f)	BRL 46.580	2.898	0,91
		9.370	2,94
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Brazil Government International Bond			
6,125 % fällig am 22.01.2032	\$ 1.600	1.582	0,49
Summe Brasilien		10.952	3,43
<b>KAMERUN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Republic of Cameroon Government International Bond			
5,950 % fällig am 07.07.2032	€ 800	667	0,21
<b>CAYMAN INSELN</b>			
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
Sunac China Holdings Ltd.			
1,000 % fällig am 30.09.2032	\$ 38	3	0,00
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Gaci First Investment Co.			
5,375 % fällig am 29.01.2054	3.400	3.021	0,95
Kaisa Group Holdings Ltd.			
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	3.400	123	0,04
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	700	24	0,01
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	200	7	0,00
Peru Payroll Deduction Finance Ltd.			
0,000 % fällig am 01.11.2029 (c)	1.252	1.030	0,32
Poinsettia Finance Ltd.			
6,625 % fällig am 17.06.2031	738	636	0,20
Red Dorsal Finance Ltd.			
5,875 % fällig am 12.10.2031	338	330	0,11
Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % Bargeld oder 6,000 % PIK)			
5,000 % fällig am 30.09.2026 (b)	22	3	0,00
Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK)			
5,250 % fällig am 30.09.2027 (b)	22	2	0,00
Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK)			
5,500 % fällig am 30.09.2027 (b)	45	4	0,00
Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % bar oder 6,750 % PIK)			
5,750 % fällig am 30.09.2028 (b)	68	6	0,00
Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK)			
6,000 % fällig am 30.09.2029 (b)	68	5	0,00
Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK)			
6,250 % fällig am 30.09.2030 (b)	32	2	0,00
		5.193	1,63
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
KSA Sukuk Ltd.			
5,250 % fällig am 04.06.2034	2.400	2.403	0,75
Summe Cayman Inseln		7.599	2,38

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>CHILE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco del Estado de Chile			
7,950 % fällig am 02.05.2029 (f)(h)	\$ 1.100	\$ 1.137	0,36
Engie Energia Chile S.A.			
6,375 % fällig am 17.04.2034	1.600	1.622	0,51
		2.759	0,87
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos			
5,800 % fällig am 01.10.2034	CLP 5.300.000	5.463	1,71
6,000 % fällig am 01.04.2033	4.070.000	4.269	1,34
		9.732	3,05
Summe Chile		12.491	3,92
<b>CHINA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Yango Justice International Ltd.			
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^	\$ 1.100	6	0,00
<b>KOLUMBIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Ecopetrol S.A.			
5,875 % fällig am 28.05.2045	4.000	2.870	0,90
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Colombia Government International Bond			
8,000 % fällig am 14.11.2035	500	515	0,16
8,750 % fällig am 14.11.2053	1.000	1.054	0,33
		1.569	0,49
Summe Kolumbien		4.439	1,39
<b>KONGO</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Congolese Government International Bond			
6,000 % fällig am 30.06.2029	545	458	0,14
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
EP Infrastructure A/S			
1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 1.400	1.212	0,38
EPH Financing International A/S			
5,875 % fällig am 30.11.2029	1.100	1.183	0,37
6,651 % fällig am 13.11.2028	700	779	0,25
Summe Tschechische Republik		3.174	1,00
<b>DÄNEMARK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2052	0	0	0,00
Realkredit Danmark A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00
TDC Net A/S			
6,500 % fällig am 01.06.2031	€ 1.300	1.482	0,46
Summe Dänemark		1.482	0,46
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik			
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP 84.300	1.436	0,45
13,000 % fällig am 05.12.2025	244.600	4.222	1,32
Dominican Republic Government International Bond			
6,600 % fällig am 01.06.2036 (a)	\$ 2.500	2.494	0,78
10,750 % fällig am 01.06.2036 (a)	DOP 465.400	8.052	2,53

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
11,250 % fällig am 15.09.2035	DOP 45.300	\$ 810	0,25
13,625 % fällig am 03.02.2033	19.200	385	0,12
13,625 % fällig am 10.02.2034	49.700	1.018	0,32
Summe Dominikanische Republik		18.417	5,77
<b>ECUADOR</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ecuador Government International Bond			
2,500 % fällig am 31.07.2040	\$ 90	41	0,02
3,500 % fällig am 31.07.2035	580	291	0,09
6,000 % fällig am 31.07.2030	5.730	3.644	1,14
Summe Ecuador		3.976	1,25
<b>ÄGYPTEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Egypt Government International Bond			
7,903 % fällig am 21.02.2048	3.100	2.186	0,69
8,750 % fällig am 30.09.2051	3.100	2.342	0,73
Summe Ägypten		4.528	1,42
<b>EL SALVADOR</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
El Salvador Government International Bond			
0,250 % fällig am 17.04.2030	1.600	49	0,01
9,250 % fällig am 17.04.2030	1.600	1.426	0,45
Summe El Salvador		1.475	0,46
<b>GHANA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ghana Government International Bond			
8,625 % fällig am 07.04.2034 ^	1.600	821	0,26
<b>GUATEMALA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Guatemala Government International Bond			
6,600 % fällig am 13.06.2036	900	909	0,29
<b>HONGKONG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Fortune Star BVI Ltd.			
3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 1.900	1.854	0,58
<b>UNGARN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Hungary Government International Bond			
5,500 % fällig am 26.03.2036	\$ 1.700	1.635	0,51
<b>INDIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
IRB Infrastructure Developers Ltd.			
7,110 % fällig am 11.03.2032	2.100	2.100	0,66
JSW Hydro Energy Ltd.			
4,125 % fällig am 18.05.2031	532	473	0,15
Summe Indien		2.573	0,81
<b>INDONESIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
LLPL Capital Pte. Ltd.			
6,875 % fällig am 04.02.2039	1.471	1.483	0,47
<b>IRLAND</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Black Diamond CLO DAC			
4,757 % fällig am 20.01.2032	€ 248	266	0,08
Cairn CLO DAC			
4,686 % fällig am 15.10.2031	799	853	0,27
Carlyle Euro CLO DAC			
4,606 % fällig am 15.01.2031	1.218	1.307	0,41
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.			
4,578 % fällig am 15.11.2031	1.206	1.286	0,40
Oak Hill European Credit Partners DAC			
4,637 % fällig am 20.10.2031	434	464	0,15
		4.176	1,31

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC 5,950 % fällig am 15.04.2030 <sup>^(h)</sup> \$	900	\$ 54	0,02
Iridium Capital PLC 9,250 % fällig am 18.06.2029 €	3.200	3.460	1,08
Sovcombank Via SovCom Capital DAC 8,000 % fällig am 07.04.2030 <sup>^(h)</sup> \$	400	24	0,01
		3.538	1,11
Summe Irland		7.714	2,42

<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>			
Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026 €	1.300	1.415	0,44

<b>ITALIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % fällig am 21.11.2033 \$	1.300	1.435	0,45

<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,875 % fällig am 30.04.2029	500	508	0,16
Summe Italien		1.943	0,61

<b>ELFENBEINKÜSTE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
Elfenbeinküste 6,852 % fällig am 07.03.2025 €	3.400	3.635	1,14
8,908 % fällig am 19.03.2027	600	635	0,20
		4.270	1,34

<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ivory Coast Government International Bond 7,625 % fällig am 30.01.2033 \$	800	778	0,25
8,250 % fällig am 30.01.2037	700	680	0,21
		1.458	0,46

Summe Elfenbeinküste		5.728	1,80
----------------------	--	-------	------

<b>JAMAICA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
TransJamaican Highway Ltd. 5,750 % fällig am 10.10.2036	719	635	0,20

<b>KASACHSTAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Development Bank of Kazakhstan JSC 5,500 % fällig am 15.04.2027	1.000	996	0,31

<b>KENIA KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
Republik Kenia 11,726 % fällig am 29.06.2025	877	870	0,27

<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Republic of Kenya Government International Bond 17,933 % fällig am 06.05.2030 KES	113.400	909	0,29
18,461 % fällig am 09.08.2032	117.900	963	0,30
		1.872	0,59

Summe Kenia		2.742	0,86
-------------	--	-------	------

<b>LETTLAND STAATSEMISSIONEN</b>			
Latvia Government International Bond 5,125 % fällig am 30.07.2034 \$	1.600	1.578	0,49

<b>LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Chile Electricity Lux MPC SARL 6,010 % fällig am 20.01.2033	1.100	1.115	0,35

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,250 % fällig am 23.05.2023 <sup>^(h)</sup></b>			
	\$ 1.600	\$ 96	0,03
Summe Luxemburg		1.211	0,38

<b>MEXIKO UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Metalsa S.A. de C.V. 3,750 % fällig am 04.05.2031	800	639	0,20
Petroleos Mexicanos 6,375 % fällig am 23.01.2045	1.800	1.168	0,37
Trust Fibra Uno 6,390 % fällig am 15.01.2050	1.250	989	0,31
		2.796	0,88

<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031 (e) MXN	109.730	5.053	1,58
Summe Mexiko		7.849	2,46

<b>MAROKKO UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>OCP S.A.</b>			
6,750 % fällig am 02.05.2034 \$	1.000	1.028	0,32
7,500 % fällig am 02.05.2054	1.000	1.021	0,32
Summe Marokko		2.049	0,64

<b>NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
JAB Holdings BV 3,750 % fällig am 28.05.2051	2.500	1.618	0,51
Sagax Euro MTN NL BV 1,000 % fällig am 17.05.2029 €	1.300	1.206	0,38
Yinson Boronia Production BV 8,947 % fällig am 31.07.2042 \$	1.000	1.010	0,31
Summe Niederlande		3.834	1,20

<b>NIGERIA STAATSEMISSIONEN</b>			
Nigeria Government International Bond 7,875 % fällig am 16.02.2032	700	606	0,19

<b>PAKISTAN STAATSEMISSIONEN</b>			
Pakistan Government International Bond 7,375 % fällig am 08.04.2031	1.900	1.503	0,47
8,875 % fällig am 08.04.2051	900	679	0,21
Summe Pakistan		2.182	0,68

<b>PERU UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Banco de Credito del Peru S.A.</b>			
4,650 % fällig am 17.09.2024 PEN	2.600	674	0,21
<b>Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.</b>			
10,100 % fällig am 15.12.2043	20.500	5.485	1,72
<b>Petroleos del Peru S.A.</b>			
5,625 % fällig am 19.06.2047 \$	2.200	1.407	0,44
		7.566	2,37

<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Peru Government International Bond 5,400 % fällig am 12.08.2034 PEN	4.500	1.036	0,32
5,940 % fällig am 12.02.2029	700	184	0,06
6,150 % fällig am 12.08.2032	30.800	7.760	2,43
6,900 % fällig am 12.08.2037	10.900	2.735	0,86
6,950 % fällig am 12.08.2031	27.800	7.456	2,34
7,300 % fällig am 12.08.2033	13.800	3.702	1,16
		22.873	7,17
Summe Peru		30.439	9,54

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>RUMANIEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Romania Government International Bond 1,750 % fällig am 13.07.2030 €	1.000	\$ 876	0,27
2,000 % fällig am 28.01.2032	1.100	922	0,29
2,000 % fällig am 14.04.2033	1.100	886	0,28
4,250 % fällig am 28.04.2036 RON	3.100	527	0,17
5,250 % fällig am 30.05.2032 €	1.500	1.566	0,49
5,625 % fällig am 30.05.2037	1.500	1.552	0,49
6,375 % fällig am 18.09.2033	1.500	1.673	0,52
Summe Rumänien		8.002	2,51

<b>SENEGAL STAATSEMISSIONEN</b>			
Senegal Government International Bond 7,750 % fällig am 10.06.2031 \$	1.700	1.620	0,51

<b>SERBIEN STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Serbia Government International Bond</b>			
4,500 % fällig am 20.08.2032 RSD	13.800	117	0,04
6,000 % fällig am 12.06.2034 \$	1.200	1.183	0,37
Summe Serbien		1.300	0,41

<b>SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Yinson Production Financial Services Pte Ltd. 9,625 % fällig am 03.05.2029	400	399	0,13

<b>SÜDAFRIKA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Eskom Holdings SOC Ltd. 7,125 % fällig am 11.02.2025	1.200	1.196	0,38

<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030 ZAR	227.300	11.419	3,58
8,500 % fällig am 31.01.2037	72.500	3.127	0,98
10,500 % fällig am 21.12.2026	237.400	13.494	4,23
		28.040	8,79
Summe Südafrika		29.236	9,17

<b>SÜDKOREA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Mirae Asset Securities Co. Ltd. 2,625 % fällig am 30.07.2025 \$	600	580	0,18

<b>SUPRANATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Africa Finance Corp. 2,875 % fällig am 28.04.2028	600	531	0,17

<b>TUNESIEN STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Banque Centrale de Tunisie Government International Bond</b>			
5,750 % fällig am 30.01.2025	3.200	3.045	0,95
6,375 % fällig am 15.07.2026 €	3.400	3.155	0,99
Summe Tunesien		6.200	1,94

<b>TÜRKEI UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Turkish Airlines Pass-Through Trust</b>			
4,200 % fällig am 15.09.2028 \$	429	407	0,13

<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
<b>SOCAR Turkey Enerji A/S</b>			
7,348 % fällig am 11.08.2026 €	2.800	2.989	0,94
Summe Türkei		3.396	1,07

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>UKRAINE</b>					<b>UKRAINE</b>					<b>UKRAINE</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Ukraine Government International Bond					Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust					12,750 % fällig am 23.08.2022 ^				
7,253 % fällig am 15.03.2035 \$	1.700	492	0,16		5,780 % fällig am 25.07.2036 \$	900	865	0,27		\$	4.900	916	0,29	
7,750 % fällig am 01.08.2041	600	296	0,09				2.649	0,83				1.866	0,59	
Summe Ukraine		788	0,25		<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					Summe Venezuela		2.772	0,87	
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>SAMBIA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC					Gabon Blue Bond Master Trust					Zambia Government International Bond				
5,375 % fällig am 08.05.2029	1.300	1.321	0,41		6,097 % fällig am 01.08.2038	1.200	1.198	0,37		11,000 % fällig am 25.01.2026	ZMW	15.000	540	0,16
Summe Vereinigte Arabische Emirate		6.964	2,18		Pacific Gas & Electric Co.	1.300	1.075	0,34		13,000 % fällig am 25.01.2031		580	16	0,01
<b>GROSSBRITANNIEN</b>					<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>					<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>					<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>				
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond					Ecopetrol S.A.					25,548 % fällig am 10.09.2024 (c)(d)	EGP	225.625	4.474	1,40
5,500 % fällig am 30.04.2054	2.200	2.237	0,70		TBD % fällig am 17.08.2024	3.100	3.086	0,97		25,751 % fällig am 30.07.2024 (c)(d)		193.325	3.947	1,24
Finanzministerium der Regierung von Schardscha					Ziraat Bank					25,751 % fällig am 01.10.2024 (c)(d)		91.000	1.779	0,56
4,000 % fällig am 28.07.2050	800	523	0,17		TBD % fällig am 15.06.2034	1.800	1.801	0,56				10.200	3,20	
6,125 % fällig am 06.03.2036	2.900	2.883	0,90				4.887	1,53	<b>HUNGARY TREASURY BILLS</b>					
Summe Vereinigte Arabische Emirate		9.276	2,91		<b>NON-AGENCY-MBS</b>					7,096 % fällig am 04.07.2024 (c)(d)	HUF	1.729.000	4.689	1,47
<b>GROSSBRITANNIEN</b>					<b>NON-AGENCY-MBS</b>					<b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>NON-AGENCY-MBS</b>					<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>				
Antofagasta PLC					IndyMac Mortgage Loan Trust					23,125 % fällig am 25.02.2025 (c)(d)	NGN	19.800	11	0,00
6,250 % fällig am 02.05.2034	1.600	1.658	0,52		5,800 % fällig am 25.11.2036	627	599	0,19		24,356 % fällig am 01.04.2025 (c)(d)		1.055.200	592	0,19
Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC					<b>US-SCHATZOBIGLIGATIONEN</b>					25,627 % fällig am 25.02.2025 (c)(d)		617.800	347	0,11
0,000 % fällig am 05.04.2032 (c)	8.500	5.557	1,74		U.S. Treasury Bonds					26,487 % fällig am 06.03.2025 (c)(d)		1.556.000	892	0,28
Thames Water Utilities Finance PLC					1,750 % fällig am 15.08.2041	26.800	17.717	5,55		27,168 % fällig am 20.05.2025 (c)(d)		1.581.100	853	0,27
7,125 % fällig am 30.04.2031 £	1.200	1.347	0,42		2,375 % fällig am 15.02.2042	10.500	7.647	2,40		27,687 % fällig am 27.05.2025 (c)(d)		1.164.800	620	0,19
WE Soda Investments Holding PLC					4,750 % fällig am 15.11.2043	11.489	11.645	3,65				3.315	1,04	
9,375 % fällig am 14.02.2031 \$	700	714	0,23		U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)					Summe kurzfristige Instrumente		18.204	5,71	
Summe Großbritannien		10.581	3,32		0,625 % fällig am 15.07.2032	15.862	14.229	4,46		Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 311.163	97,56	
<b>USA</b>					<b>US-SCHATZOBIGLIGATIONEN</b>					<b>AKTIEN</b>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					<b>US-SCHATZOBIGLIGATIONEN</b>					<b>INVESTMENTFONDS</b>				
Aames Mortgage Investment Trust					U.S. Treasury Bonds					<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
6,765 % fällig am 25.06.2035 \$	786	698	0,22		1,750 % fällig am 15.08.2041	26.800	17.717	5,55		<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)</b>				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					2,375 % fällig am 15.02.2042	10.500	7.647	2,40		1.664.810	16.591	5,20		
6,480 % fällig am 25.04.2035	280	273	0,09		4,750 % fällig am 15.11.2043	11.489	11.645	3,65		<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>				
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.					U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)					<b>US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)</b>				
6,060 % fällig am 25.10.2036	620	353	0,11		51,238	16,06				6.300	630	0,20		
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.					51,238	16,06				Summe Investmentfonds		\$17.221	5,40	
6,435 % fällig am 25.12.2035	131	130	0,04		62,463	19,58				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust					<b>STAATSEMISSIONEN</b>					<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
4,359 % fällig am 25.07.2036	233	206	0,06		National Bank of Uzbekistan					Venezuela Government International Bond				
5,670 % fällig am 25.10.2036	104	103	0,03		8,500 % fällig am 05.07.2029 (a)	1.600	1.583	0,49		9,250 % fällig am 15.09.2027 ^	5.000	950	0,30	
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					19,875 % fällig am 05.07.2027 (a)	UZS 11.480.000	914	0,29						
6,435 % fällig am 25.07.2034	21	21	0,01		Summe Usbekistan		3.868	1,21						

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 3.392	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 28.02.2027	\$ (3.460)	\$ 3.392	\$ 3.392	1,06
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (3.460)	\$ 3.392	\$ 3.392	1,06

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	12	\$ (22)	(0,01)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	2	1	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	446	(41)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	696	494	0,16
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	16	(13)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	1	0	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	5	3	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	30	(19)	(0,01)
				\$ 403	0,13
				\$ 403	0,13

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-41 5-Year Index	1,000 %	20.06.2029	\$ 16.400	\$ (37)	(0,01)
iTraxx Crossover 41 5-Year Index	5,000	20.06.2029	€ 6.800	(48)	(0,02)
				\$ (85)	(0,03)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,700 %	28.03.2034	£ 200	\$ 6	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	18.09.2029	INR 1.583.710	134	0,04
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,384	20.06.2026	816.400	44	0,01
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,397	20.06.2034	193.800	(10)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,232	05.10.2025	¥ 9.390.000	(49)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	\$ 2.500	354	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2025	400	(26)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.12.2050	1.500	707	0,22
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	4.500	1.260	0,40
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2024	270	8	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	4.100	467	0,15
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.12.2031	2.700	485	0,15
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	18.12.2025	400	4	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	8.900	(338)	(0,11)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,319	30.05.2033	12.400	(55)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2025	60.100	327	0,10
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	17.800	498	0,16
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	1.300	15	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2054	500	(9)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,600	17.01.2034	100	4	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,648	08.01.2034	200	8	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	200	7	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	23.01.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,738	23.01.2034	200	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	6.400	28	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	58.200	142	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	37.000	(91)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	4.700	(49)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	200	6	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	4.100	(55)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	18.600	11	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2044	15.000	(412)	(0,13)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	100	1	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	400	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,860	21.02.2034	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	22.02.2029	900	(9)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	300	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	100	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	300	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,078	29.04.2034	500	5	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	05.06.2034	500	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,090	30.04.2034	900	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,130	03.05.2034	600	9	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	300	3	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,155 %	02.10.2033	\$ 400	\$ 4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	1.200	12	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	100	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	200	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	100	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	300	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	100	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	200	7	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	400	14	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,455	30.06.2026	94.700	50	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,585	02.01.2025	BRL 10.000	(267)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,225	02.01.2025	4.600	(93)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,750	02.01.2025	10.500	154	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,962	04.01.2027	8.300	(211)	(0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,589	04.01.2027	11.900	259	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,621	02.01.2025	6.000	(36)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,650	02.01.2026	44.500	217	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,795	04.01.2027	37.100	(271)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,145	04.01.2027	2.500	(33)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,231	04.01.2027	9.400	(118)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,472	04.01.2027	28.200	(305)	(0,10)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,559	02.01.2025	45.000	73	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,602	04.01.2027	45.800	(315)	(0,10)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,831	02.01.2025	125.300	(164)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,985	02.01.2029	2.500	8	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,083	04.01.2027	22.200	(165)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,134	04.01.2027	27.200	107	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,199	04.01.2027	24.800	159	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,439	04.01.2027	15.500	(36)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,449	04.01.2027	15.500	(36)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,456	02.01.2026	38.300	(44)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,555	04.01.2027	46.000	45	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,839	02.01.2025	65.900	14	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,920	02.01.2025	88.400	(110)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,946	04.01.2027	37.800	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,026	02.01.2025	22.100	(20)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,131	04.01.2027	25.200	137	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,132	04.01.2027	21.700	14	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,231	02.01.2025	15.500	(2)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024	52.300	(12)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024	56.100	(28)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,569	02.01.2029	16.000	(33)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024	46.000	36	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,721	02.01.2029	19.000	55	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,784	02.01.2029	20.500	67	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,981	04.01.2027	27.000	116	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024	100.300	163	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,257	02.01.2029	39.300	(229)	(0,07)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,690	24.07.2024	COP 7.257.000	38	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,740	24.07.2024	7.084.900	(37)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,100	26.11.2025	2.651.000	53	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,060	26.11.2025	14.071.000	234	0,07
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,110	23.03.2026	4.493.200	(68)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,651	26.11.2025	2.624.800	(38)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,885	31.01.2025	24.609.000	138	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,080	02.02.2027	1.622.900	14	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,090	28.04.2028	1.750.200	18	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,130	28.04.2028	618.500	6	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,140	28.04.2028	1.855.800	18	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,620	26.02.2034	3.210.600	(37)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,320	31.03.2027	2.908.000	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,560	30.03.2027	4.424.200	6	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,830	31.03.2028	4.898.000	(23)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,140	28.04.2028	3.977.000	26	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,800	17.01.2028	9.809.000	105	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,265	12.04.2025	12.781.500	(14)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,640	21.10.2025	11.114.000	(95)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,930	10.11.2025	5.929.100	59	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,000	26.11.2025	427.000	(4)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,060	09.11.2025	4.198.000	44	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,100	05.06.2026	ZAR 10.600	(2)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,599	05.06.2029	73.700	(70)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,947	23.11.2027	CLP 999.000	115	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,950	05.05.2026	1.239.600	(86)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,965	24.11.2027	851.000	97	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,020	30.04.2026	1.300.000	(89)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,183	04.12.2027	2.661.000	(284)	(0,09)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,640	01.03.2026	795.000	48	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,530	06.07.2026	1.995.000	107	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,000	06.07.2028	1.019.000	66	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,775	23.02.2026	2.959.500	49	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,935	29.01.2034	8.000.000	334	0,11

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,030 %	23.02.2034	CLP	709.200	\$ (23)	(0,01)
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,050	01.04.2033		2.200.000	(52)	(0,02)
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,180	01.10.2028		790.000	5	0,00
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030		1.286.000	10	0,00
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,260	01.03.2026		620.000	4	0,00
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,360	27.03.2028		1.914.900	0	0,00
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,370	01.10.2028		3.136.000	(4)	0,00
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,470	01.09.2030		460.000	(3)	0,00
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,548	10.04.2028		833.000	7	0,00
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,570	01.10.2028		245.000	(2)	0,00
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,600	12.12.2027		1.803.000	(18)	(0,01)
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,635	12.12.2027		3.695.000	(42)	(0,01)
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	5,700	17.05.2028		1.602.100	(24)	(0,01)
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,020	02.03.2029		190.000	6	0,00
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,070	28.02.2028		3.391.700	(88)	(0,03)
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,194	10.03.2028		1.681.200	53	0,02
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,223	13.03.2028		680.300	22	0,01
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,255	13.03.2028		478.200	16	0,01
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,270	02.03.2027		415.700	10	0,00
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,330	09.03.2028		526.800	19	0,01
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,360	25.05.2027		24.600	1	0,00
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,386	24.05.2027		1.861.000	59	0,02
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,440	07.03.2028		1.344.000	55	0,02
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,500	12.12.2025		2.564.000	(46)	(0,01)
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,535	09.01.2026		9.540.000	153	0,05
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,567	12.12.2025		1.464.000	(27)	(0,01)
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,570	22.12.2025		1.277.000	(24)	(0,01)
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,590	22.12.2025		3.565.000	(67)	(0,02)
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,590	21.03.2027		4.540.300	94	0,03
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	6,805	06.03.2027		1.852.000	76	0,02
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	7,000	27.09.2032		1.785.800	217	0,07
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	7,265	07.03.2026		262.400	9	0,00
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	7,270	07.03.2026		2.463.000	86	0,03
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	7,370	06.03.2026		1.686.000	63	0,02
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month	CZK-PRIBOR	1,025	29.07.2030	CZK	35.800	(180)	(0,06)
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	1,224	28.01.2031		44.500	(331)	(0,10)
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	1,575	26.03.2026		28.100	(63)	(0,02)
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	1,725	22.07.2026		23.800	(59)	(0,02)
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	1,815	28.01.2031		34.200	202	0,06
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	3,480	15.02.2034		21.500	(45)	(0,01)
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	3,490	18.01.2032		10.600	17	0,01
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	3,645	01.02.2029		166.600	(247)	(0,08)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month	CZK-PRIBOR	3,675	08.01.2029		62.600	(60)	(0,02)
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	3,680	03.03.2027		78.400	9	0,00
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	3,870	15.02.2026		120.700	80	0,03
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,164	14.03.2027		73.600	3	0,00
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,220	14.03.2027		73.500	(2)	0,00
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	4,300	18.03.2027		143.400	46	0,01
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,310	15.03.2027		19.100	(3)	0,00
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,320	15.03.2027		7.200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,560	14.07.2032		111.300	(195)	(0,06)
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028		118.100	71	0,02
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	4,638	03.10.2033		15.200	(5)	0,00
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	4,640	18.05.2028		64.400	69	0,02
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,740	28.02.2033		91.700	228	0,07
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,740	28.02.2033		91.700	(6)	0,00
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	5,040	17.04.2028		27.900	46	0,01
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	5,100	18.04.2028		11.800	21	0,01
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	5,110	22.03.2026		72.500	(41)	(0,01)
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	5,125	22.03.2026		50.000	(29)	(0,01)
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	5,480	15.03.2026		216.500	186	0,06
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	5,606	28.06.2027		54.800	107	0,03
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040	€	300	133	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month	EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054		4.900	259	0,08
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month	EUR-EURIBOR	2,650	08.01.2034		200	5	0,00
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	2,670	03.04.2034		300	6	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month	EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034		600	(12)	0,00
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029		400	6	0,00
Zahlung	6-Month	EUR-EURIBOR	2,760	04.03.2034		100	(1)	0,00
Zahlung	6-Month	EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029		1.400	(7)	0,00
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	2,818	26.06.2029		200	1	0,00
Zahlung	6-Month	EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029		200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028		200	(2)	0,00
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033		200	(4)	0,00
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033		300	(6)	0,00
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028		500	(7)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month	EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029		700	3	0,00
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033		1.500	(38)	(0,01)
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033		600	(16)	(0,01)
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033		100	(4)	0,00
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033		500	(24)	(0,01)
Erhalt	6-Month	EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028		200	(6)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,270 %	08.11.2028	€ 600	\$ (18)	(0,01)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,760	21.01.2030	HUF 380.000	250	0,08
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,958	19.03.2026	398.600	(92)	(0,03)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	5,500	04.03.2027	2.382.600	134	0,04
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6,140	15.02.2034	218.000	(30)	(0,01)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,220	15.02.2026	1.126.100	55	0,02
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6,280	18.03.2027	2.363.300	49	0,02
Zahlung	6-Month HUF-BBR	7,000	30.04.2029	4.338.400	149	0,05
Erhalt	6-Month HUF-BBR	13,600	12.12.2024	1.418.700	(380)	(0,12)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,110	12.01.2031	PLN 9.800	573	0,18
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,165	28.01.2031	4.400	(103)	(0,03)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month PLN-WIBOR	1,215	29.07.2030	10.300	378	0,12
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,855	28.01.2031	6.000	(283)	(0,09)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,933	17.01.2025	11.800	(166)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,635	28.10.2026	32.900	(421)	(0,13)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	3,035	09.12.2026	42.000	380	0,12
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027	28.700	197	0,06
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,710	25.05.2027	12.000	38	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,735	09.10.2028	12.100	(32)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,740	25.10.2033	7.100	8	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,830	18.03.2027	17.300	(9)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,895	17.03.2027	7.200	(18)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,920	17.03.2027	15.000	(35)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,970	21.03.2029	79.800	(89)	(0,03)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,310	21.03.2033	7.400	(92)	(0,03)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,300	25.04.2028	11.900	(27)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,670	28.06.2027	6.200	64	0,02
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,725	27.06.2027	20.700	(223)	(0,07)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,843	28.06.2027	1.500	17	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027	11.000	(162)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,080	16.06.2025	MXN 16.400	(50)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,700	12.09.2030	35.400	(347)	(0,11)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,770	09.10.2030	26.100	253	0,08
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,850	19.08.2030	12.100	(115)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,875	16.08.2030	16.800	(156)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,880	16.08.2030	8.700	(80)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,920	16.08.2030	9.100	(83)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,240	10.07.2026	113.600	(431)	(0,13)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,480	28.05.2040	16.700	(113)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,495	17.07.2026	140.500	550	0,17
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,505	17.07.2026	102.100	399	0,13
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,580	01.01.2025	29.700	(39)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,830	27.12.2029	19.900	(126)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,570	19.11.2026	300	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,400	23.11.2034	54.500	(166)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,465	16.08.2027	167.300	352	0,11
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,480	24.03.2027	121.900	(278)	(0,09)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,540	21.12.2033	36.200	92	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,560	18.05.2028	14.500	30	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,585	18.05.2028	14.700	30	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,600	18.05.2028	7.400	15	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,600	11.12.2028	60.400	103	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,610	18.05.2028	7.600	15	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,645	18.05.2028	7.600	15	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,656	18.05.2028	17.300	33	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,700	05.11.2027	8.700	(15)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,740	07.03.2028	192.900	282	0,09
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,743	05.11.2027	37.900	(65)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,760	05.11.2027	25.400	(43)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,773	05.11.2027	20.000	(33)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,845	04.12.2028	214.700	(487)	(0,15)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	9,045	04.11.2027	17.200	(21)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	9,053	04.11.2027	18.900	(23)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	9,117	04.11.2027	47.100	(53)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	9,165	05.11.2026	25.600	(29)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIE	9,415	01.06.2029	332.200	(126)	(0,04)
Zahlung <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIE	9,420	01.06.2029	164.700	(61)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIE	9,630	04.06.2029	336.200	(35)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	9,680	23.04.2029	136.900	(66)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIE	9,700	31.05.2034	52.100	(52)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	9,750	06.06.2034	57.000	(69)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIE	9,787	06.06.2029	220.100	(100)	(0,03)
					\$ 3.030	0,95
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 2.945</b>	<b>0,92</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 18,100	11.07.2024	3.424	\$ 23	\$ 23	0,01
	Put - OTC USD versus ZAR	18,300	11.07.2024	3.424	35	41	0,01
GLM	Call - OTC USD versus JPY	¥ 167,000	05.11.2024	1.708	87	259	0,08
JPM	Put - OTC EUR versus PLN	PLN 4,400	22.08.2024	305	77	263	0,08
MYI	Call - OTC USD versus JPY	¥ 168,000	29.10.2024	405	36	51	0,02
					\$ 258	\$ 637	0,20

##### STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs <sup>(2)</sup>	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten <sup>(2)</sup>	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYI	Call & Put - OTC 3-Month vs. 9-Month Forward Volatility Agreement	14,500 %	25.10.2024	2.400	\$ 0	\$ 3	0,00

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
BOA	Call - OTC USD versus TRY	TRY 43,800	01.11.2024	1.833	\$ (45)	\$ (26)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY	49,800	28.01.2025	4.392	(141)	(106)	(0,03)	
	Call - OTC USD versus TRY	55,000	01.05.2025	1.831	(76)	(68)	(0,02)	
	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 17,840	11.07.2024	6.848	(23)	(18)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus ZAR	18,000	11.07.2024	6.848	(34)	(33)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 17,450	01.07.2024	2.600	(90)	(118)	(0,04)	
CBK	Put - OTC USD versus MXN	17,450	01.07.2024	2.600	(91)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	TRY 39,000	03.04.2025	2.854	(43)	(86)	(0,03)	
DUB	Call - OTC USD versus TRY	40,385	28.10.2024	610	(61)	(14)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY	40,385	28.10.2024	610	(61)	(66)	(0,02)	
GLM	Put - OTC USD versus TRY	33,000	04.07.2024	1.662	(25)	(8)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	35,500	03.10.2024	2.619	(28)	(67)	(0,02)	
	Call - OTC USD versus TRY	40,250	30.10.2024	616	(62)	(15)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY	40,250	30.10.2024	616	(62)	(64)	(0,02)	
	Call - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	306	(30)	(8)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	39,800	31.10.2024	306	(31)	(29)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	304	(29)	(7)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	40,930	07.11.2024	304	(29)	(34)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	304	(29)	(7)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	41,150	07.11.2024	304	(29)	(36)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	304	(29)	(8)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	41,160	11.11.2024	304	(29)	(35)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY	36,500	03.01.2025	1.679	(47)	(33)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY	36,500	07.01.2025	1.692	(45)	(33)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY	36,757	09.01.2025	1.694	(43)	(37)	(0,01)	
						\$ (1.212)	\$ (956)	(0,30)

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700 %	04.07.2024	700	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	700	(1)	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	900	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	900	(3)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,610	15.07.2024	200	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	15.07.2024	200	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	300	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	1.600	(3)	(4)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	1.600	(3)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	200	(1)	0	0,00
							\$ (20)	\$ (11)	0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.06.2029	\$ 16.300	\$ 489	\$ (5)	\$ 484	0,15
BRC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	5.300	(155)	3	(152)	(0,05)
JPM	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	16.600	73	(1)	72	0,02
MYC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	4.200	118	7	125	0,04
					\$ 525	\$ 4	\$ 529	0,16

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Egypt Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 2.600	\$ (221)	\$ 196	\$ (25)	(0,01)
GST	Israel Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	1	0	1	0,00
	Israel Government International Bond	1,000	20.12.2025	3.300	4	(3)	1	0,00
	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2026	500	0	0	0	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	600	(13)	15	2	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2029	16.600	(608)	(67)	(675)	(0,21)
					\$ (837)	\$ 141	\$ (696)	(0,22)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS zzgl. 0,068 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	INR 180.139	\$ 2.151	\$ 6	\$ 9	\$ 15	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS zzgl. 0,068 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	709.400	8.465	27	28	55	0,02
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,428% basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	\$ 100	ARS 4.488	0	99	99	0,03
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS zzgl. 0,068 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	INR 180.040	\$ 2.150	4	10	14	0,01
SCX	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS zzgl. 0,068 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	444.906	5.309	16	15	31	0,01
						\$ 53	\$ 161	\$ 214	0,07

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750 %	18.09.2029	MYR 115.900	\$ 44	\$ 77	\$ 121	0,04
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2029	3.310	2	1	3	0,00
						\$ 46	\$ 78	\$ 124	0,04

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	\$ 276	NZD 450	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	08.2024	NZD 450	\$ 276	1	0	1	0,00
BOA	07.2024	KRW 1.043.542	763	5	0	5	0,00
	07.2024	\$ 7.185	€ 6.590	0	(122)	(122)	(0,04)
	07.2024	205	HUF 75.459	0	0	0	0,00
	07.2024	6.087	PLN 24.521	13	(2)	11	0,00
	08.2024	PEN 6.613	\$ 1.727	1	0	1	0,00
	08.2024	\$ 532	PKR 153.482	15	0	15	0,00
	09.2024	PEN 12.044	\$ 3.188	44	0	44	0,01
	11.2024	TRY 11.608	293	0	(17)	(17)	(0,01)
	01.2025	32.328	743	0	(51)	(51)	(0,02)
	05.2025	15.516	332	0	(18)	(18)	(0,01)
BPS	07.2024	AUD 128	85	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	€ 2.351	2.545	26	0	26	0,01
	07.2024	£ 6.858	8.760	91	0	91	0,03
	07.2024	IDR 156.933.327	9.611	20	0	20	0,01
	07.2024	KRW 1.035.723	755	2	0	2	0,00
	07.2024	PLN 55.968	13.813	0	(107)	(107)	(0,03)
	07.2024	\$ 8.007	BRL 42.904	0	(283)	(283)	(0,09)
	07.2024	304	€ 279	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	27.521	IDR 449.311.899	0	(60)	(60)	(0,02)
	07.2024	9.578	¥ 1.488.900	0	(322)	(322)	(0,10)
	07.2024	4.506	SGD 6.112	3	0	3	0,00
	07.2024	7.430	THB 273.688	37	0	37	0,01
	08.2024	SGD 6.103	\$ 4.506	0	(3)	(3)	0,00
	09.2024	CNH 49.417	6.888	80	0	80	0,03
	09.2024	INR 27.659	330	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	TRY 109.994	3.096	0	(25)	(25)	(0,01)
	09.2024	TWD 3.795	118	1	0	1	0,00
	09.2024	\$ 389	CNH 2.782	0	(6)	(6)	0,00
	10.2024	325	2.329	0	(4)	(4)	0,00
	05.2029	KWD 3.368	\$ 11.579	333	0	333	0,10
BRC	07.2024	PLN 132	34	1	0	1	0,00
	07.2024	TRY 86.818	2.553	0	(40)	(40)	(0,01)
	07.2024	\$ 1.194	NOK 12.560	0	(14)	(14)	0,00
	07.2024	19.857	PLN 79.318	0	(131)	(131)	(0,04)
	07.2024	5.006	RON 23.071	0	(39)	(39)	(0,01)
	07.2024	887	TRY 30.033	5	0	5	0,00
	08.2024	7.588	263.208	23	0	23	0,01
	09.2024	15.486	MXN 291.056	241	0	241	0,08
	09.2024	220	TRY 8.140	13	0	13	0,00
	10.2024	TRY 20.409	\$ 525	0	(38)	(38)	(0,01)
	11.2024	\$ 293	TRY 11.617	17	0	17	0,01
	01.2025	TRY 63.429	\$ 1.521	0	(68)	(68)	(0,02)
	01.2025	\$ 596	TRY 25.984	42	0	42	0,01
	04.2025	TRY 24.470	\$ 534	0	(31)	(31)	(0,01)
	05.2025	\$ 332	TRY 15.516	18	0	18	0,01
BSH	08.2024	PEN 15.382	\$ 4.030	15	0	15	0,01
CBK	07.2024	BRL 46.189	8.580	265	0	265	0,08
	07.2024	CHF 631	693	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	€ 3.954	4.275	38	(1)	37	0,01
	07.2024	£ 2.348	2.974	6	0	6	0,00
	07.2024	NOK 12.565	1.191	10	0	10	0,00
	07.2024	SGD 6.509	4.825	23	0	23	0,01
	07.2024	\$ 3.329	£ 2.605	0	(36)	(36)	(0,01)
	07.2024	148	KES 20.424	9	0	9	0,00
	07.2024	464	MXN 8.097	0	(21)	(21)	(0,01)
	07.2024	269	NGN 419.604	9	0	9	0,00
	07.2024	4.412	PLN 17.449	1	(73)	(72)	(0,02)
	07.2024	2.855	ZAR 51.856	0	(19)	(19)	(0,01)
	07.2024	ZAR 447	\$ 24	0	0	0	0,00
	08.2024	EGP 18.685	385	3	0	3	0,00
	08.2024	PEN 5.428	1.417	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 3.675	BRL 20.093	0	(71)	(71)	(0,02)
	08.2024	1.178	EGP 57.015	0	(14)	(14)	0,00
	09.2024	PEN 50.765	\$ 13.646	395	0	395	0,12
	09.2024	TWD 1.273	39	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 10.763	INR 899.858	8	(4)	4	0,00
	02.2025	UGX 808.123	\$ 194	0	(15)	(15)	0,00
	04.2025	\$ 534	TRY 24.431	30	0	30	0,01
	05.2025	KES 113.723	\$ 771	0	(21)	(21)	(0,01)
	06.2025	EGP 48.864	915	27	0	27	0,01
DUB	07.2024	BRL 57.153	10.835	546	0	546	0,17
	07.2024	CLP 3.245.499	3.509	71	0	71	0,02
	07.2024	KRW 566.080	411	0	0	0	0,00
	07.2024	NGN 222.828	180	32	0	32	0,01
	07.2024	\$ 4.646	BRL 23.356	0	(442)	(442)	(0,14)
	07.2024	30	EGP 1.452	0	0	0	0,00
	07.2024	2.176	MYR 10.258	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 3.876	PLN 17.898	284	0	284	0,09
	08.2024	\$ 9.930	BRL 52.859	0	(449)	(449)	(0,14)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	\$	KES	1.428	\$ 0	\$ 0	0,00
	09.2024	MXN	\$	3.119	0	(50)	(0,02)
	10.2024	\$	TRY	8.376	18	18	0,01
	11.2024	¥	\$	1.323	139	0	0,04
	02.2025	UGX		615	0	(32)	(0,01)
	02.2025	\$	PKR	84.000	7	0	0,00
	03.2025		TRY	5.328	14	14	0,00
FAR	07.2024	CLP	\$	1.061	0	(2)	0,00
	07.2024	€		32.125	514	0	0,16
	07.2024	¥		12.889	378	0	0,12
	07.2024	NZD		1.215	13	0	0,00
	07.2024	\$	AUD	133	0	0	0,00
	07.2024		CLP	1.004.033	2	0	0,00
	07.2024		¥	523.426	0	(31)	(0,01)
	07.2024		NZD	866	0	0	0,00
	08.2024	¥	\$	3.285	31	0	0,01
	08.2024	NZD		528	1	0	0,00
GLM	09.2024	COP		6.388	311	0	0,10
	07.2024	BRL		1.668	80	0	0,03
	07.2024	CLP		1.109	45	0	0,01
	07.2024	DOP		2.973	6	(7)	0,00
	07.2024	€		1.122	11	0	0,00
	07.2024	MXN		2.668	0	(36)	(0,01)
	07.2024	\$	DOP	70.434	0	(12)	0,00
	07.2024		MXN	87.773	0	(11)	0,00
	07.2024		MYR	15.031	0	(3)	0,00
	07.2024		TRY	96.516	75	0	0,02
	07.2024	ZAR	\$	5.281	0	(4)	0,00
	08.2024	DOP		2.140	1	(7)	0,00
	08.2024	\$	BRL	6.933	0	(12)	0,00
	08.2024		EGP	66.794	0	(24)	(0,01)
	08.2024		TRY	6.486	1	0	0,00
	09.2024	DOP	\$	2.468	0	(25)	(0,01)
	09.2024	MXN		10.858	141	0	0,04
	09.2024	\$	MXN	6.204	7	0	0,00
	09.2024		TRY	102.106	335	0	0,11
	10.2024			28.732	52	0	0,02
	11.2024		¥	186.955	0	(138)	(0,04)
	11.2024		TRY	17.219	36	0	0,01
	12.2024		EGP	46.183	0	(19)	(0,01)
	01.2025		TRY	63.429	68	0	0,02
JPM	06.2025	EGP	\$	910	27	0	0,01
	07.2024	CNY		4.510	49	0	0,02
	07.2024	KES		416	0	(1)	0,00
	07.2024	KRW		506	0	(1)	0,00
	07.2024	PEN		1.419	32	0	0,01
	07.2024	PLN		3.227	52	0	0,02
	07.2024	\$	CHF	4.452	0	(7)	0,00
	07.2024		CNY	589	0	(1)	0,00
	07.2024		€	743	0	(14)	0,00
	07.2024		MXN	65.773	18	0	0,01
	07.2024		PLN	262	0	(2)	0,00
	07.2024		SGD	397	0	(2)	0,00
	07.2024		TRY	16.794	14	0	0,00
	07.2024	ZAR	\$	9.941	0	(68)	(0,02)
	08.2024	CHF		4.961	7	0	0,00
	08.2024	€	PLN	4.869	0	(4)	0,00
	08.2024	KES	\$	11	0	0	0,00
	08.2024	PLN	€	3.876	0	(273)	(0,09)
	08.2024	\$	CNY	32.187	0	(1)	0,00
	08.2024		NGN	122.768	0	(3)	0,00
	08.2024		PKR	68.208	5	0	0,00
	08.2024		TRY	99.106	119	0	0,04
	09.2024	TWD	\$	67	0	0	0,00
	09.2024	\$	EGP	14.254	0	0	0,00
	09.2024		INR	122.741	4	0	0,00
	09.2024		MXN	76.079	0	(93)	(0,03)
	10.2024		CNH	5.314	0	(9)	0,00
	11.2024		TRY	126.007	161	0	0,05
	01.2025			6.333	9	0	0,00
	03.2025			4.707	14	0	0,00
MBC	07.2024	CAD	\$	3.952	19	0	0,01
	07.2024	€		9.999	13	0	0,00
	07.2024	£		94	1	0	0,00
	07.2024	HUF		9.087	0	(98)	(0,03)
	07.2024	¥		886	60	0	0,02
	07.2024	PLN		23	1	0	0,00
	07.2024	\$	CAD	5.384	4	0	0,00
	07.2024		CHF	2.860	0	(32)	(0,01)
	07.2024		CZK	253.413	0	(140)	(0,04)
	07.2024		€	4.413	0	(75)	(0,02)
	08.2024	CAD	\$	3.603	0	(2)	0,00
	08.2024	EGP		770	6	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2024	TWD	539	\$ 17	\$ 0	\$ 0	0,00
	02.2025	UGX	2.435.168	605	0	(27)	(0,01)
MYI	07.2024	€	62	66	0	0	0,00
	07.2024	INR	809.987	9.677	0	(37)	(0,01)
	07.2024	PLN	25.642	6.366	0	(11)	0,00
	07.2024	\$	8.193	BRL 44.147	0	(245)	(0,08)
	07.2024		25	€ 23	0	0	0,00
	07.2024		21	£ 16	0	0	0,00
	07.2024		247	HUF 91.697	2	2	0,00
	07.2024		886	¥ 132.674	0	(60)	(0,02)
	08.2024		1.308	BRL 7.217	0	(13)	0,00
	09.2024	TWD	861	\$ 27	0	0	0,00
	09.2024	\$	980	INR 81.929	1	1	0,00
RBC	07.2024		321	BRL 1.748	0	(6)	0,00
	07.2024		8.465	£ 6.675	0	(27)	(0,01)
	08.2024	£	6.675	\$ 8.466	27	27	0,01
SCX	07.2024	KRW	525.576	385	4	4	0,00
	07.2024	MXN	62		3	0	0,00
	07.2024	\$	4.437	CNY 31.555	0	(61)	(0,02)
	07.2024		39.661	€ 37.018	13	0	0,00
	07.2024		244	KES 33.611	15	0	0,00
	07.2024		424	NGN 641.092	7	(7)	0,00
	07.2024	ZAR	90.471	\$ 4.909	0	(39)	(0,01)
	08.2024	€	37.018	39.719	0	(12)	0,00
	08.2024	NGN	310.876	220	14	14	0,00
	08.2024	PEN	14.520	3.795	5	5	0,00
	08.2024	UGX	727.793	184	0	(10)	0,00
	08.2024	\$	59	EGP 3.370	9	9	0,00
	08.2024		132	NGN 188.107	0	(7)	0,00
	09.2024	CLP	4.432.489	\$ 4.791	98	98	0,03
	09.2024	CNH	34.476	4.806	56	56	0,02
	09.2024	PHP	8.567	146	0	0	0,00
	09.2024	TWD	1.849	57	0	0	0,00
	09.2024	\$	297	EGP 14.639	0	(3)	0,00
	09.2024		6.645	INR 556.163	10	10	0,00
	12.2024		459	EGP 23.294	0	(10)	0,00
SOG	09.2024		30	1.495	0	0	0,00
SSB	07.2024	€	2.889	\$ 3.134	38	38	0,01
	07.2024	\$	3.179	IDR 52.394.879	23	23	0,01
	09.2024	INR	801.389	\$ 9.564	0	(25)	(0,01)
	09.2024	\$	6.359	INR 532.925	18	18	0,01
TOR	07.2024	CHF	30	\$ 33	0	0	0,00
	07.2024	HUF	91.455	248	0	0	0,00
	07.2024	\$	402	NZD 656	0	(2)	0,00
	07.2024		1.542	ZAR 27.820	0	(20)	(0,01)
	08.2024	NZD	656	\$ 402	2	2	0,00
	08.2024	\$	10.892	COP 43.690.292	0	(424)	(0,13)
UAG	07.2024	CHF	6.654	\$ 7.363	0	(41)	(0,01)
	07.2024	ILS	33.641	9.078	142	142	0,04
	08.2024	\$	2.292	€ 2.140	5	5	0,00
				\$ 6.194	\$ (4.890)	\$ 1.304	0,41

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	CNH	3.452	\$ 476	\$ 3	\$ 3	0,00
	07.2024	\$	23.169	€ 21.339	0	(299)	(0,09)
	07.2024		2.194	INR 183.349	5	5	0,00
	07.2024		4	MXN 75	0	0	0,00
	07.2024		183	TRY 6.076	2	2	0,00
BPS	07.2024	¥	173.244	\$ 1.114	37	37	0,01
	07.2024	\$	11.121	€ 10.333	0	(47)	(0,01)
	07.2024		0	¥ 74	0	0	0,00
	09.2024	TRY	8.205	\$ 232	0	(2)	0,00
BRC	07.2024	CZK	158	7	0	0	0,00
	07.2024	IDR	456.024	28	0	0	0,00
	07.2024	MXN	3.120	173	2	2	0,00
	07.2024	\$	47	€ 44	0	0	0,00
	07.2024		10	HUF 3.445	0	0	0,00
	07.2024		18	THB 653	0	0	0,00
	07.2024		142	TRY 5.024	10	10	0,00
	08.2024		121	MXN 2.222	0	0	0,00
	09.2024		292	TRY 10.265	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2024	BRL	3	\$ 1	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	COP	149.814	39	3	0	0,00
	07.2024	€	4.212	4.587	74	0	0,02
	07.2024	TRY	46.354	\$ 1.397	0	(17)	(0,01)
	07.2024	\$	1	BRL 3	0	0	0,00
	07.2024		7	£ 6	0	0	0,00
	07.2024		854	ILS 3.171	0	(12)	(0,00)
	07.2024		4	MXN 75	0	0	0,00
	08.2024	BRL	3	\$ 1	0	0	0,00
	07.2024		4.321	859	82	0	0,03
DUB	07.2024	\$	34.948	€ 32.088	0	(559)	(0,17)
	07.2024		1.226	¥ 191.391	0	(36)	(0,01)
GLM	07.2024	¥	16.072	\$ 104	4	0	0,00
	07.2024	MYR	115	24	0	0	0,00
	07.2024	\$	22	€ 20	0	0	0,00
	07.2024		24	MYR 115	0	0	0,00
	08.2024	MYR	115	\$ 24	0	0	0,00
	08.2024	\$	1.410	TRY 47.859	4	0	0,00
JPM	07.2024	CNY	23.116	\$ 3.241	35	0	0,01
	07.2024	€	1.662	1.778	0	(3)	0,00
	07.2024	TRY	37.454	1.097	0	(45)	(0,01)
	07.2024	\$	4	BRL 23	0	0	0,00
MBC	07.2024		59	CNY 423	0	(1)	0,00
	08.2024	BRL	23	\$ 4	0	0	0,00
	08.2024	\$	3.241	CNY 23.130	0	(1)	0,00
	07.2024	€	32.734	\$ 35.031	25	(77)	(0,02)
	07.2024	ILS	3.595	968	14	0	0,00
	07.2024	\$	196	CNH 1.417	0	(2)	0,00
	07.2024		36	COP 149.814	0	0	0,00
	07.2024		892	€ 831	0	(1)	0,00
	07.2024		112	ILS 416	0	(2)	0,00
	08.2024	COP	149.814	\$ 36	0	0	0,00
MYI	08.2024	\$	33.484	€ 31.268	77	0	0,02
	09.2024		379	TRY 13.342	2	0	0,00
	07.2024	€	24	\$ 26	0	0	0,00
	07.2024	\$	28	IDR 456.421	0	0	0,00
	07.2024		370	TRY 12.218	2	0	0,00
	07.2024		16	ZAR 289	0	0	0,00
	07.2024	ZAR	290	\$ 15	0	0	0,00
	08.2024	IDR	456.721	28	0	0	0,00
	08.2024	ZAR	289	16	0	0	0,00
	07.2024	€	30.941	33.157	6	(10)	(0,00)
SCX	07.2024	\$	3.189	CNY 22.677	0	(44)	(0,01)
	08.2024		30.731	€ 28.641	10	0	0,00
	07.2024		838	BRL 4.298	0	(64)	(0,02)
SSB	07.2024		5.383	€ 4.963	0	(66)	(0,02)
	07.2024		4	MXN 75	0	0	0,00
TOR	07.2024		279	CNH 2.034	0	0	0,00
	08.2024	CNH	2.030	\$ 279	0	0	0,00
UAG	07.2024	INR	183.976	2.206	0	0	0,00
	07.2024	RON	62	13	0	0	0,00
	07.2024	THB	653	18	0	0	0,00
	07.2024	\$	161	MXN 2.897	0	(2)	0,00
	08.2024	€	1.321	\$ 1.414	0	(3)	0,00
	08.2024	\$	18	THB 653	0	0	0,00
				\$ 397	\$ (1.293)	\$ (896)	(0,28)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	CNH	16	\$ 2	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	ILS	2	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	6	€ 5	0	0	0,00
	07.2024		24	INR 2.023	0	0	0,00
	07.2024		0	MXN 0	0	0	0,00
	08.2024		0	ILS 2	0	0	0,00
BRC	07.2024	£	35	\$ 45	1	0	0,00
	07.2024	MXN	18	1	0	0	0,00
	07.2024	TRY	562	16	0	(1)	0,00
	07.2024	\$	1	IDR 9.826	0	0	0,00
	07.2024		1	TRY 35	0	0	0,00
CBK	08.2024		1	MXN 18	0	0	0,00
	09.2024	TRY	467	\$ 13	0	0	0,00
	07.2024	BRL	0	0	0	0	0,00
	07.2024	COP	1.565	0	0	0	0,00
	07.2024	£	286	363	1	0	0,00
	07.2024	TRY	33	1	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2024	\$	5	£	4	\$ 0	0,00	
	07.2024		10	ILS	39	0	0,00	
	07.2024		0	MXN	0	0	0,00	
	07.2024		0	PLN	1	0	0,00	
	08.2024	£	12	\$	15	0	0,00	
	08.2024	PLN	1		0	0	0,00	
	08.2024	\$	0	BRL	0	0	0,00	
	08.2024		329	£	260	0	0,00	
GLM	07.2024	¥	160	\$	1	0	0,00	
	07.2024	MYR	1		0	0	0,00	
	07.2024	\$	0	MYR	1	0	0,00	
	08.2024	MYR	1	\$	0	0	0,00	
	08.2024	TRY	59		2	0	0,00	
	08.2024	\$	2	TRY	57	0	0,00	
	03.2025		30		1.442	4	0,00	
JPM	07.2024	BRL	46	\$	9	1	0,00	
	07.2024	CNY	236		33	0	0,00	
	07.2024	TRY	501		15	(1)	0,00	
	07.2024	\$	1	CNY	4	0	0,00	
	07.2024		52	£	41	0	0,00	
	08.2024		0	BRL	1	0	0,00	
	08.2024		33	CNY	236	0	0,00	
MBC	07.2024	£	332	\$	420	1	0,00	
	07.2024	ILS	37		10	0	0,00	
	07.2024	¥	2.014		13	0	0,00	
	07.2024	PLN	1		0	0	0,00	
	07.2024	\$	2	CNH	15	0	0,00	
	07.2024		0	COP	1.565	0	0,00	
	07.2024		493	£	387	(4)	0,00	
	07.2024		0	HUF	149	0	0,00	
	07.2024		14	¥	2.185	0	0,00	
	07.2024		4	TRY	143	0	0,00	
	08.2024	COP	1.565	\$	0	0	0,00	
	08.2024	\$	370	£	293	0	0,00	
	09.2024		4	TRY	148	0	0,00	
MYI	07.2024	CZK	4	\$	0	0	0,00	
	07.2024	IDR	9.834		1	0	0,00	
	07.2024	\$	0	CZK	4	0	0,00	
	07.2024		4	TRY	129	0	0,00	
	07.2024		0	ZAR	5	0	0,00	
	07.2024	ZAR	5	\$	0	0	0,00	
	08.2024	CNH	10		1	0	0,00	
	08.2024	CZK	4		0	0	0,00	
	08.2024	\$	1	IDR	9.841	0	0,00	
	08.2024	ZAR	5	\$	0	0	0,00	
SCX	07.2024	\$	33	CNY	232	(1)	0,00	
	07.2024		279	£	219	(2)	0,00	
SSB	07.2024		9	BRL	46	(1)	0,00	
	07.2024		1	INR	84	0	0,00	
	07.2024		0	MXN	0	0	0,00	
TOR	07.2024	HUF	149	\$	0	0	0,00	
	07.2024	\$	0	CNH	1	0	0,00	
	08.2024	CNH	1	\$	0	0	0,00	
	08.2024	\$	0	HUF	149	0	0,00	
UAG	07.2024	€	5	\$	5	0	0,00	
	07.2024	INR	2.113		25	0	0,00	
	07.2024	\$	3	£	2	0	0,00	
	07.2024		1	MXN	18	0	0,00	
					\$ 8	\$ (10)	\$ (2)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 250 0,08

Summe Anlagen

\$ 335.374 105,15

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (16.425) (5,15)

Nettovermögen

\$ 318.949 100,00

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 5.239 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 9.867 USD (31. Dezember 2023: 7.361 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.330 USD (31. Dezember 2023: 5.780 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren	Marktwert
	(Stufe 1)	(Stufe 2)	(Stufe 3)	
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 298.129	\$ 13.034	\$ 311.163
Investmentfonds	17.221	0	0	17.221
Pensionsgeschäfte	0	3.392	0	3.392
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(21)	3.619	0	3.598
<b>Summen</b>	<b>\$ 17.200</b>	<b>\$ 305.140</b>	<b>\$ 13.034</b>	<b>\$ 335.374</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren	Marktwert
	(Stufe 1)	(Stufe 2)	(Stufe 3)	
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 250.859	\$ 14.084	\$ 264.943
Investmentfonds	208	628	0	836
Pensionsgeschäfte	0	6.274	0	6.274
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	32	1.297	0	1.329
Einlagen bei Kreditinstituten	0	5.043	0	5.043
<b>Summen</b>	<b>\$ 240</b>	<b>\$ 264.101</b>	<b>\$ 14.084</b>	<b>\$ 278.425</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ 20	\$ 0	\$ 20
BOA	12	850	862	323	(610)	(287)
BPS	(261)	0	(261)	158	0	158
BRC	(141)	260	119	(3.336)	3.320	(16)
BSH	15	0	15	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	385	(310)	75	115	(350)	(235)
DUB	140	(150)	(10)	(238)	0	(238)
FAR	622	(590)	32	(92)	0	(92)
GLM	587	(420)	167	(974)	1.080	106
GST	5	0	5	2	0	2
IND	k. A.	k. A.	k. A.	(113)	80	(33)
JPM	(335)	390	55	20	0	20
MBC	(237)	240	3	(678)	570	(108)
MYC	119	0	119	(5)	0	(5)
MYI	(307)	270	(37)	(255)	20	(235)
RBC	(6)	0	(6)	7	0	7
SCX	72	0	72	292	0	292
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	94	0	94
SSB	(77)	0	(77)	17	0	17
TOR	(444)	320	(124)	(51)	0	(51)
UAG	101	0	101	(1.044)	710	(334)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	75,36	86,38
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	19,46	7,31
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,74	k. A.
Investmentfonds	5,40	0,30
Pensionsgeschäfte	1,06	2,22
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,13	(0,09)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,92	2,59
Freiverkehrsfinanzderivate	0,08	(2,03)
Einlagezertifikate	k. A.	1,78
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(1,86)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Angola	1,03	1,37
Benin	0,18	k. A.
Brasilien	3,43	2,68
Kamerun	0,21	0,23
Cayman-Inseln	2,38	1,15
Chile	3,92	3,95
China	0,00	0,02
Kolumbien	1,39	0,52
Kongo	0,14	0,17
Costa Rica	k. A.	0,31
Tschechische Republik	1,00	1,43
Dänemark	0,46	0,00
Dominikanische Republik	5,77	3,91
Ecuador	1,25	1,38
Ägypten	1,42	1,36
El Salvador	0,46	k. A.
Ghana	0,26	k. A.
Guatemala	0,29	0,33
Hongkong	0,58	0,47
Ungarn	0,51	0,83
Indien	0,81	0,17
Indonesien	0,47	k. A.
Irland	2,42	2,15
Israel	0,44	2,57
Italien	0,61	k. A.
Elfenbeinküste	1,80	0,26
Jamaika	0,20	0,23
Kasachstan	0,31	k. A.
Kenia	0,86	0,41
Lettland	0,49	k. A.
Luxemburg	0,38	0,43
Mexiko	2,46	6,82
Marokko	0,64	k. A.
Niederlande	1,20	0,42
Nigeria	0,19	k. A.
Pakistan	0,68	0,47
Panama	k. A.	0,16
Peru	9,54	3,24
Polen	k. A.	8,42
Rumänien	2,51	1,80
Senegal	0,51	k. A.
Serbien	0,41	0,04
Singapur	0,13	k. A.
Südafrika	9,17	6,45
Südkorea	0,18	0,20
Supranational	0,17	0,19
Tansania	k. A.	0,78
Tunesien	1,94	0,93
Türkei	1,07	1,24
Ukraine	0,25	0,75
Vereinigte Arabische Emirate	2,18	0,19
Großbritannien	3,32	0,61
USA	19,58	18,29
Usbekistan	1,21	0,47
Venezuela	0,87	k. A.
Sambia	0,17	0,18
Kurzfristige Instrumente	5,71	15,71
Investmentfonds	5,40	0,30
Pensionsgeschäfte	1,06	2,22
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,13	(0,09)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,03)	k. A.
Zinsswaps	0,95	2,59

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,20	0,13
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,30)	(0,69)
Zinsswapoptionen	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,16	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,22)	(0,06)
Cross-Currency Swaps	0,07	0,14
Zinsswaps	0,04	(0,01)
Devisenterminkontrakte	0,41	(1,66)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,28)	0,13
Einlagenzertifikate	k. A.	1,78
Sonstige Aktiva und Passiva	(5,15)	1,54
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

30. Juni 2024

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>								<b>ELFENBEINKÜSTE STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>ASERBAIDSCHAN</b>								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>DÄNEMARK</b>				Ivory Coast Government International Bond			
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				Jyske Realkredit A/S				5,250 % fällig am 22.03.2030			
7,230 % fällig am 17.03.2026				1,500 % fällig am 01.10.2053 DKK				€ 100 \$ 98 0,56			
\$ 200 \$ 199 1,14				0 \$ 0 0,00							
				Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				<b>KENIA</b>			
				1,000 % fällig am 01.10.2050				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				1,500 % fällig am 01.10.2053				Republic of Kenya Government International Bond			
				0 0 0,00				17,933 % fällig am			
				0 0 0,00				06.05.2030			
				0 0 0,00				KES 3.100 25 0,14			
				0 0 0,00				18,461 % fällig am			
				0 0 0,00				09.08.2032			
				0 0 0,00				5.000 41 0,24			
				0 0 0,00				Summe Kenia			
				0 0 0,00				66 0,38			
Summe Brasilien				197 1,13							
								<b>AKTIEN</b>			
								<b>LUXEMBURG</b>			
								<b>STAMMAKTIE</b>			
								DrillCo Holding Lux S.A.			
								(b)(i)			
								787 18 0,11			
								Foresea Holding S.A. 'A' (b)			
								311 7 0,04			
								Summe Stammaktien			
								25 0,15			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								<b>FORESEA Holding S.A.</b>			
								7,500 % fällig am 15.06.2030			
								\$ 14 13 0,07			
								Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
								5,250 % fällig am 23.05.2023 <sup>(h)</sup>			
								200 12 0,07			
								25 0,14			
								Summe Luxemburg			
								50 0,29			
								<b>MALAYSIA</b>			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Malaysia Government International Bond			
								2,632 % fällig am 15.04.2031			
								MYR 700 138 0,79			
								3,885 % fällig am 15.08.2029			
								280 60 0,35			
								4,504 % fällig am 30.04.2029			
								150 33 0,19			
								Malaysia Government Investment Issue			
								4,291 % fällig am 14.08.2043			
								20 5 0,03			
								Summe Malaysia			
								236 1,36			
								<b>MEXIKO</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								<b>Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.</b>			
								8,790 % fällig am 09.12.2014 <sup>^</sup>			
								MXN 5.000 0 0,00			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Mexico Government International Bond			
								3,000 % fällig am 03.12.2026 (e)			
								6.096 308 1,77			
								Summe Mexiko			
								308 1,77			
								<b>PANAMA</b>			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Panama Government International Bond			
								3,750 % fällig am 16.03.2025			
								\$ 200 197 1,13			
								<b>PARAGUAY</b>			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Paraguay Government International Bond			
								7,900 % fällig am 09.02.2031			
								PYG 302.000 42 0,24			
								<b>PERU</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Banco de Credito del Peru S.A.			
								4,650 % fällig am 17.09.2024			
								PEN 1.330 345 1,98			
								Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.			
								10,100 % fällig am			
								15.12.2043			
								700 187 1,08			
								532 3,06			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Peru Government International Bond			
								5,350 % fällig am 12.08.2040			
								100 21 0,12			
								6,150 % fällig am 12.08.2032			
								300 76 0,44			



BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>INVESTMENTFONDS</b>				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>							
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (g)	661	\$ 6	0,03	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	15.300	\$ 1.531	8,80
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)	15.103	208	1,20				
		214	1,23				
				Summe Investmentfonds		\$ 1.745	10,03

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 130	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 28.02.2027	\$ (133)	\$ 130	\$ 130	0,75
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (133)	\$ 130	\$ 130	0,75

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	8	\$ (1)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	7	2	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	4	1	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	1	0	0,00
				\$ 2	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 2	0,01

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250 %	18.09.2029	INR 36.590	\$ 2	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,384	20.06.2026	53.300	0	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,384	20.06.2026	96.400	4	0,02
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,397	20.06.2034	24.700	(1)	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,397	20.06.2034	13.700	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	18.09.2029	9.760	(1)	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,621	20.12.2028	8.869	0	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	19.06.2025	¥ 120.000	0	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,232	05.10.2025	150.000	(1)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,350	21.03.2026	5.000	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	18.09.2029	SGD 180	1	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	18.09.2026	2.890	8	0,04
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,322	20.12.2028	324	2	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,250	18.09.2029	THB 10.440	3	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	18.09.2029	10.590	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,770	20.12.2028	979	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	3,000	18.09.2034	220	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	\$ 1.450	57	0,33
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	65	(2)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	90	(3)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	630	(8)	(0,05)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2054	100	(2)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	100	3	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	600	(13)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	4.660	30	0,17
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	1.600	4	0,02
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	700	(2)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	520	(3)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	650	(13)	(0,08)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	300	(4)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	100	2	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830 %	12.10.2053	\$ 100	\$ 1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,085	22.04.2034	100	1	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,130	03.05.2034	100	1	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	100	1	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,455	30.06.2026	1.700	1	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,783	04.01.2027	BRL 2.300	17	0,10
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,795	04.01.2027	800	(6)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,815	04.01.2027	500	(3)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,832	04.01.2027	400	(3)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,840	04.01.2027	600	(4)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,840	04.01.2027	1.000	7	0,02
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	9,842	04.01.2027	900	(6)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,946	04.01.2027	400	3	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,044	02.01.2029	1.200	(11)	(0,06)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,164	02.01.2026	300	2	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,225	04.01.2027	300	(2)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,235	04.01.2027	300	(2)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,491	02.01.2025	800	1	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,529	02.01.2026	1.000	3	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,565	04.01.2027	300	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,670	02.01.2025	9.800	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,671	04.01.2027	1.600	6	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,691	02.01.2026	1.600	(4)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,768	04.01.2027	500	2	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,792	04.01.2027	3.900	(17)	(0,09)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,872	04.01.2027	800	3	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,880	04.01.2027	1.300	4	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,943	04.01.2027	700	2	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,980	04.01.2027	1.000	(3)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,133	04.01.2027	700	2	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,280	02.01.2026	90	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,773	02.01.2025	200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,928	02.01.2029	1.100	2	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024	1.300	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024	1.400	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,569	02.01.2029	200	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024	1.200	1	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024	2.600	4	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,241	02.01.2025	200	(1)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	18.09.2029	CNY 2.360	(3)	(0,02)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,405	20.12.2028	1.682	(2)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,040	13.01.2031	COP 1.002.000	54	0,31
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,200	18.09.2030	514.560	(11)	(0,06)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,500	15.02.2025	112.850	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,620	26.02.2034	413.400	(3)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,705	26.03.2031	548.600	3	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,800	30.06.2032	112.500	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,960	01.09.2028	540.900	(2)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,020	04.12.2030	235.500	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,155	24.06.2029	52.900	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,168	17.06.2029	14.800	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,190	13.06.2029	494.700	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,215	14.11.2028	144.600	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,340	26.02.2026	1.520.600	2	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,380	28.06.2034	220.000	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,470	21.06.2026	541.000	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,500	04.04.2026	660.000	1	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,500	09.04.2026	127.000	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,515	09.04.2026	253.900	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,580	28.06.2026	788.000	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,600	11.04.2026	267.500	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,620	10.04.2026	100.100	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,650	17.06.2026	349.300	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,653	11.04.2026	162.300	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,860	12.04.2026	248.000	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,890	12.05.2029	269.000	2	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,920	12.04.2026	248.000	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,940	24.03.2030	291.130	(2)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,050	15.04.2026	151.900	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,050	02.05.2033	35.360	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,055	26.08.2026	200.000	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,370	17.03.2030	73.900	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,393	21.03.2030	172.000	(2)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,470	01.07.2025	285.000	0	0,00
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,792	06.11.2028	ILS 130	(1)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,192	20.06.2034	KRW 77.810	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	18.09.2029	100.920	0	0,00
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,302	20.06.2026	393.150	0	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,820	20.12.2028	155.405	1	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,067	21.12.2026	ZAR 3.100	5	0,03
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,635	04.02.2027	3.290	(6)	(0,03)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,205 %	22.04.2027	ZAR 1.200	\$ 1	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027	900	1	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,565	22.03.2026	2.900	1	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,881	09.02.2026	10.500	(1)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,100	05.06.2026	2.100	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,185	31.07.2026	3.500	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,195	21.12.2026	5.500	1	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,210	21.12.2026	1.600	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	13.07.2025	1.000	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,440	02.11.2028	300	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	17.10.2027	8.760	7	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,599	05.06.2029	1.000	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,650	31.01.2030	200	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,735	31.01.2030	400	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,820	31.01.2030	860	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,455	31.01.2030	1.800	5	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,215	14.01.2030	CLP 86.260	12	0,07
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,640	01.10.2028	245.000	7	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,695	14.02.2029	21.800	1	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,775	23.02.2026	298.300	3	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,800	13.02.2026	54.800	1	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,920	13.02.2034	13.100	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,940	01.10.2028	40.000	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,980	01.10.2028	40.000	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	23.02.2034	70.300	(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,070	24.06.2031	110.600	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030	37.210	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,250	20.03.2028	95.100	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	5,250	13.05.2033	22.500	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,313	25.04.2034	33.900	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,350	01.09.2030	37.500	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	28.06.2026	298.000	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	26.04.2034	21.100	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	01.04.2033	22.100	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	16.11.2033	17.400	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,450	28.06.2034	73.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,470	01.09.2030	50.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,500	13.11.2028	78.200	(1)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,550	05.06.2028	81.300	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,631	23.08.2028	56.700	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,690	01.09.2030	2.400	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	5,750	13.05.2034	23.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,780	03.10.2028	19.400	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,790	06.10.2033	18.000	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,855	05.10.2033	46.000	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,870	11.10.2033	18.200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,920	02.10.2028	36.000	(1)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,940	20.10.2033	8.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,990	20.10.2033	76.260	(4)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,146	30.10.2032	125.400	(7)	(0,04)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,235	26.10.2033	37.300	(3)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,370	29.06.2029	39.000	2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,380	03.06.2027	116.000	4	0,02
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,534	21.03.2029	CZK 1.900	2	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	3,645	01.02.2029	4.000	(4)	(0,02)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR	3,765	09.01.2029	1.400	(1)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,130	03.06.2029	500	0	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,388	15.11.2028	3.700	3	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	4.390	(4)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	20.03.2044	€ 5	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	50	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	100	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	25	0	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.03.2054	20	0	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029	100	(1)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029	100	1	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,100	20.09.2030	70	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	200	1	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	5,735	14.03.2029	HUF 1.100	0	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6,140	15.02.2034	11.600	0	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,220	15.02.2026	57.000	1	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month HUF-BBR	6,299	10.06.2029	10.900	0	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6,400	28.03.2029	18.400	0	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,450	06.06.2029	9.300	0	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6,500	02.04.2029	10.000	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month HUF-BBR	6,590	07.05.2029	9.400	0	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	7,330	06.11.2028	54.200	6	0,03
Zahlung	6-Month HUF-BBR	7,610	03.11.2028	24.000	6	0,03
Erhalt	6-Month HUF-BBR	7,840	07.02.2033	6.600	(1)	(0,01)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	8,740	28.04.2028	15.800	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	13,600	12.12.2024	5.100	(1)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,980 %	09.06.2030	PLN 300	\$ 15	0,09
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,950	13.12.2026	1.500	14	0,08
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027	800	7	0,04
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,320	09.03.2027	150	1	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,560	06.11.2028	1.040	(1)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,660	19.02.2029	100	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,730	16.02.2029	200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,735	09.10.2028	300	(1)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,810	16.02.2029	200	(1)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,923	22.03.2029	300	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,087	28.06.2034	125	0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,335	28.06.2026	500	0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,340	28.03.2027	100	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,430	16.03.2028	570	(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,520	20.03.2026	500	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,620	21.03.2026	300	0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024	3.000	(30)	(0,17)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,705	16.02.2029	MXN 30	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,728	22.05.2028	2.350	5	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,739	13.03.2034	380	1	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	28-Day MXN-TIIE	9,022	27.03.2034	300	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,270	23.03.2027	3.700	4	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,295	30.10.2028	550	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,696	23.03.2026	5.100	(3)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,705	23.03.2026	2.600	(2)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,710	11.04.2029	700	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,740	03.09.2026	6.600	2	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,740	11.04.2029	800	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,760	23.03.2026	1.500	(1)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,763	20.03.2026	3.500	(2)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,800	15.06.2029	5.300	3	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	10,285	20.04.2026	5.400	1	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	28-Day MXN-TIIE	10,310	08.06.2026	2.200	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	10,560	19.06.2026	11.500	(3)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	10,900	04.06.2025	2.080	0	0,00
					\$ 127	0,73
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 127</b>	<b>0,73</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 18,100	11.07.2024	93	\$ 1	\$ 1	0,00
	Put - OTC USD versus ZAR	18,300	11.07.2024	93	1	1	0,01
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,275	06.12.2024	13	2	3	0,02
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	06.12.2024	11	1	2	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	06.12.2024	16	1	2	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	14.01.2025	13	1	2	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	14.01.2025	16	1	2	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	23.01.2025	16	1	2	0,01
BRC	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	8	1	1	0,01
CBK	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.01.2025	16	2	3	0,02
	Call - OTC USD versus CNH	7,450	14.02.2025	16	1	2	0,01
GLM	Call - OTC USD versus JPY	¥ 167,000	05.11.2024	72	4	11	0,06
JPM	Put - OTC EUR versus PLN	PLN 4,400	22.08.2024	15	4	13	0,08
MBC	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,350	06.12.2024	13	1	3	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	1	0	0	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,375	14.02.2025	16	2	2	0,01
MYI	Call - OTC USD versus JPY	¥ 168,000	29.10.2024	11	1	2	0,01
SCX	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,300	14.02.2025	5	1	1	0,01
					\$ 26	\$ 53	0,30

##### STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs <sup>(2)</sup>	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten <sup>(2)</sup>	Marktwert	% des Nettvermögens
MYI	Call & Put - OTC 3-Month vs. 9-Month Forward Volatility Agreement	14,500 %	25.10.2024	100	\$ 0	\$ 0	0,00

**VERKAUFSOPTIONEN****DEVISENOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
BOA	Call - OTC USD versus TRY	TRY	01.11.2024	51	\$ (1)	\$ (1)	0,00	
	Call - OTC USD versus TRY		28.01.2025	121	(4)	(3)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY		01.05.2025	50	(2)	(2)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR	11.07.2024	186	(1)	0	0,00	
CBK	Put - OTC USD versus ZAR		11.07.2024	186	(1)	(1)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus MXN	MXN	01.07.2024	100	(3)	(5)	(0,03)	
	Put - OTC USD versus MXN		01.07.2024	100	(3)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	TRY	03.04.2025	80	(1)	(2)	(0,01)	
DUB	Call - OTC USD versus TRY		28.10.2024	26	(3)	(1)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY		28.10.2024	26	(3)	(3)	(0,02)	
GLM	Put - OTC USD versus TRY		04.07.2024	59	(1)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY		03.10.2024	74	(1)	(2)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY		30.10.2024	26	(3)	(1)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY		30.10.2024	26	(3)	(3)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY		31.10.2024	13	(1)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY		31.10.2024	13	(1)	(1)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY		07.11.2024	13	(1)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY		07.11.2024	13	(1)	(1)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY		07.11.2024	13	(1)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY		07.11.2024	13	(1)	(2)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus TRY		11.11.2024	13	(1)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY		11.11.2024	13	(1)	(2)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY		03.01.2025	59	(2)	(1)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY		07.01.2025	60	(2)	(1)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY		09.01.2025	60	(1)	(1)	(0,01)	
	MYI	Call - OTC USD versus IDR	IDR	13.08.2024	114	(4)	(7)	(0,05)
		Put - OTC USD versus IDR		13.08.2024	114	(4)	0	0,00
					\$ (51)	\$ (40)	(0,23)	

**ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700 %	04.07.2024	200	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	200	0	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	100	(1)	(1)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	100	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	100	0	0	0,00
							\$ (2)	\$ (1)	(0,01)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>**

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.06.2029	\$ 50	\$ 1	\$ 1	\$ 2	0,01
BRC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	50	1	1	2	0,01
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	50	0	0	0	0,00
CBK	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	90	(2)	(1)	(3)	(0,02)
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	100	1	(1)	0	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	100	3	0	3	0,02
					\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,02

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>**

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.06.2029	\$ 100	\$ (5)	\$ 1	\$ (4)	(0,02)
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2029	100	(4)	0	(4)	(0,02)
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2029	100	(4)	0	(4)	(0,02)
	Israel Government International Bond	1,000	20.12.2025	100	0	0	0	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	100	(2)	2	0	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2029	100	(5)	0	(5)	(0,03)
MYC	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2029	25	(1)	0	(1)	(0,01)
					\$ (21)	\$ 3	\$ (18)	(0,10)

(1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

- (2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnahmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	\$ 205	PHP 12.071	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	(0,03)
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,428% basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	60	ARS 2.693	0	59	59	0,34
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,053 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	4	PHP 220	0	0	0	0,00
MBC	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS zzgl. 0,068 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	INR 6.741	\$ 80	0	1	1	0,01
SCX	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS zzgl. 0,068 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	18.09.2029	13.198	157	0	1	1	0,01
						\$ 0	\$ 58	\$ 58	0,33

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750 %	18.09.2029	MYR 180	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,868	20.12.2028	231	1	0	1	0,01
BPS	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	360	1	(1)	0	0,00
CBK	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	110	0	0	0	0,00
GLM	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029	CLP 11.100	0	(1)	(1)	(0,01)
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2029	MYR 315	0	0	0	0,00
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,868	20.12.2028	700	2	0	2	0,01
JPM	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	110	0	0	0	0,00
	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2029	210	0	0	0	0,00
SCX	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	910	2	(1)	1	0,01
						\$ 6	\$ (3)	\$ 3	0,02

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	\$ 6	NZD 10	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	NZD 10	\$ 6	0	0	0	0,00
	10.2024	CNH 436	61	1	0	1	0,00
BOA	07.2024	DOP 714	12	0	0	0	0,00
	07.2024	HUF 10.212	28	0	0	0	0,00
	07.2024	PLN 970	240	1	(2)	(1)	(0,01)
	07.2024	SGD 117	86	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 96	£ 76	0	0	0	0,00
	07.2024	15	HUF 5.694	0	0	0	0,00
	07.2024	463	KRW 632.770	0	(3)	(3)	(0,02)
	07.2024	114	PLN 457	0	0	0	0,00
	08.2024	¥ 210.000	\$ 1.367	52	0	52	0,30

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	\$	15	PKR	4.328	\$ 0	0,00
	08.2024		7	TRY	234	0	0,00
	11.2024	TRY	323	\$	8	0	0,00
	11.2024	ZMW	128		5	0	0,00
	01.2025	TRY	883		20	(1)	(0,01)
	02.2025	CNH	221		31	0	0,00
	02.2025	EGP	7.478		147	5	0,03
BPS	05.2025	TRY	421		9	(1)	0,00
	07.2024	AUD	14		9	0	0,00
	07.2024	BRL	264		51	3	0,02
	07.2024	CAD	147		108	0	0,00
	07.2024	CLP	32.193		34	0	0,00
	07.2024	£	275		351	4	0,02
	07.2024	INR	3.780		45	0	0,00
	07.2024	PLN	445		110	1	0,00
	07.2024	\$	87	BRL	459	(4)	(0,03)
	07.2024		47	CAD	65	0	0,00
	07.2024		34	CLP	32.193	0	0,00
	07.2024		27	€	25	0	0,00
	07.2024		112	¥	17.500	(4)	(0,02)
	07.2024		463	KRW	635.596	(1)	(0,01)
	07.2024		797	PLN	3.218	(2)	0,02
	07.2024		544	SGD	737	0	0,00
	07.2024		814	THB	29.966	4	0,02
	08.2024	SGD	736	\$	544	0	0,00
	08.2024	\$	9	AUD	14	0	0,00
	08.2024		12	TRY	432	0	0,00
	09.2024	CNH	325	\$	45	1	0,00
	09.2024	COP	221.980		55	2	0,01
	09.2024	\$	38	CLP	35.021	(1)	(0,01)
	09.2024		848	MXN	15.801	6	0,03
	09.2024		476	TWD	15.308	(3)	(0,02)
	10.2024	CNH	150	\$	21	0	0,00
	10.2024	\$	88	CNH	630	(1)	0,00
	12.2024		52		373	0	0,00
	12.2024		29	EGP	1.398	(2)	(0,01)
	01.2025	CNH	414	\$	58	0	0,00
BRC	05.2029	KWD	93		321	9	0,05
	07.2024	CZK	2.287		99	1	0,01
	07.2024	€	28		30	0	0,00
	07.2024	PLN	222		55	0	0,00
	07.2024	\$	46	INR	3.849	0	0,00
	07.2024		4	NOK	39	0	0,00
	07.2024		196	PLN	788	(1)	0,00
	07.2024		309	RON	1.423	(2)	(0,01)
	07.2024		27	SGD	36	0	0,00
	07.2024		23	THB	842	0	0,00
	07.2024		713	TRY	24.261	11	0,06
	08.2024	TRY	900	\$	26	0	0,00
	08.2024	\$	137	TRY	4.816	2	0,01
	09.2024	MXN	3.293	\$	176	(2)	(0,01)
	09.2024	TRY	712		19	(1)	(0,01)
	09.2024	\$	141	MXN	2.636	1	0,01
	09.2024		30	TRY	1.113	2	0,01
	10.2024	TRY	577	\$	15	(1)	(0,01)
	10.2024	\$	31	CNH	225	0	0,00
	11.2024		12	TRY	468	1	0,00
	01.2025	TRY	2.241	\$	54	(2)	(0,01)
	01.2025	\$	16	TRY	706	1	0,01
	02.2025		31	CNH	221	0	0,00
CBK	04.2025	TRY	686	\$	15	(1)	(0,01)
	05.2025	\$	9	TRY	421	0	0,00
	07.2024	BRL	948	\$	175	5	0,03
	07.2024	CHF	9		10	0	0,00
	07.2024	CLP	16.560		18	0	0,00
	07.2024	PEN	198		53	1	0,01
	07.2024	PLN	292		72	(1)	0,00
	07.2024	SEK	301		28	0	0,00
	07.2024	\$	190	BRL	1.034	(3)	(0,02)
	07.2024		44	€	40	(1)	0,00
	07.2024		29	£	23	0	0,00
	07.2024		4	KES	552	0	0,00
	07.2024		319	MXN	5.831	(2)	(0,01)
	07.2024		4	NGN	6.833	0	0,00
	07.2024		17	PHP	997	0	0,00
	07.2024		148	PLN	584	(3)	(0,01)
	07.2024		18	SEK	185	0	0,00
	07.2024		23	TRY	780	0	0,00
	07.2024		27	UYU	1.081	0	0,00
	07.2024		59	ZAR	1.066	0	0,00
	07.2024	UYU	1.789	\$	46	1	0,01
	07.2024	ZAR	381		21	0	0,00
	08.2024	EGP	722		15	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	\$	128	BRL	702	\$ 0	(0,01)
	09.2024	BRL	546	\$	99	0	0,01
	09.2024	MXN	1.328		70	(2)	(0,01)
	09.2024	PEN	607		163	0	0,03
	09.2024	\$	766	INR	64.062	0	0,00
	09.2024		180	TWD	5.799	0	0,00
	09.2024	UYU	1.226	\$	31	0	0,00
	10.2024	\$	32	COP	139.584	1	0,01
	12.2024		14	EGP	659	0	0,00
	01.2025		58	CNH	414	0	0,00
	01.2025		32	COP	141.056	1	0,01
	02.2025	UGX	24.930	\$	6	0	0,00
	04.2025	\$	32	COP	143.520	1	0,01
	04.2025		15	TRY	685	1	0,00
	05.2025	KES	3.835	\$	26	(1)	0,00
	06.2025	EGP	1.094		20	0	0,00
	10.2025	\$	16	COP	77.952	2	0,01
DUB	07.2024	BRL	408	\$	78	5	0,03
	07.2024	CLP	169.001		183	4	0,02
	07.2024	NGN	8.308		7	1	0,01
	07.2024	TRY	3.214		95	0	0,00
	07.2024	\$	23	EGP	1.107	0	0,00
	07.2024		259	KRW	356.431	0	0,00
	07.2024		519	MYR	2.448	0	0,00
	07.2024		25	PLN	98	0	0,00
	08.2024	BRL	1.471	\$	277	13	0,07
	08.2024	€	185	PLN	854	15	0,08
	09.2024	KZT	5.614	\$	12	0	0,00
	09.2024	\$	5	KZT	2.520	0	0,00
	10.2024	CNH	131	\$	18	0	0,00
	10.2024	\$	9	TRY	357	1	0,00
	11.2024	¥	7.872	\$	56	6	0,03
	11.2024	ZMW	129		5	0	0,00
	02.2025	UGX	79.123		20	(1)	(0,01)
FAR	02.2025	\$	8	PKR	2.400	0	0,00
	07.2024	€	878	\$	956	16	0,09
	07.2024	NZD	118		73	1	0,00
	07.2024	\$	9	AUD	14	0	0,00
	07.2024		12	NZD	20	0	0,00
GLM	08.2024	NZD	20	\$	12	0	0,00
	07.2024	BRL	1.278		235	5	0,03
	07.2024	CLP	103.713		113	3	0,02
	07.2024	PLN	213		53	0	0,00
	07.2024	\$	78	CLP	72.836	0	0,00
	07.2024		208	DOP	12.233	0	(0,01)
	07.2024		64	MXN	1.148	0	(0,01)
	07.2024		52	PEN	198	0	0,00
	07.2024		20	PLN	81	0	0,00
	07.2024		119	TRY	4.056	3	0,02
	07.2024		10	UYU	383	0	0,00
	07.2024	UYU	383	\$	10	0	0,00
	07.2024	ZAR	6.324		346	0	0,00
	08.2024	DOP	14.115		237	0	(0,01)
	08.2024	TRY	466		14	0	0,00
	08.2024	\$	943	BRL	4.862	0	(0,41)
	08.2024		26	COP	112.372	1	0,01
	09.2024	DOP	12.915	\$	215	0	(0,01)
	09.2024	KZT	5.148		11	0	0,00
	09.2024	PEN	198		52	0	0,00
	09.2024	\$	140	TRY	5.405	15	0,09
	09.2024		17	UYU	673	0	0,00
	10.2024		90	BRL	496	0	(0,01)
	10.2024		24	TRY	936	2	0,01
	11.2024		56	¥	7.881	0	(0,03)
	11.2024		19	TRY	757	2	0,01
	12.2024		30	EGP	1.523	0	0,00
	01.2025		54	TRY	2.241	2	0,01
	03.2025		106		5.054	14	0,08
	04.2025		66	COP	301.521	4	0,02
IND	06.2025	EGP	1.604	\$	30	1	0,01
JPM	07.2024	¥	2.700		17	0	0,00
	07.2024	CNY	8.845		1.240	14	0,08
	07.2024	CZK	1.191		51	0	0,00
	07.2024	€	22		24	0	0,00
	07.2024	KES	1.516		12	0	0,00
	07.2024	PLN	381		94	0	(0,01)
	07.2024	SGD	657		488	3	0,02
	07.2024	TRY	679		20	0	(0,01)
	07.2024	\$	97	CHF	86	0	(0,01)
	07.2024		23	CNY	162	0	0,00
	07.2024		62	€	57	0	(0,01)
	07.2024		597	IDR	9.686.323	0	(0,03)
	07.2024		310	KRW	427.146	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$	71 PLN	284	\$ 0	\$ (1)	0,00
	07.2024		9 UYU	354	0	0	0,00
	07.2024		26 ZAR	474	0	0	0,00
	07.2024	ZAR	11.979 \$	651	0	(5)	(0,03)
	08.2024	CHF	43	48	0	0	0,00
	08.2024	€	55 PLN	235	0	0	0,00
	08.2024	PLN	852 €	185	0	(14)	(0,07)
	08.2024	TRY	2.630 \$	76	0	0	0,00
	08.2024	\$	1.240 CNY	8.851	0	0	0,00
	08.2024		56 COP	242.186	2	0	0,01
	08.2024		3 NGN	4.023	0	0	0,00
	08.2024		6 PKR	1.774	0	0	0,00
	08.2024		28 TRY	1.017	1	0	0,01
	09.2024	COP	64.639 \$	15	0	0	0,00
	09.2024	€	36 PLN	171	4	0	0,02
	09.2024	PLN	79 €	17	0	(1)	(0,01)
	09.2024	\$	43 CLP	39.337	0	(2)	(0,01)
	09.2024		9 EGP	425	0	0	0,00
	09.2024		122 INR	10.241	0	0	0,00
	09.2024		311 TWD	10.017	0	(2)	(0,01)
	10.2024	CNH	570 \$	80	1	0	0,01
	11.2024	\$	19 TRY	752	1	0	0,01
	12.2024	CNH	373 \$	52	0	0	0,00
	12.2024	\$	18 EGP	872	0	(1)	(0,01)
	01.2025		4 TRY	176	0	0	0,00
MBC	07.2024	HUF	99.564 \$	267	0	(3)	(0,02)
	07.2024	INR	9.700	116	0	(1)	0,00
	07.2024	¥	33.090	212	7	0	0,04
	07.2024	NOK	178	17	0	0	0,00
	07.2024	PLN	83	21	0	0	0,00
	07.2024	\$	23 AUD	34	0	0	0,00
	07.2024		60 CAD	82	0	0	0,00
	07.2024		18 CHF	16	0	0	0,00
	07.2024		752 CZK	17.342	0	(11)	(0,06)
	07.2024		741 €	693	1	0	0,01
	07.2024		170 £	134	0	0	0,00
	07.2024		94 ¥	14.900	0	(1)	(0,01)
	07.2024		3 PLN	12	0	0	0,00
	07.2024		28 UYU	1.106	0	0	0,00
	07.2024	UYU	2.212 \$	56	0	0	0,00
	08.2024	CAD	82	60	0	0	0,00
	08.2024	EGP	1.446	30	0	0	0,00
	08.2024	€	671	718	0	(2)	(0,01)
	08.2024	£	117	148	0	0	0,00
	08.2024	\$	17 NOK	178	0	0	0,00
	09.2024		4 TWD	141	0	0	0,00
	09.2024		9 UYU	354	0	0	0,00
	09.2024	UYU	1.106 \$	28	1	0	0,00
	10.2024	CNH	167	23	0	0	0,00
	10.2024	\$	178 CNH	1.276	0	(1)	(0,01)
	12.2024	CNH	357 \$	50	1	0	0,00
	12.2024	\$	50 CNH	357	0	(1)	0,00
	02.2025	UGX	88.722 \$	22	0	(1)	(0,01)
	02.2025	\$	126 EGP	7.478	17	0	0,09
MYI	07.2024	BRL	520 \$	99	6	0	0,03
	07.2024	INR	20.254	242	0	(1)	(0,01)
	07.2024	NOK	51	5	0	0	0,00
	07.2024	PLN	386	97	1	0	0,00
	07.2024	\$	373 BRL	2.010	0	(12)	(0,06)
	07.2024		94 €	88	0	0	0,00
	07.2024		53 £	42	0	0	0,00
	07.2024		25 ¥	3.744	0	(2)	(0,01)
	07.2024		45 NZD	73	0	0	0,00
	07.2024		54 PLN	216	0	0	0,00
	07.2024		11 SEK	116	0	0	0,00
	08.2024	SEK	116 \$	11	0	0	0,00
	08.2024	\$	54 BRL	298	0	(1)	0,00
	08.2024		21 IDR	322.770	0	(1)	(0,01)
	08.2024		5 NOK	51	0	0	0,00
	09.2024		68 INR	5.716	0	0	0,00
	09.2024		96 MXN	1.797	1	0	0,01
	09.2024		125 TWD	4.004	0	(1)	(0,01)
	10.2024		37 ¥	5.697	0	(1)	(0,01)
RBC	07.2024		12 BRL	64	0	0	0,00
	07.2024		111 €	102	0	(2)	(0,01)
	07.2024		23 PHP	1.349	0	0	0,00
RYL	07.2024	AUD	34 \$	23	0	0	0,00
	07.2024	€	169	181	0	0	0,00
	10.2024	¥	5.701	37	1	0	0,01
SCX	07.2024	BRL	150	28	1	0	0,00
	07.2024	MYR	21	4	0	0	0,00
	07.2024	PEN	1.387	370	8	0	0,05

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens	
	07.2024	\$	1.220 CNY	8.677	\$ 0	\$ (18)	(0,10)	
	07.2024		134 €	125	0	0	0,00	
	07.2024		94 ¥	14.800	0	(2)	(0,01)	
	07.2024		7 KES	964	0	0	0,00	
	07.2024		257 KRW	350.599	0	(2)	(0,01)	
	07.2024		0 MXN	4	0	0	0,00	
	07.2024		10 NGN	15.124	0	0	0,00	
	07.2024		18 NOK	190	0	0	0,00	
	07.2024		26 PEN	98	0	0	0,00	
	07.2024	ZAR	2.162 \$	117	0	(1)	(0,01)	
	08.2024	NGN	10.188	7	0	0	0,00	
	08.2024	UGX	33.533	9	0	0	0,00	
	08.2024	\$	25 COP	108.200	1	0	0,01	
	08.2024		2 EGP	106	0	0	0,00	
	08.2024		4 NGN	6.165	0	0	0,00	
	09.2024	CNH	102 \$	14	0	0	0,00	
	09.2024	KZT	2.304	5	0	0	0,00	
	09.2024	\$	8 EGP	418	0	0	0,00	
	09.2024		297 INR	24.826	0	0	0,00	
	09.2024		5 KZT	2.304	0	0	0,00	
	09.2024		187 PHP	10.983	1	0	0,00	
	09.2024		185 TWD	5.949	0	(1)	0,00	
	12.2024	EGP	3.597 \$	72	2	0	0,01	
	12.2024	\$	22 EGP	1.074	0	(1)	(0,01)	
SOG	07.2024	RSD	6.027 \$	55	0	0	0,00	
	09.2024	\$	23 EGP	1.140	0	0	0,00	
SSB	07.2024	€	61 \$	66	1	0	0,00	
	07.2024	IDR	488.770	30	0	0	0,00	
	07.2024	PLN	186	46	0	0	0,00	
	09.2024	PEN	100	27	1	0	0,01	
	09.2024	\$	19 TWD	612	0	0	0,00	
TOR	07.2024		9 NZD	15	0	0	0,00	
	08.2024	COP	1.093.630 \$	273	11	0	0,06	
	08.2024	NZD	15	9	0	0	0,00	
UAG	07.2024	CHF	93	103	0	(1)	0,00	
	07.2024	\$	244 ILS	906	0	(4)	(0,02)	
					\$ 341	\$ (252)	\$ 89	0,52
Summe Freiverkehrsfinanzderivate							\$ 148	0,85
Summe Anlagen							\$ 17.465	100,40
Sonstige Aktiva und Passiva							\$ (69)	(0,40)
Nettovermogen							\$ 17.396	100,00

### ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschrankte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 1,06 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fallig am 21.10.2024	07.10.2021	\$ 215	\$ 174	1,00
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	16	18	0,11
Flourish Century 6,600 % fallig am 04.02.2022	25.08.2021	197	8	0,04
		\$ 428	\$ 200	1,15

Barmittel in Hohe von 332 USD (31. Dezember 2023: 305 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 15.248	\$ 65	\$ 15.313
Investmentfonds	1.745	0	0	1.745
Pensionsgeschäfte	0	130	0	130
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	277	0	277
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.745</b>	<b>\$ 15.655</b>	<b>\$ 65</b>	<b>\$ 17.465</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 17.495	\$ 268	\$ 17.763
Investmentfonds	311	1.526	0	1.837
Pensionsgeschäfte	0	158	0	158
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	5	415	0	420
Einlagen bei Kreditinstituten	0	363	0	363
<b>Summen</b>	<b>\$ 316</b>	<b>\$ 19.957</b>	<b>\$ 268</b>	<b>\$ 20.541</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 1	k. A.	k. A.	k. A.
BOA	49	0	49	\$ (72)	\$ 0	\$ (72)
BPS	29	0	29	92	0	92
BRC	6	0	6	63	0	63
BSH	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
CBK	k. A.	k. A.	k. A.	43	0	43
DUB	38	0	38	5	0	5
FAR	17	0	17	(1)	0	(1)
GLM	14	0	14	228	(270)	(42)
GST	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
IND	k. A.	k. A.	k. A.	(11)	0	(11)
JPM	0	0	0	27	0	27
MBC	12	0	12	(44)	0	(44)
MYC	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(16)	0	(16)	(33)	0	(33)
RBC	(2)	0	(2)	1	0	1
RYL	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	(9)	0	(9)	54	0	54
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
SSB	2	0	2	3	0	3
TOR	11	0	11	(2)	0	(2)
UAG	(5)	0	(5)	(67)	0	(67)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	57,66	77,08
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	29,77	10,53
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,60	1,44
Investmentfonds	10,03	9,21
Pensionsgeschäfte	0,75	0,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,73	0,67
Freiverkehrsfinanzderivate	0,85	1,41
Einlagenzertifikate	k. A.	1,82

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

30. Juni 2024

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Aserbaidschan	1,14	1,00
Brasilien	1,13	1,13
Cayman-Inseln	1,17	0,05
Chile	2,50	3,12
China	0,07	0,55
Kolumbien	2,50	1,99
Tschechische Republik	0,52	0,48
Dänemark	0,00	0,00
Dominikanische Republik	2,43	2,24
Ecuador	0,11	0,33
Ungarn	0,54	0,15
Indien	0,69	k. A.
Indonesien	1,14	k. A.
Irland	2,49	1,30
Israel	0,63	1,13
Elfenbeinküste	0,56	k. A.
Jersey, Kanalinseln	k. A.	0,55
Kenia	0,38	k. A.
Luxemburg	0,29	0,26
Malaysia	1,36	0,45
Mexiko	1,77	2,52
Panama	1,13	k. A.
Paraguay	0,24	k. A.
Peru	4,05	2,75
Philippinen	0,44	k. A.
Polen	k. A.	2,17
Rumänien	0,59	0,68
Singapur	10,61	k. A.
Südafrika	9,63	7,68
Südkorea	1,15	1,01
Supranational	4,73	k. A.
Thailand	0,01	0,01
Türkei	1,15	k. A.
Großbritannien	1,85	0,64
USA	4,89	4,54
Uruguay	1,10	0,11
Usbekistan	0,28	k. A.
Sambia	0,12	0,19
Kurzfristige Instrumente	24,64	52,02
Investmentfonds	10,03	9,21
Pensionsgeschäfte	0,75	0,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,08)
Zinsswaps	0,73	0,75
Freiverkehrsinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,30	0,10
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,23)	(0,47)
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,02	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,10)	0,00
Cross-Currency Swaps	0,33	1,11
Zinsswaps	0,02	0,01
Devisenterminkontrakte	0,52	0,67
Einlagenzertifikate	k. A.	1,82
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,40)	(2,98)
Nettovermögen	100,00	100,00





BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
4,498 % fällig am 10.08.2035	\$ 1.600	\$ 1.424	0,49	Worldwide Plaza Trust	\$ 1.795	\$ 340	0,12	Soundview Home Loan Trust	\$ 515	\$ 485	0,17
4,715 % fällig am 10.08.2033	2.190	1.889	0,65	3,715 % fällig am 10.11.2036				5,960 % fällig am 25.10.2036			
5,122 % fällig am 10.08.2035	550	465	0,16			32.774	11,35	6,435 % fällig am 25.05.2035	1.405	1.240	0,43
Bear Stearns ALT-A Trust				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>							
5,780 % fällig am 25.06.2046	720	623	0,22	Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Structured Asset Investment Loan Trust			
Bridgeway Funding PLC				6,510 % fällig am 25.05.2035	1.275	1.133	0,39	6,435 % fällig am 25.05.2035	1.405	1.240	0,43
9,233 % fällig am 16.10.2062	£ 950	1.229	0,43	Argent Securities Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
10,233 % fällig am 16.10.2062	950	1.223	0,42	5,760 % fällig am 25.06.2036	1.967	562	0,19	5,895 % fällig am 25.07.2036	1.329	1.280	0,44
Commercial Mortgage Trust				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				7,081 % fällig am 25.05.2031	63	48	0,02
3,960 % fällig am 10.02.2036	\$ 3.000	2.794	0,97	5,960 % fällig am 25.08.2036	1.287	1.169	0,41	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				6,585 % fällig am 25.02.2035	51	50	0,02	6,460 % fällig am 25.10.2034	1.033	1.031	0,36
5,593 % fällig am 19.03.2037	1.234	1.024	0,35	BNC Mortgage Loan Trust						17.326	6,00
EMF-UK PLC				4,492 % fällig am 25.10.2036	99	68	0,02	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
6,333 % fällig am 13.03.2046	£ 2.663	3.362	1,17	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				Brazil Government International Bond			
Great Hall Mortgages PLC				5,600 % fällig am 25.06.2047	64	57	0,02	6,125 % fällig am 15.03.2034	800	770	0,27
5,613 % fällig am 18.06.2038	1.957	2.450	0,85	5,980 % fällig am 25.12.2036	270	252	0,09	Chile Government International Bond			
Independence Plaza Trust				First Franklin Mortgage Loan Trust				2,750 % fällig am 31.01.2027	300	283	0,10
3,763 % fällig am 10.07.2035	\$ 345	330	0,11	5,013 % fällig am 25.03.2036	1.449	1.356	0,47	3,500 % fällig am 31.01.2034	300	261	0,09
3,911 % fällig am 10.07.2035	1.940	1.846	0,64	6,210 % fällig am 25.12.2035	868	830	0,29	Fondo MIVIVIENDA S.A.			
4,158 % fällig am 10.07.2035	132	125	0,04	Golub Capital Partners CLO Ltd.				4,625 % fällig am 12.04.2027	300	292	0,10
4,356 % fällig am 10.07.2035	1.050	984	0,34	6,641 % fällig am 25.10.2034	1.300	1.300	0,45	Hungary Government International Bond			
Madison Avenue Mortgage Trust				GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust				4,000 % fällig am 25.07.2029	€ 1.300	1.383	0,48
3,478 % fällig am 15.08.2034	690	627	0,22	5,520 % fällig am 22.02.2055	627	604	0,21	Mexico Government International Bond			
3,600 % fällig am 15.08.2034	225	197	0,07	GSAMP Trust				2,250 % fällig am 12.08.2036	870	710	0,25
4,108 % fällig am 15.08.2034	1.900	1.630	0,56	5,940 % fällig am 25.06.2036	1.734	946	0,33	4,490 % fällig am 25.05.2032	1.400	1.484	0,51
MortgageIT Trust				6,360 % fällig am 25.11.2035	100	95	0,03	Republic of Uzbekistan International Bond			
6,060 % fällig am 25.08.2035	303	285	0,10	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				5,375 % fällig am 29.05.2027	400	428	0,15
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				4,372 % fällig am 25.01.2037	4.020	2.017	0,70	Romania Government International Bond			
3,917 % fällig am 15.11.2032	1.220	1.053	0,36	Lehman XS Trust				1,750 % fällig am 13.07.2030	600	525	0,18
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				5,780 % fällig am 25.02.2037	490	476	0,16	5,500 % fällig am 18.09.2028	350	385	0,13
5,840 % fällig am 25.12.2036	69	58	0,02	Long Beach Mortgage Loan Trust				6,375 % fällig am 18.09.2033	350	390	0,13
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				5,760 % fällig am 25.11.2036	460	320	0,11	Serbia Government International Bond			
5,440 % fällig am 25.04.2037	41	34	0,01	5,770 % fällig am 25.08.2036	2.399	1.219	0,42	1,000 % fällig am 23.09.2028	400	365	0,13
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				South Africa Government International Bond			
6,105 % fällig am 25.04.2035	27	26	0,01	6,135 % fällig am 25.09.2035	428	401	0,14	10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 8.000	455	0,16
Trinity Square PLC				Mosaic Solar Loans LLC						7.731	2,68
0,000 % fällig am 15.07.2059	£ 1.900	2.400	0,83	4,450 % fällig am 20.06.2042	403	387	0,13	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 312.324	108,22	
WalMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust											
4,003 % fällig am 25.11.2036	\$ 82	68	0,02								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	5,390 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 11.400	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	\$ (11.385)	\$ 11.400	\$ 11.405	3,95
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	588	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(600)	588	588	0,20
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (11.985)	\$ 11.988	\$ 11.993	4,15

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	3	\$ 8	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	4	8	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	4	8	0,00
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	2	5	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	2	5	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	3	5	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	3	8	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	3	7	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	2	4	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	349	177	0,06
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	11	(3)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	245	204	0,07
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	10	(3)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	1	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	14	0	0,00
				\$ 434	0,15

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURES-AHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 109,000	26.07.2024	1	\$ 0	\$ (1)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	112,000	26.07.2024	1	(1)	0	0,00
				\$ (1)	\$ (1)	0,00

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 433 0,15

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.06.2028	€ 200	\$ 0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	900	(1)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	100	0	0,00
				\$ (1)	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,700 %	28.03.2034	£ 100	\$ 3	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	1.600	41	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	15.300	(147)	(0,05)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320	20.10.2033	100	(2)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	¥ 330.000	2	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2028	890.000	5	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	1.690.000	7	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	226.300	1	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	101.000	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	\$ 150	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	100	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	40	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	200	1	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	550	1	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,420	24.02.2027	400	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	500	1	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	50	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	110	1	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	2.700	39	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	50	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	50	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	50	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	2.820	63	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	2.600	59	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	200	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	2.000	28	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	3.500	22	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,430	30.09.2027	460	13	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	6.800	53	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	460	13	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,537	24.07.2053	100	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,690	04.04.2025	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,697	04.04.2025	500	(9)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,721	10.04.2025	200	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	3.200	27	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,765	27.07.2024	1.100	(17)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,790	10.04.2025	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	500	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	200	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	1.570	14	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,052	24.07.2024	1.100	(15)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	200	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	420	4	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	100	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	12.07.2053	200	(6)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500 %	22.05.2033	\$ 21.620	\$ 263	0,09
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	100	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,555	05.03.2054	100	(3)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,594	09.01.2034	200	4	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,600	17.01.2034	200	4	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	200	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,620	31.01.2034	100	(3)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,648	08.01.2034	200	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	400	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	400	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.03.2034	200	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,655	24.01.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,665	24.01.2034	200	(4)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,670	08.01.2034	200	4	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	100	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,685	24.01.2034	200	(4)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	12.640	152	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	05.03.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,710	05.03.2034	200	(4)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,725	07.02.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	23.01.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,738	23.01.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	400	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	400	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	10.300	17	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	13.12.2027	400	8	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	4.800	96	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	5.000	(29)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	12.100	175	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	9.400	(71)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	100	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	3.100	58	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	7.000	116	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,783	07.02.2034	100	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	100	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	100	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	100	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	200	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,860	21.02.2034	400	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	100	(2)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	10.04.2034	200	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	15.04.2034	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	22.02.2029	600	(6)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	200	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	16.04.2034	200	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,970	27.02.2029	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.06.2026	13.300	35	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.06.2026	10.600	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	200	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	17.04.2034	200	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	05.06.2034	200	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,085	22.04.2034	200	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,090	30.04.2034	600	7	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,130	03.05.2034	200	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	22.04.2034	200	3	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	200	4	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,832	04.01.2027	BRL 4.000	(28)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,256	04.01.2027	38.700	(190)	(0,07)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,750	19.06.2029	NZD 1.900	2	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	AUD 3.200	18	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	€ 700	(2)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	400	(1)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	300	14	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	400	(5)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,650	08.01.2034	200	3	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,670	03.04.2034	100	2	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	13.900	203	0,07
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	05.03.2034	100	(1)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	6.600	164	0,06
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	200	3	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	04.03.2034	100	(1)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	16.04.2029	200	(1)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	29.04.2034	100	0	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029	200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,818	26.06.2029	200	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029	200	(1)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,860	24.04.2029	200	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	100	(1)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920 %	13.12.2028	€ 300	\$ (1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	100	(1)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029	200	1	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033	200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033	200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	100	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033	100	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	100	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	100	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033	200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	100	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	08.11.2028	200	(1)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	21.08.2033	100	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	100	0	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	400	2	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	100	0	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028	200	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028	200	1	0,00
					\$ 1.152	0,40
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 1.151</b>	<b>0,40</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variable Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Marktwert	% des Nettover- mögens
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110 %	26.07.2032	200	\$ 32	\$ 19	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	300	49	78	0,03
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	2.600	20	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	2.600	20	59	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	200	26	9	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	200	26	47	0,01
							\$ 173	\$ 212	0,07

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variable Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	200	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	200	(1)	0	0,00
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700	04.07.2024	200	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	200	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,700	05.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	100	0	0	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	100	0	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689	15.07.2024	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	400	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	400	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	400	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	400	(2)	(3)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	400	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	400	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	100	0	0	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550 %	18.07.2024	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	18.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,850	05.07.2024	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	05.07.2024	400	(1)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,610	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,640	23.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,990	23.07.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,800	03.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,150	03.07.2024	100	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	200	0	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	200	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	17.07.2024	200	0	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	22.07.2024	200	0	0	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	200	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	22.07.2024	200	0	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,970	17.07.2024	200	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	200	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	100	0	(1)	0,00
							\$ (34)	\$ (23)	(0,01)

## ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026 %	23.07.2025	2.600	\$ (23)	\$ (59)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	5.200	(20)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	2.600	(23)	0	0,00
						\$ (66)	\$ (59)	(0,02)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 1.000	\$ (44)	\$ 41	\$ (3)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500 %	16.12.2072	\$ 1.600	\$ (38)	\$ 16	\$ (22)	(0,01)

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD	1.559	\$ 1.038	\$ 0	\$ (2)	0,00
BOA	07.2024	€	28.388	30.821	397	0	0,14
	07.2024	\$	760	700	0	(10)	0,00
BPS	07.2024	£	12.439	\$ 15.890	166	0	0,06
	07.2024	\$	1.038	AUD 1.559	2	0	0,00
	07.2024	\$	7.606	¥ 1.189.029	0	(214)	(0,07)
	08.2024	AUD	1.559	\$ 1.039	0	(2)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	05.2029	KWD	73	\$ 250	\$ 7	\$ 0	\$ 7	0,00
BRC	07.2024	NOK	328	31	0	0	0	0,00
	09.2024	MXN	63	3	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	BRL	27.553	5.057	96	0	96	0,03
	07.2024	€	188	202	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	284	£ 224	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024		145	MXN 2.673	1	0	1	0,00
	08.2024		5.057	BRL 27.646	0	(97)	(97)	(0,03)
	09.2024		47	INR 3.968	0	0	0	0,00
DUB	07.2024		5.113	BRL 25.706	0	(486)	(486)	(0,17)
	08.2024		59	304	0	(5)	(5)	0,00
GLM	07.2024		186	€ 172	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	ZAR	1.971	\$ 108	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	IDR	1.296.964	80	1	0	1	0,00
	07.2024	ZAR	3.734	203	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	\$	3.137	MXN 56.770	0	(70)	(70)	(0,02)
MBC	07.2024	€	179	\$ 195	3	0	3	0,00
	07.2024	¥	1.189.102	7.409	16	0	16	0,01
	07.2024	\$	15.454	£ 12.215	0	(13)	(13)	(0,01)
	07.2024		24	NOK 255	0	0	0	0,00
	08.2024	£	12.215	\$ 15.457	13	0	13	0,00
	08.2024	NOK	255	24	0	0	0	0,00
	08.2024	\$	7.223	¥ 1.154.174	0	(14)	(14)	(0,01)
MYI	07.2024	€	21	\$ 22	0	0	0	0,00
	07.2024	£	6	8	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	356	BRL 1.840	0	(25)	(25)	(0,01)
	07.2024		6	£ 4	0	0	0	0,00
	09.2024		5	INR 403	0	0	0	0,00
SCX	07.2024		29.874	€ 27.883	10	0	10	0,00
	08.2024	€	27.883	\$ 29.918	0	(9)	(9)	0,00
	08.2024	\$	362	¥ 57.900	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024		45	INR 3.796	0	0	0	0,00
SSB	08.2024		235	BRL 1.302	0	(2)	(2)	0,00
					\$ 712	\$ (954)	\$ (242)	(0,08)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und R Class AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2024	AUD	24.521	\$ 16.333	\$ 0	\$ (43)	(0,01)	
	07.2024	\$	34.428	AUD 51.715	110	0	110	0,04
	08.2024		16.347	24.521	43	0	43	0,01
BOA	07.2024		2.897	4.358	14	0	14	0,00
BPS	07.2024	AUD	24.521	\$ 16.338	0	(38)	(38)	(0,01)
	07.2024	\$	3.003	AUD 4.497	1	0	1	0,00
	08.2024		16.352	24.521	38	0	38	0,01
BRC	07.2024		16.221	24.512	149	0	149	0,05
CBK	08.2024		13.227	19.828	26	0	26	0,01
JPM	07.2024	AUD	26.069	\$ 17.375	0	(35)	(35)	(0,01)
	08.2024	\$	17.390	AUD 26.069	34	0	34	0,01
MBC	07.2024	AUD	148	\$ 98	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$	480	AUD 721	2	0	2	0,00
MYI	07.2024	AUD	9.122	\$ 6.069	0	(23)	(23)	(0,01)
					\$ 417	\$ (140)	\$ 277	0,09

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2024	\$	695	CHF 625	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
CBK	07.2024		60	54	1	0	1	0,00
MBC	07.2024		587	528	1	0	1	0,00
MYI	07.2024	CHF	2	\$ 2	0	0	0	0,00
SCX	07.2024		210	235	1	0	1	0,00
	07.2024	\$	17	CHF 15	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	CHF	561	\$ 626	1	0	1	0,00
	07.2024	\$	687	CHF 621	4	0	4	0,00
	08.2024		626	559	0	(1)	(1)	0,00
					\$ 9	\$ (1)	\$ 8	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 25	\$ 27	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 36.349	€ 33.479	0	(468)	(468)	(0,16)
BPS	07.2024	€ 31.820	\$ 34.039	4	(68)	(64)	(0,02)
	07.2024	\$ 35.736	€ 33.010	0	(358)	(358)	(0,12)
08.2024	€ 6	\$ 6	0	0	0	0	0,00
	\$ 33.756	€ 31.514	68	0	68	0,02	
BRC	07.2024	€ 93	\$ 99	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 31.865	€ 29.426	0	(328)	(328)	(0,11)
CBK	07.2024	€ 159	\$ 171	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 47	€ 44	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	€ 32.160	\$ 34.390	1	(79)	(78)	(0,03)
	07.2024	\$ 270	€ 248	0	(4)	(4)	0,00
08.2024	€ 34.331	\$ 32.059	80	0	80	0,03	
	07.2024	€ 31.950	\$ 34.231	0	(11)	(11)	(0,01)
SCX	08.2024	\$ 34.281	€ 31.950	11	0	11	0,00
				\$ 164	\$ (1.316)	\$ (1.152)	(0,40)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 394	\$ 498	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 797	£ 625	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	498	394	0	0	0	0,00
BRC	07.2024	6	5	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 374	\$ 473	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	\$ 220	£ 173	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	478	377	0	0	0	0,00
	07.2024	415	326	0	(4)	(4)	0,00
MBC	07.2024	£ 391	\$ 494	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 37	£ 30	0	0	0	0,00
	08.2024	487	385	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1	\$ (12)	\$ (11)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 375	NOK 4.018	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
CBK	07.2024	NOK 6.398	\$ 605	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 41.474	NOK 435.094	0	(611)	(611)	(0,21)
MBC	07.2024	NOK 121.603	\$ 11.416	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	\$ 982	NOK 10.347	1	(11)	(10)	0,00
	08.2024	11.677	124.290	5	0	5	0,00
RYL	07.2024	NOK 5.327	\$ 505	5	0	5	0,00
	07.2024	\$ 1.089	NOK 11.537	1	(6)	(5)	0,00
				\$ 18	\$ (633)	\$ (615)	(0,21)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 3	SEK 30	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	07.2024	SEK 2.003	\$ 191	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 14.829	SEK 157.440	37	0	37	0,01
MBC	07.2024	SEK 211	\$ 20	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 14.323	SEK 150.423	0	(119)	(119)	(0,04)
MYI	07.2024	SEK 157.060	\$ 14.870	39	0	39	0,01
	08.2024	\$ 14.870	SEK 156.818	0	(39)	(39)	(0,01)
RYL	07.2024	SEK 1	\$ 0	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 14.314	SEK 150.502	0	(103)	(103)	(0,03)
SCX	07.2024	SEK 2.466	\$ 235	2	0	2	0,00
UAG	07.2024	\$ 15	SEK 152	0	0	0	0,00
				\$ 80	\$ (261)	\$ (181)	(0,06)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2024	SGD	138	\$ 102	\$ 0	\$ 0	0,00		
	07.2024	\$	101	SGD 136	0	0	0,00		
	08.2024		102	138	0	0	0,00		
BPS	07.2024	SGD	138	\$ 102	0	0	0,00		
	08.2024	\$	102	SGD 138	0	0	0,00		
CBK	07.2024		4	5	0	0	0,00		
MY1	07.2024		92	124	0	0	0,00		
SCX	07.2024		101	137	0	(1)	0,00		
						\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (1.812)	(0,63)		

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2054	\$ 500	(426)	(0,15)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (426)	(0,15)
Summe Anlagen		\$ 323.658	112,14
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (35.036)	(12,14)
Nettovermögen		\$ 288.622	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(e) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 7.959 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurde zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(f) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 18.856 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 5.179 USD (31. Dezember 2023: 2,915 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.610 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Markt- wert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 312.324	\$ 0	\$ 312.324
Pensionsgeschäfte	0	11.988	0	11.988
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	4	(232)	0	(228)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(426)	0	(426)
<b>Summen</b>	<b>\$ 4</b>	<b>\$ 323.654</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 323.658</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 274.513	\$ 13	\$ 274.526
Pensionsgeschäfte	0	8.200	0	8.200
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	9	1.733	0	1.742
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(443)	0	(443)
<b>Summen</b>	<b>\$ 9</b>	<b>\$ 284.003</b>	<b>\$ 13</b>	<b>\$ 284.025</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
SCX	5,560 %	26.06.2024	03.07.2024	\$ (7.977)	\$ (7.983)	(2,77)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (7.983)</b>	<b>(2,77)</b>

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	5,450 %	13.06.2024	25.07.2024	\$ (18.976)	\$ (19.027)	(6,59)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (19.027)</b>	<b>(6,59)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 69 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 108	\$ 0	\$ 108	\$ 962	\$ (1.000)	\$ (38)
BOA	(64)	0	(64)	684	(660)	24
BPS	(400)	330	(70)	(64)	0	(64)
BRC	(179)	260	81	2	0	2
CBK	(544)	630	86	520	(620)	(100)
DUB	(495)	380	(115)	(2)	(10)	(12)
GLM	82	10	92	655	(510)	145
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
JPM	(73)	0	(73)	(8)	0	(8)
MBC	(124)	0	(124)	375	(260)	115
MYC	26	0	26	15	0	15
MYI	(48)	0	(48)	251	(450)	(199)
RYL	(104)	0	(104)	103	0	103
SCX	2	0	2	257	(300)	(43)
SSB	(2)	0	(2)	1	0	1
UAG	4	(20)	(16)	701	(990)	(289)
ULO	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	42,75	39,24
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	64,05	61,99
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,42	k. A.
Pensionsgeschäfte	4,15	3,02
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,15	(0,14)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,40	(0,86)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,63)	1,64
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,15)	(0,16)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,77)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(6,59)	k. A.

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,08	0,31
Unternehmensanleihen und Wechsel	34,27	34,34
US-Regierungsbehörden	42,05	38,88
US-Schatzobligationen	11,79	7,73
Non-Agency-MBS	11,35	12,45
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,00	6,12
Staatsemissionen	2,68	1,40
Pensionsgeschäfte	4,15	3,02
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,15	(0,14)
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Zinsswaps	0,40	(0,87)
Freiverkehrsinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,07	0,06
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,02)
Zinsscaps	(0,02)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,08)	0,00
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,58)	1,63
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,15)	(0,16)
Sonstige Aktiva und Passiva	(12,14)	(4,73)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES					
	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS			
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>														
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>														
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 7,089 % - 7,095 % fällig am 08.11.2030	\$	214	€ 200	0,01	1,500 % fällig am 01.10.2052 DKK 2,000 % fällig am 01.10.2047 2,000 % fällig am 01.10.2050 2,000 % fällig am 01.10.2053	4.850 0 57.017 0	€ 517 0 6.419 0	0,03 0,00 0,41 0,00	Mondelez International Holdings Netherlands BV 0,250 % fällig am 09.09.2029	€	1.000	€ 855	0,05	
Telekom Srbija TBD % fällig am 11.06.2029	€	5.000	4.977	0,32	2,500 % fällig am 01.10.2036 2,500 % fällig am 01.10.2047 3,000 % fällig am 01.10.2053 3,500 % fällig am 01.04.2053 5,000 % fällig am 01.10.2053	326 26 4.497 24.408 23.389	42 3 558 3.123 3.166	0,00 0,00 0,04 0,20 0,20	Nestle Finance International Ltd. 3,250 % fällig am 23.01.2037	€	2.100	2.039	0,13	
			5.177	0,33					Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€	1.000	999	0,06	
					Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2047 1,500 % fällig am 01.10.2053	62 0	7 0	0,00 0,00	PepsiCo, Inc. 0,500 % fällig am 06.05.2028	€	1.000	903	0,06	
					2,000 % fällig am 01.10.2050 2,000 % fällig am 01.10.2047 2,000 % fällig am 01.10.2050 2,500 % fällig am 01.04.2036	0 0 14.773 1	0 0 1.662 0	0,00 0,00 0,11 0,00	Procter & Gamble Co. 1,250 % fällig am 25.10.2029	€	1.000	909	0,06	
					Royal Bank of Canada 4,318 % fällig am 17.01.2025	€	5.000	5.010	0,32	Roche Finance Europe BV 3,204 % fällig am 27.08.2029	€	1.000	1.002	0,06
					Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % fällig am 13.09.2029	€	7.200	6.287	0,40	Sage Group PLC 3,820 % fällig am 15.02.2028	€	1.000	1.004	0,06
					Societe Generale S.A. 1,125 % fällig am 21.04.2026	€	2.400	2.346	0,15	Siemens Financieringsmaatschappij NV 1,000 % fällig am 25.02.2030	€	2.900	2.576	0,16
					SP-Kiinnitysluottopankki Oyj 3,250 % fällig am 02.05.2031	€	4.800	4.815	0,31	Stryker Corp. 0,750 % fällig am 01.03.2029	€	3.500	3.094	0,20
					Toronto-Dominion Bank 5,834 % fällig am 11.06.2029	€	3.500	4.130	0,26	Thermo Fisher Scientific Finance BV 0,800 % fällig am 18.10.2030	€	2.000	1.712	0,11
					UBS Group AG 3,250 % fällig am 02.04.2026	€	6.000	5.967	0,38	Universal Music Group NV 4,000 % fällig am 13.06.2031	€	1.000	1.023	0,07
					4,194 % fällig am 01.04.2031	\$	2.500	2.178	0,14	Walmart, Inc. 4,875 % fällig am 21.09.2029	€	1.000	1.083	0,07
					UBS Switzerland AG 4,056 % fällig am 21.04.2027	€	7.500	7.503	0,48				67.668	4,32
					UniCredit SpA 2,569 % fällig am 22.09.2026	\$	9.100	8.146	0,52	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				
					3,127 % fällig am 03.06.2032 (h)	€	4.400	3.480	0,22	BP Capital Markets PLC 2,822 % fällig am 07.04.2032	€	1.000	942	0,06
							198.230	12,64		Electricite de France S.A. 2,875 % fällig am 15.12.2026 (e)	€	10.400	9.720	0,62
												10.662	0,68	
					<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel				276.560	17,64
					AbbVie, Inc. 2,125 % fällig am 17.11.2028	€	3.300	3.135	0,20	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				
					American Medical Systems Europe BV 3,375 % fällig am 08.03.2029	€	2.000	1.984	0,13	Fannie Mae 5,850 % fällig am 25.06.2036	\$	26	24	0,00
					Anheuser-Busch InBev S.A. 3,450 % fällig am 22.09.2031	€	2.900	2.895	0,18	6,087 % fällig am 25.07.2037	€	4	4	0,00
					Apple, Inc. 1,375 % fällig am 24.05.2029	€	1.000	927	0,06	Freddie Mac 0,553 % fällig am 15.01.2038	€			
					AstraZeneca PLC 1,250 % fällig am 12.05.2028	€	3.300	3.064	0,20	(a) 3,500 % fällig am 01.10.2047	€	379	21	0,00
					Autoroutes du Sud de la France S.A. 1,375 % fällig am 21.02.2031	€	1.800	1.576	0,10	5,793 % fällig am 15.01.2038	€	2.521	2.133	0,14
					Coca-Cola Co. 0,125 % fällig am 15.03.2029	€	1.300	1.128	0,07	6,427 % fällig am 01.09.2037	€	379	352	0,02
					Comcast Corp. 0,250 % fällig am 14.09.2029	€	1.000	849	0,05	Ginnie Mae 5,887 % fällig am 20.08.2066	€	3	3	0,00
					Dassault Systemes SE 0,375 % fällig am 16.09.2029	€	1.000	859	0,05	Ginnie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2054	€	66.100	55.416	3,54
					Deutsche Bahn Finance GmbH 3,375 % fällig am 29.01.2038	€	2.500	2.448	0,16	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2029	€	537	486	0,03
					Deutsche Telekom International Finance BV 7,500 % fällig am 24.01.2033	€	1.000	1.290	0,08	- 01.08.2041	€			
					Diageo Capital BV 1,500 % fällig am 08.06.2029	€	1.000	920	0,06	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2054	€	19.600	16.736	1,07
					Eli Lilly & Co. 0,625 % fällig am 01.11.2031	€	1.000	833	0,05	4,500 % fällig am 01.07.2054	€	87.400	76.888	4,90
					GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024	€	3.300	3.241	0,21	6,000 % fällig am 01.08.2054	€	55.700	52.099	3,32
					Linde PLC 1,375 % fällig am 31.03.2031	€	1.400	1.236	0,08	6,500 % fällig am 01.08.2054	€	35.500	33.695	2,15
					LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 3,250 % fällig am 07.09.2029	€	1.100	1.101	0,07				238.519	15,21
					Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	€	4.200	3.995	0,26	<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				
					McDonald's Corp. 4,000 % fällig am 07.03.2030	€	1.000	1.025	0,07	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.02.2051	€	6.743	3.643	0,23
					Medtronic Global Holdings S.C.A. 2,250 % fällig am 07.03.2039	€	1.600	1.319	0,08	1,125 % fällig am 15.01.2033	€	16.419	14.181	0,90
					Mercedes-Benz International Finance BV 3,919 % fällig am 11.06.2026	€	5.000	4.996	0,32	1,375 % fällig am 15.07.2033	€	11.149	9.827	0,63
									1,625 % fällig am 15.10.2027	€	30.057	27.593	1,76	
												55.244	3,52	
					<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Adjustable Rate Mortgage Trust 4,094 % fällig am 25.01.2036	€	3	2	0,00	
									Alba PLC 5,522 % fällig am 15.12.2038	€	2.675	3.093	0,20	
									5,542 % fällig am 25.11.2042	€	178	208	0,01	





## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	444	€ (67)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2024	2.740	2.579	0,16
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	628	(569)	(0,04)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	152	(99)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	134	236	0,02
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	422	(583)	(0,04)
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	4.253	1.784	0,11
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	1.588	(987)	(0,06)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	2.215	(945)	(0,06)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	1.255	1.076	0,07
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	1.127	(1.181)	(0,08)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	117	103	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	534	(168)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	225	85	0,01
				€ 1.264	0,08

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
Call - EUREX Euro-Schatz August 2024 Futures	€ 106,200	26.07.2024	650	€ (105)	€ (42)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					€ 1.222	0,08

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250 %	18.09.2026	£ 62.300	€ 137	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	\$ 19.400	2.604	0,17
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	59.500	(3.900)	(0,25)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	16.600	(343)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	12.300	167	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	25.400	434	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,750	18.01.2026	31.400	232	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,827	15.12.2025	31.400	200	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,700	15.03.2073	€ 4.900	533	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	9.900	(312)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	88.200	3.490	0,22
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	190.300	(3.875)	(0,25)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2039	6.500	(26)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,670	24.07.2024	1.486.800	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,750	23.08.2024	635.900	234	0,02
					€ (426)	(0,03)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ (426)	(0,03)

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BRC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	3,150 %	06.10.2025	24.800	€ (272)	€ (310)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,150	06.10.2025	24.800	(272)	(105)	(0,01)
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950	15.09.2025	20.600	(234)	(212)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	15.09.2025	20.600	(234)	(121)	(0,01)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	12.900	(153)	(117)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	12.900	(154)	(74)	0,00
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	27.900	(326)	(224)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	27.900	(326)	(183)	(0,01)
							€ (1.971)	€ (1.346)	(0,09)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2024	AUD	25	\$	17	€	0	0,00
	07.2024	€	1.164	NZD	2.036		0	0,00
	07.2024	NZD	713	\$	438		3	0,00
	07.2024	\$	100	NZD	163		0	0,00
	08.2024	NZD	163	\$	100		0	0,00
	10.2024	\$	2.520	CNH	18.039		0	0,00
BOA	07.2024	DKK	115.255	€	15.454		0	0,00
	07.2024	£	65.750		77.218		5	(0,02)
	07.2024	KRW	3.651.690	\$	2.669		16	0,00
	07.2024	SGD	54		40		0	0,00
	07.2024	\$	181.371	€	167.055		0	(0,14)
	07.2024		567	PLN	2.259		0	0,00
	07.2024		40	SGD	54		0	0,00
	08.2024	SGD	54	\$	40		0	0,00
BPS	07.2024	BRL	3.089		614		54	0,00
	07.2024	CHF	5.243	€	5.345		0	(0,01)
	07.2024	€	1.813	\$	1.953		9	0,00
	07.2024	£	592	€	694		0	0,00
	07.2024	¥	6.280.000		38.672		2.142	0,14
	07.2024	KRW	3.666.245	\$	2.671		8	0,00
	07.2024	\$	17	AUD	25		0	0,00
	07.2024		450	IDR	7.373.876		1	0,00
	07.2024		152	ILS	564		0	0,00
	07.2024		1.336	PLN	5.304		0	0,00
	07.2024		3.226	SGD	4.376		2	0,00
	08.2024	AUD	25	\$	17		0	0,00
	08.2024	SGD	4.369		3.226		0	0,00
	09.2024	CNH	43.112		6.016		70	0,01
	09.2024	TWD	122.040		3.793		21	0,00
	09.2024	\$	954	INR	79.809		1	0,00
	10.2024	CNH	14.861	\$	2.076		21	0,00
	10.2024	\$	481	CNH	3.445		0	0,00
BRC	07.2024	€	5.163	AUD	8.305		13	0,00
	07.2024		6.451	CAD	9.432		0	0,00
	07.2024		7.256	£	6.139		0	0,00
	07.2024	MXN	9.679	\$	524		0	0,00
	07.2024	PLN	11		3		0	0,00
	07.2024	\$	802	PLN	3.204		0	0,00
	08.2024	AUD	8.310	€	5.163		0	0,00
	08.2024	CAD	9.440		6.451		19	0,00
	09.2024	MXN	15.462	\$	818		0	0,00
	09.2024	\$	5.371	MXN	100.641		62	0,00
CBK	07.2024	CHF	3	\$	3		0	0,00
	07.2024	€	9.158	£	7.748		0	0,00
	07.2024	KRW	267.930	\$	196		2	0,00
	07.2024	NOK	7.712	€	676		0	0,00
	07.2024	\$	2.348	BRL	12.796		0	0,00
	07.2024		1.478	PLN	5.864		0	0,00
	07.2024		11	ZAR	202		0	0,00
	08.2024	BRL	12.839	\$	2.348		42	0,00
	09.2024	TWD	46.530		1.444		6	0,00
	09.2024	\$	4.511	INR	377.109		3	0,00
DUB	07.2024	KRW	1.980.899	\$	1.440		1	0,00
	07.2024	\$	1.447	PLN	5.688		0	0,00
	08.2024	BRL	3.309	\$	643		46	0,00
GLM	07.2024	€	95.128	£	80.286		0	(0,03)
	07.2024	£	1.283	€	1.519		6	0,00
	07.2024	¥	50.335		296		4	0,00
	07.2024	KRW	3.849	\$	3		0	0,00
	07.2024	MXN	9.580		516		0	0,00
	07.2024	\$	50	KRW	68.690		0	0,00
	07.2024		947	PLN	3.742		0	0,00
	07.2024		2.388	ZAR	43.693		1	0,00
	08.2024	£	80.390	€	95.128		431	0,03
	08.2024	\$	4.023	BRL	20.637		0	(0,02)
JPM	07.2024	BRL	886	\$	176		16	0,00
	07.2024	CHF	528	€	538		0	0,00
	07.2024	€	980	£	828		0	0,00
	07.2024	£	28.179	€	33.091		0	(0,01)
	07.2024	IDR	5.068.722	\$	313		3	0,00
	07.2024	KRW	2.448.537		1.775		0	0,00
	07.2024	SGD	4.376		3.251		21	0,00
	07.2024	\$	39	CHF	35		0	0,00
	07.2024		349	ILS	1.292		0	0,00
	07.2024		576	PLN	2.251		0	0,00
	07.2024		4.496	ZAR	82.764		29	0,00
	08.2024	CHF	35	\$	39		0	0,00
	08.2024	NZD	313		191		0	0,00
	09.2024	TWD	79.163		2.459		13	0,00
	09.2024	\$	514	INR	43.096		1	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	10.2024	CNH	\$ 25.602	\$ 3.578	€ 37	€ 37	0,00	
	10.2024	\$	481	CNH 3.434	0	(6)	0,00	
MBC	07.2024	AUD	8.005	€ 4.893	0	(95)	(0,01)	
	07.2024	€	1.609	NZD 2.817	0	(8)	0,00	
	07.2024		1.800	\$ 1.959	28	0	0,00	
	08.2024	¥	4.400.000	€ 26.252	601	0	601	0,04
MYI	07.2024	AUD	441	270	0	(5)	0,00	
	07.2024	BRL	8.818	\$ 1.707	112	0	112	0,01
	07.2024	€	6.418	CHF 6.162	0	(19)	(19)	0,00
	07.2024		15.454	DKK 115.273	4	0	4	0,00
	07.2024		677	NOK 7.727	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK	21	€ 2	0	0	0	0,00
	08.2024	CHF	6.149	6.418	19	0	19	0,00
	08.2024	DKK	115.237	15.454	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	¥	2.121.000	12.767	410	0	410	0,03
	08.2024	NOK	7.732	677	0	0	0	0,00
	09.2024	¥	7.240.000	43.081	783	0	783	0,05
	09.2024	TWD	31.491	\$ 982	8	0	8	0,00
	09.2024	\$	344	INR 28.766	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	CHF	384	€ 389	0	(10)	(10)	0,00
RYL	09.2024	¥	5.560.000	32.964	432	0	432	0,03
SCX	07.2024	CAD	9.570	6.451	0	(75)	(75)	0,00
	07.2024	€	296	¥ 50.883	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024		163.442	\$ 175.112	0	(54)	(54)	0,00
	07.2024	IDR	164.120	10	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW	1.858.446	1.363	12	0	12	0,00
	07.2024	MXN	108	6	0	0	0	0,00
	07.2024	ZAR	930	50	0	0	0	0,00
	08.2024	¥	50.719	€ 296	1	0	1	0,00
	08.2024	\$	175.369	163.442	51	0	51	0,00
	09.2024	CNH	17.693	\$ 2.466	26	0	26	0,00
	09.2024	TWD	45.775	1.420	5	0	5	0,00
	09.2024	\$	4.128	INR 345.537	6	0	6	0,00
TOR	07.2024		145	NZD 237	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	NZD	237	\$ 145	1	0	1	0,00
UAG	07.2024	CHF	32	36	0	0	0	0,00
	07.2024	ILS	1.911	516	7	0	7	0,00
					€ 5.615	€ (4.078)	€ 1.537	0,10

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BPS	07.2024	€	106.399	CHF 104.376	€ 1.979	€ 1.979	0,12	
BRC	07.2024		5.622	5.447	34	0	34	0,00
GLM	07.2024	CHF	2.597	€ 2.693	7	(10)	(3)	0,00
JPM	07.2024		39.791	41.125	0	(191)	(191)	(0,01)
	07.2024	€	112.711	CHF 110.319	1.838	0	1.838	0,12
MBC	07.2024	CHF	896	€ 942	12	0	12	0,00
	07.2024	€	113.260	CHF 111.913	2.943	0	2.943	0,19
MYI	07.2024	CHF	112.318	€ 116.749	222	(98)	124	0,01
	08.2024	€	75.329	CHF 72.172	0	(219)	(219)	(0,02)
NGF	07.2024		11	10	0	0	0	0,00
SSB	07.2024		1.087	1.047	0	0	0	0,00
UAG	07.2024		3.359	3.189	0	(49)	(49)	0,00
					€ 7.035	€ (567)	€ 6.468	0,41

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ 6.659 0,42

Summe Anlagen

€ 1.770.725 112,94

Sonstige Aktiva und Passiva

€ (202.881) (12,94)

Nettovermögen

€ 1.567.844 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 2.326 USD (31. Dezember 2023: 1.087 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(g) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 804 EUR (31. Dezember 2023: 1.233 EUR) und Barmittel in Höhe von 3.314 EUR (31. Dezember 2023: 3.318 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 30.870 EUR (31. Dezember 2023: 34.315 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.605.677	€ 5.213	€ 1.610.890
Investmentfonds	149.626	0	0	149.626
Pensionsgeschäfte	0	2.754	0	2.754
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	3.324	4.131	0	7.455
<b>Summen</b>	<b>€ 152.950</b>	<b>€ 1.612.562</b>	<b>€ 5.213</b>	<b>€ 1.770.725</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.547.394	€ 233	€ 1.547.627
Investmentfonds	164.208	0	0	164.208
Pensionsgeschäfte	0	97.581	0	97.581
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	15.051	4.573	0	19.624
<b>Summen</b>	<b>€ 179.259</b>	<b>€ 1.649.548</b>	<b>€ 233</b>	<b>€ 1.829.040</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BRC	3,000 %	30.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (628)	€ (586)	(0,04)
MYI	3,400	27.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.785)	(1.785)	(0,11)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>€ (2.371)</b>	<b>(0,15)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	€ (29)	€ 0	€ (29)	€ k. A.	€ k. A.	€ k. A.
BOA	(2.498)	2.824	326	(431)	373	(58)
BPS	4.180	(4.620)	(440)	2.192	(2.230)	(38)
BRC	(359)	279	(80)	(421)	420	(1)
CBK	(361)	(250)	(611)	2.752	(3.316)	(564)
DUB	16	0	16	(113)	0	(113)
GLM	(507)	610	103	3.440	(2.974)	466
GST	(407)	405	(2)	(600)	624	24
JPM	1.579	(1.866)	(287)	1	0	1
MBC	3.481	(3.680)	(199)	(2.085)	2.046	(39)
MYI	1.213	(460)	753	1.032	(2.110)	(1.078)
RBC	(10)	0	(10)	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	432	0	432	(555)	390	(165)
SCX	(29)	0	(29)	(1.029)	698	(331)
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
UAG	(42)	0	(42)	627	(1.010)	(383)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	72,51	76,27
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	26,39	16,25
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,85	0,06
Investmentfonds	9,54	9,82
Pensionsgeschäfte	0,18	5,84
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,08	0,53
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	0,35
Freiverkehrsfinanzderivate	0,42	0,29
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,15)	(0,06)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,33	0,01
Unternehmensanleihen und Wechsel	17,64	16,27
US-Regierungsbehörden	15,21	10,71
US-Schatzobligationen	3,52	4,94
Non-Agency-MBS	8,36	13,32
Forderungsbesicherte Wertpapiere	12,83	14,19
Staatsemissionen	34,56	23,09
Vorzugswertpapiere	0,01	0,01
Kurzfristige Instrumente	10,29	10,04
Investmentfonds	9,54	9,82
Pensionsgeschäfte	0,18	5,84
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,08	0,54
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte		
Terminkontrakte	0,00	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,03)	0,35
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,09)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-		
Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,10	(0,18)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,41	0,62
Sonstige Aktiva und Passiva	(12,94)	(9,41)
Nettovermögen	100,00	100,00



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS % DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS % DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS % DES
Coca-Cola HBC Finance BV 3,375 % fällig am 27.02.2028	€ 1.200	€ 1.194	0,23	Schaeffler AG 4,500 % fällig am 28.03.2030	€ 700	€ 693	0,13	Severn Trent Utilities Finance PLC 4,000 % fällig am 05.03.2034	€ 2.400	€ 2.354	0,46
Davide Campari-Milano NV 1,250 % fällig am 06.10.2027	1.100	1.013	0,20	Siemens Energy Finance BV 4,250 % fällig am 05.04.2029	200	201	0,04	Southern Water Services Finance Ltd. 3,000 % fällig am 28.05.2037	£ 1.500	1.231	0,24
Deutsche Bahn Finance GmbH 4,000 % fällig am 23.11.2043	700	722	0,14	Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,625 % fällig am 24.02.2043	2.600	2.548	0,49	TDC Net A/S 5,618 % fällig am 06.02.2030	€ 2.700	2.780	0,54
El Corte Ingles S.A. 4,250 % fällig am 26.06.2031	700	700	0,14	Silfin NV 2,875 % fällig am 11.04.2027	900	861	0,17			21.788	4,23
Elis S.A. 3,750 % fällig am 21.03.2030	1.400	1.383	0,27	Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % fällig am 09.10.2025	1.100	1.092	0,21	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		351.544	68,28
Ellevio AB 4,125 % fällig am 07.03.2034	1.400	1.417	0,28	Solvay S.A. 4,250 % fällig am 03.10.2031	1.000	1.002	0,19	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
ELO SACA 6,000 % fällig am 22.03.2029	1.800	1.771	0,34	Suez SACA 2,375 % fällig am 24.05.2030	1.700	1.567	0,30	Ginnie Mae, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2054	\$ 4.000	3.551	0,69
Epiroc AB 3,625 % fällig am 28.02.2031	1.000	989	0,19	Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 4,375 % fällig am 03.05.2033	600	621	0,12	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2054	1.300	1.033	0,20
Glencore Capital Finance DAC 4,154 % fällig am 29.04.2031	1.300	1.303	0,25	Syngenta Finance NV 4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 1.951	1.804	0,35	4,000 % fällig am 01.08.2054	3.400	2.904	0,56
Global Payments, Inc. 4,875 % fällig am 17.03.2031	1.100	1.138	0,22	Tapestry, Inc. 5,875 % fällig am 27.11.2031	€ 900	935	0,18	4,500 % fällig am 01.07.2054	3.400	2.991	0,58
GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024	1.800	1.768	0,34	TDF Infrastructure SASU 1,750 % fällig am 01.12.2029	3.200	2.814	0,55	5,000 % fällig am 01.08.2054	8.200	7.394	1,44
H Lundbeck A/S 0,875 % fällig am 14.10.2027	2.100	1.911	0,37	Teleperformance SE 5,750 % fällig am 22.11.2031	1.200	1.235	0,24	5,500 % fällig am 01.08.2054	4.300	3.957	0,77
Heidelberg Materials AG 3,950 % fällig am 19.07.2034	600	593	0,12	TenneT Holding BV 4,750 % fällig am 28.10.2042	1.100	1.202	0,23	6,000 % fällig am 01.08.2054	5.300	4.957	0,96
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1,625 % fällig am 18.09.2029	2.700	2.404	0,47	Tesco Corporate Treasury Services PLC 4,250 % fällig am 27.02.2031	1.100	1.122	0,22	6,500 % fällig am 01.08.2054	7.300	6.929	1,35
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 0,625 % fällig am 16.09.2028	1.300	1.108	0,22	Thames Water Utilities Finance PLC 1,250 % fällig am 31.01.2032	1.800	1.302	0,25			33.716	6,55
IMCD NV 2,125 % fällig am 31.03.2027	100	95	0,02	4,375 % fällig am 18.01.2031	2.200	1.899	0,37	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
International Distribution Services PLC 5,250 % fällig am 14.09.2028	1.600	1.646	0,32	Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	1.700	1.469	0,29	Canada Square Funding PLC 6,184 % fällig am 17.06.2058	£ 825	975	0,19
ISS Global A/S 0,875 % fällig am 18.06.2026	1.500	1.420	0,28	UCB S.A. 4,250 % fällig am 20.03.2030	1.000	999	0,19	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 6,247 % fällig am 25.08.2034	\$ 19	16	0,00
JDE Peet's NV 0,500 % fällig am 16.01.2029	3.850	3.338	0,65	VF Corp. 0,625 % fällig am 25.02.2032	300	213	0,04	Domi BV 4,349 % fällig am 15.06.2053	€ 777	779	0,15
John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034	£ 1.050	953	0,19	Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % fällig am 26.03.2028	1.300	1.142	0,22	Dutch Property Finance BV 4,514 % fällig am 28.07.2058	1.804	1.805	0,35
6,125 % fällig am 21.01.2025	800	945	0,18	Vmed O2 UK Financing PLC 5,625 % fällig am 15.04.2032	800	779	0,15	4,614 % fällig am 28.10.2059	3.057	3.063	0,60
Kering S.A. 3,375 % fällig am 11.03.2032	€ 2.300	2.260	0,44	Werfen S.A. 4,625 % fällig am 06.06.2028	3.100	3.169	0,62	Great Hall Mortgages PLC 5,763 % fällig am 18.06.2039	\$ 71	66	0,01
LKQ Dutch Bond BV 4,125 % fällig am 13.03.2031	1.300	1.299	0,25	Worldline S.A. 4,125 % fällig am 12.09.2028	1.400	1.392	0,27	Jubilee Place BV 4,738 % fällig am 17.01.2059	€ 2.015	2.023	0,39
Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % fällig am 15.12.2030	£ 93	106	0,02	Worley U.S. Finance Sub Ltd. 0,875 % fällig am 09.06.2026	1.200	1.135	0,22	4,888 % fällig am 17.10.2057	386	388	0,08
6,084 % fällig am 15.12.2030	\$ 324	283	0,05	Yorkshire Water Finance PLC 1,750 % fällig am 27.10.2032	£ 1.500	1.296	0,25	Landmark Mortgage Securities PLC 5,632 % fällig am 17.04.2044	£ 673	774	0,15
Molnlycke Holding AB 4,250 % fällig am 08.09.2028	€ 900	914	0,18	ZF Europe Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2029	€ 600	603	0,12	Miravet SARL 4,651 % fällig am 26.05.2065	€ 1.586	1.582	0,31
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0,625 % fällig am 09.09.2032	2.100	1.675	0,33			110.919	21,55	Newgate Funding PLC 4,319 % fällig am 15.12.2050	151	149	0,03
Motability Operations Group PLC 3,875 % fällig am 24.01.2034	2.000	1.980	0,38	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				Primrose Residential DAC 4,598 % fällig am 24.10.2061	2.037	2.032	0,39
MSD Netherlands Capital BV 3,750 % fällig am 30.05.2054	700	681	0,13	Alliander NV 4,500 % fällig am 27.03.2032	1.000	1.003	0,20	RMAC Securities PLC 5,503 % fällig am 12.06.2044	£ 74	85	0,02
Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	2.800	2.572	0,50	(b) E.ON SE 4,125 % fällig am 25.03.2044	800	791	0,15	Structured Asset Mortgage Investments Trust 6,153 % fällig am 19.12.2034	\$ 46	37	0,01
Nestle Finance International Ltd. 3,250 % fällig am 23.01.2037	1.500	1.456	0,28	Electricite de France S.A. 4,250 % fällig am 25.01.2032	2.700	2.745	0,53	Twin Bridges PLC 6,084 % fällig am 12.03.2055	£ 1.838	2.170	0,42
Netflix, Inc. 3,875 % fällig am 15.11.2029	4.500	4.562	0,89	EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	3.400	2.747	0,53			15.944	3,10
Pandora A/S 3,875 % fällig am 31.05.2030	1.600	1.595	0,31	FLUVIUS System Operator C.V. 3,875 % fällig am 09.05.2033	1.100	1.110	0,22	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Pernod Ricard S.A. 3,750 % fällig am 15.09.2033	900	903	0,18	Fortum Oyj 4,500 % fällig am 26.05.2033	1.500	1.563	0,30	Ares European CLO DAC 4,516 % fällig am 15.04.2030	€ 328	328	0,06
Robert Bosch GmbH 4,375 % fällig am 02.06.2043	1.400	1.428	0,28	Koninklijke KPN NV 0,875 % fällig am 14.12.2032	1.500	1.205	0,23	Aurium CLO DAC 4,750 % fällig am 23.03.2032	1.299	1.304	0,25
Sandoz Finance BV 4,220 % fällig am 17.04.2030	1.600	1.635	0,32	National Grid North America, Inc. 4,151 % fällig am 12.09.2027	1.700	1.725	0,34	Bastille Euro CLO DAC 5,056 % fällig am 15.01.2034	2.700	2.702	0,52
Sartorius Finance BV 4,875 % fällig am 14.09.2035	1.100	1.146	0,22	Oncor Electric Delivery Co. LLC 3,500 % fällig am 15.05.2031	1.300	1.292	0,25	Bosphorus CLO DAC 4,753 % fällig am 12.12.2032	1.900	1.899	0,37
				Orsted A/S 2,875 % fällig am 14.06.2033	1.000	935	0,18	Cairn CLO DAC 4,592 % fällig am 25.04.2032	581	581	0,11
				4,125 % fällig am 01.03.2035	300	307	0,06	Carlyle Euro CLO DAC 4,458 % fällig am 15.08.2030	346	347	0,07
								Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 4,883 % fällig am 16.01.2033	1.600	1.597	0,31
								Contego CLO BV 4,676 % fällig am 15.10.2030	593	593	0,11
								CVC Cordatus Loan Fund DAC 4,608 % fällig am 15.08.2032	806	806	0,16
								4,619 % fällig am 17.06.2032	900	900	0,17

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Dryden Euro CLO DAC	190	190	0,04	Voya Euro CLO DAC	140	140	0,03	Korea Housing Finance Corp.	3.100	3.168	0,62
4,688 % fällig am 15.05.2034 €				4,656 % fällig am 15.10.2030 €				4,082 % fällig am 25.09.2027 €			
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC	91	91	0,02			20.499	3,98	Mexico Government International Bond	900	760	0,15
4,797 % fällig am 20.01.2032								1,125 % fällig am 17.01.2030			
Harvest CLO DAC	200	200	0,04	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				6,350 % fällig am 09.02.2035 \$	2.200	2.069	0,40
4,756 % fällig am 15.01.2032				Adif Alta Velocidad	3.000	3.010	0,59	Netherlands Government International Bond	8.800	7.389	1,44
Invesco Euro CLO DAC	500	497	0,10	3,500 % fällig am 30.07.2028				0,500 % fällig am 15.07.2032 €			
4,556 % fällig am 15.07.2031				CPPIB Capital, Inc.	3.800	3.102	0,60	Province of Ontario	3.800	3.113	0,61
Jubilee CLO DAC	640	641	0,12	0,050 % fällig am 24.02.2031				0,010 % fällig am 25.11.2030			
4,506 % fällig am 15.04.2030				Europäische Finanzstabilisierungsfazilität	7.000	6.042	1,17	Province of Quebec	4.200	4.134	0,80
Madison Park Euro Funding DAC	600	596	0,12	1,250 % fällig am 24.05.2033				3,000 % fällig am 24.01.2033			
4,706 % fällig am 15.07.2032				2,375 % fällig am 11.04.2028	6.300	6.171	1,20	Republic of Poland Government International Bond	1.300	1.341	0,26
Man GLG Euro CLO DAC	2.582	2.575	0,50	3,000 % fällig am 15.12.2028	11.000	11.028	2,14	3,875 % fällig am 14.02.2033			
4,716 % fällig am 15.10.2032				Europäische Union				Romania Government International Bond	2.600	2.670	0,52
OCF Euro CLO DAC	202	202	0,04	0,000 % fällig am 04.07.2031 (a)	1.900	1.547	0,30	5,500 % fällig am 18.09.2028	1.600	1.666	0,32
4,726 % fällig am 15.01.2032				0,000 % fällig am 04.07.2035 (a)	4.300	3.066	0,60	6,375 % fällig am 18.09.2033	1.700	1.823	0,35
Palmer Square European Loan Funding DAC	2.065	2.054	0,40	0,400 % fällig am 04.02.2037	8.900	6.332	1,23	6,625 % fällig am 27.09.2029	7.200	7.126	1,38
4,626 % fällig am 15.10.2031				0,450 % fällig am 04.07.2041	9.700	6.059	1,18	Spain Government International Bond			
4,956 % fällig am 15.10.2031	681	679	0,13	1,500 % fällig am 04.10.2035	7.400	6.285	1,22	3,150 % fällig am 30.04.2033			
Renaissance Home Equity Loan Trust	1.291	380	0,07	2,750 % fällig am 04.02.2033	7.600	7.430	1,44				
5,340 % fällig am 25.01.2037 \$				2,750 % fällig am 04.12.2037	6.400	6.074	1,18				
Segovia European CLO DAC	499	497	0,10	Ile-de-France Mobilites	500	495	0,10				
4,777 % fällig am 20.07.2032 €				3,700 % fällig am 14.06.2038							
Toro European CLO DAC	500	500	0,10	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	2.500	2.543	0,49				
4,638 % fällig am 15.02.2034				4,000 % fällig am 30.10.2031	6.500	6.605	1,28				
4,832 % fällig am 12.01.2032				4,200 % fällig am 01.03.2034							
								Summe Übertragbare Wertpapiere	€	532.751	103,48

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 387	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	€ (368)	€ 361	€ 361	0,07
Summe Pensionsgeschäfte						€ (368)	€ 361	€ 361	0,07

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	10	€ (12)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	416	(681)	(0,13)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	101	310	0,06
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	55	23	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	531	244	0,05
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	175	57	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	81	49	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	172	(71)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	14	0	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	35	13	0,00
				€ (68)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (68)	(0,01)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
ITV PLC	(5,000) %	20.12.2028	€ 2.700	€ 4	0,00
Next Group PLC	(1,000)	20.06.2029	2.600	(15)	0,00
Publicis Groupe S.A.	(1,000)	20.06.2029	2.300	6	0,00
				€ (5)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 5.000	€ 18	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	1.300	11	0,00
Cellnex Telecom S.A.	5,000	20.12.2033	€ 2.600	51	0,01
				€ 80	0,01

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	1,000 %	20.06.2029	€ 3.000	€ (8)	0,00
iTraxx Europe Main 41 10-Year Index	1,000	20.06.2034	12.400	(90)	(0,02)
				€ (98)	(0,02)

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050 %	15.12.2031	¥ 1.860.000	€ (100)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	\$ 27.600	(507)	(0,10)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	15.100	(314)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	3.400	(98)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.09.2025	37.000	322	0,06
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 8.400	414	0,08
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	36.400	(527)	(0,09)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	19.200	(425)	(0,08)
					€ (1.235)	(0,23)
					€ (1.258)	(0,24)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### VERKAUFSoPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONEN AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 41 5-Year Index	Verkauf	0,850 %	18.09.2024	7.600	€ (11)	€ (7)	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 41 5-Year Index	Verkauf	0,900	18.09.2024	7.300	(10)	(6)	0,00
						€ (21)	€ (13)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	£ 10.978	€ 12.888	€ 0	€ (60)	€ (60)	(0,01)
	07.2024	\$ 8.318	7.661	0	(100)	(100)	(0,02)
BPS	07.2024	£ 111	130	0	(1)	(1)	0,00
BRC	09.2024	\$ 57	MXN 1.061	1	0	1	0,00
GLM	07.2024	€ 13.019	£ 10.987	0	(59)	(59)	(0,01)
	07.2024	¥ 21.887	€ 129	2	0	2	0,00
JPM	08.2024	£ 11.002	13.019	60	0	60	0,01
	10.2024	CNH 447	\$ 62	1	0	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
SCX	07.2024	€ 129	¥ 22.125	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	07.2024	7.661	\$ 8.210	1	(2)	(1)	0,00
	08.2024	¥ 22.054	€ 129	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 8.012	7.467	2	0	2	0,00
				€ 67	€ (222)	€ (155)	(0,03)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>€ (168)</b>	<b>(0,03)</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>€ 531.618</b>	<b>103,27</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>€ (16.857)</b>	<b>(3,27)</b>
<b>Nettovermogen</b>						<b>€ 514.761</b>	<b>100,00</b>

## ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null EUR (31. Dezember 2023: 8.413 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte als Sicherheit verpfandet.

Barmittel in Hohe von 8.381 EUR (31. Dezember 2023: 8.072 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 532.714	€ 37	€ 532.751
Pensionsgeschafte	0	361	0	361
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(103)	(1.391)	0	(1.494)
<b>Summen</b>	<b>€ (103)</b>	<b>€ 531.684</b>	<b>€ 37</b>	<b>€ 531.618</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 536.476	€ 39	€ 536.515
Investmentfonds	9.501	0	0	9.501
Pensionsgeschafte	0	14.437	0	14.437
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(104)	769	0	665
<b>Summen</b>	<b>€ 9.397</b>	<b>€ 551.682</b>	<b>€ 39</b>	<b>€ 561.118</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusatzlicher Informationen siehe Erlauterung 3 in den Erlauterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate konnen offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfandet fur OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfandet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfandet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfandet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (160)	€ 0	€ (160)	€ 1	€ 0	€ 1
BPS	(1)	0	(1)	(11)	0	(11)
BRC	(6)	0	(6)	(16)	0	(16)
GLM	3	0	3	(42)	0	(42)
GST	(6)	0	(6)	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	1	0	1	(1)	0	(1)
MBC	k. A.	k. A.	k. A.	129	(300)	(171)
MYI	k. A.	k. A.	k. A.	6	0	6
SCX	1	0	1	(20)	0	(20)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Betrage dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hatte bzw. die an ihn zu zahlen waren.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	97,54	90,72
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	5,74	9,16
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,20	k. A.
Investmentfonds	k. A.	1,77
Pensionsgeschäfte	0,07	2,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,24)	0,13
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,03)	0,01
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(1,52)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	68,28	75,08
US-Regierungsbehörden	6,55	6,21
Non-Agency-MBS	3,10	3,36
Forderungsbesicherte Wertpapiere	3,98	4,25
Staatsemissionen	21,57	10,98
Investmentfonds	k. A.	1,77
Pensionsgeschäfte	0,07	2,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,02)	k. A.
Zinsswaps	(0,23)	0,11
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,03)	0,01
Sonstige Aktiva und Passiva	(3,27)	(4,46)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund

30. Juni 2024

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Al Silk Midco Ltd. 8,785 % fällig am 04.03.2031	€ 1.000	€ 993	0,06	2,129 % fällig am 24.11.2026	\$ 2.800	€ 2.480	0,17	Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC	\$ 6.500	€ 3.965	0,27
Altice France S.A. 9,406 % fällig am 15.08.2028 10,829 % fällig am 15.08.2028	100 \$ 600	74 413	0,01 0,03	2,552 % fällig am 07.01.2028 3,035 % fällig am 28.05.2032 3,547 % fällig am 18.09.2031	3.600 200 1.100	3.107 157 904	0,21 0,01 0,06	Realkredit Danmark A/S 2,500 % fällig am 01.04.2036	DKK 0	0	0,00
Charter Communications Operating LLC 7,052 % fällig am 01.02.2027	2.494	2.327	0,16	DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	€ 6.400	5.915	0,40	Sagax AB 1,125 % fällig am 30.01.2027 2,250 % fällig am 13.03.2025 4,375 % fällig am 29.05.2030	€ 7.082 5.100 1.500	6.567 5.029 1.508	0,45 0,34 0,10
Market Bidco Ltd. 8,578 % fällig am 04.11.2027	€ 3.095	3.093	0,21	Fairfax Financial Holdings Ltd. 6,000 % fällig am 07.12.2033	5.600	5.311	0,36	Sagax Euro MTN NL BV 0,750 % fällig am 26.01.2028	1.400	1.245	0,08
Project Hudson 7,730 % fällig am 29.05.2026	\$ 800	750	0,05	Ford Motor Credit Co. LLC 2,700 % fällig am 10.08.2026 4,271 % fällig am 09.01.2027 4,542 % fällig am 01.08.2026	300 489 200	263 440 182	0,02 0,03 0,01	Santander UK Group Holdings PLC 2,896 % fällig am 15.03.2032	\$ 13.185	10.366	0,70
SCUR-Alpha 1503 GmbH 9,365 % fällig am 29.03.2030 10,830 % fällig am 29.03.2030	€ 1.200 \$ 2.469	1.154 2.183	0,08 0,15	Host Hotels & Resorts LP 5,700 % fällig am 01.07.2034	800	734	0,05	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026 1,750 % fällig am 24.11.2028	€ 3.700 3.500	3.474 3.042	0,24 0,21
Windstream Services LLC 11,679 % fällig am 21.09.2027	2.876	2.689	0,18	Goodman Australia Finance Pty. Ltd. 4,250 % fällig am 03.05.2030	€ 3.400	3.441	0,23	Societe Generale S.A. 2,797 % fällig am 19.01.2028 6,691 % fällig am 10.01.2034	\$ 10.800 300	9.302 289	0,63 0,02
		13.676	0,93					Standard Chartered PLC 6,750 % fällig am 08.02.2028	8.500	8.148	0,55
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSELBANKEN UND FINANZEN</b>											
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC 2,700 % fällig am 11.06.2023 ^	€ 8.200	1.230	0,08	HSBC Holdings PLC 2,099 % fällig am 04.06.2026 3,973 % fällig am 22.05.2030 5,402 % fällig am 11.08.2033	600 1.800 12.000	541 1.570 11.082	0,04 0,11 0,75	Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % Bargeld oder 6,000 % PIK) 5,000 % fällig am 30.09.2026 (c)	238	26	0,00
ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029	\$ 1.300	1.068	0,07	Hudson Pacific Properties LP 5,950 % fällig am 15.02.2028	800	635	0,04	Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK) 5,250 % fällig am 30.09.2027 (c)	238	22	0,00
ADLER Real Estate AG 3,000 % fällig am 27.04.2026	€ 600	543	0,04	ING Groep NV 4,000 % fällig am 12.02.2035	€ 5.500	5.543	0,38	Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK) 5,500 % fällig am 30.09.2027 (c)	477	42	0,00
AIB Group PLC 5,250 % fällig am 23.10.2031	1.820	1.947	0,13	Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % fällig am 21.11.2033	\$ 14.275	14.699	1,00	Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % bar oder 6,750 % PIK) 5,750 % fällig am 30.09.2028 (c)	716	57	0,00
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025	\$ 6.000	5.485	0,37	Iridium Capital PLC 9,250 % fällig am 18.06.2029	€ 1.500	1.513	0,10	Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK) 6,000 % fällig am 30.09.2029 (c)	717	50	0,00
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,625 % fällig am 24.09.2024	€ 1.458	1.455	0,10	JAB Holdings BV 2,250 % fällig am 19.12.2039 4,375 % fällig am 25.04.2034	4.600 3.600	3.459 3.619	0,23 0,25	Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK) 6,250 % fällig am 30.09.2030 (c)	337	23	0,00
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,381 % fällig am 13.03.2029	\$ 6.800	6.368	0,43	JPMorgan Chase & Co. 7,371 % fällig am 21.03.2034 5,766 % fällig am 22.04.2035	7.200 \$ 5.800	7.159 5.555	0,49 0,38	UBS Group AG 5,699 % fällig am 08.02.2035 6,246 % fällig am 22.09.2029 6,537 % fällig am 12.08.2033 7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 1.200 10.500 1.600 € 5.600	1.119 10.076 1.567 6.330	0,08 0,68 0,11 0,43
Banco Santander S.A. 4,379 % fällig am 12.04.2028	4.200	3.773	0,26	Kaisa Group Holdings Ltd. 10,875 % fällig am 23.07.2023 ^ 11,500 % fällig am 30.01.2023 ^ 11,650 % fällig am 01.06.2026 ^	5.400 3.500 4.000	183 114 135	0,01 0,01 0,01	UniCredit SpA 1,982 % fällig am 03.06.2027	\$ 500	435	0,03
Barclays PLC 7,437 % fällig am 02.11.2033	24.076	24.719	1,68	KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	2.000	1.880	0,13	VICI Properties LP 3,750 % fällig am 15.02.2027 3,875 % fällig am 15.02.2029 4,125 % fällig am 15.08.2030 4,500 % fällig am 15.01.2028 4,625 % fällig am 01.12.2029 5,750 % fällig am 01.02.2027	400 300 1.300 300 10.708 600	355 259 1.104 270 9.463 560	0,02 0,02 0,07 0,02 0,64 0,04
BNP Paribas S.A. 1,904 % fällig am 30.09.2028 2,871 % fällig am 19.04.2032 4,095 % fällig am 13.02.2034 5,738 % fällig am 20.02.2035	2.300 1.000 € 4.900 \$ 6.600	1.918 783 4.936 6.129	0,13 0,05 0,33 0,42	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	€ 5.800	5.528	0,37	Volkswagen Leasing GmbH 3,875 % fällig am 11.10.2028	€ 6.800	6.829	0,46
BPCE S.A. 5,748 % fällig am 19.07.2033 5,936 % fällig am 30.05.2035	12.350 900	11.422 837	0,77 0,06	Lloyds Banking Group PLC 4,750 % fällig am 21.09.2031	10.800	11.269	0,76	Wells Fargo & Co. 1,741 % fällig am 04.05.2030	8.500	7.764	0,53
CaixaBank S.A. 6,208 % fällig am 18.01.2029 6,684 % fällig am 13.09.2027	5.000 2.300	4.742 2.188	0,32 0,15	Mizuho Financial Group, Inc. 5,594 % fällig am 10.07.2035 (b)	\$ 4.000	3.719	0,25	Yango Justice International Ltd. 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	\$ 12.600	60	0,00
Castellum Helsinki Finance Holding Abp 2,000 % fällig am 24.03.2025	€ 5.500	5.402	0,37	Morgan Stanley 3,790 % fällig am 21.03.2030 4,656 % fällig am 02.03.2029	€ 4.300 2.784	4.305 2.872	0,29 0,19				
CI Financial Corp. 7,500 % fällig am 30.05.2029	\$ 900	832	0,06	NatWest Group PLC 6,016 % fällig am 02.03.2034	\$ 12.200	11.648	0,79	American Airlines Pass-Through Trust 3,350 % fällig am 15.04.2031	338	291	0,02
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 5.600	4.798	0,33	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK 0	0	0,00	Aston Martin Capital Holdings Ltd. 10,375 % fällig am 31.03.2029	£ 500	587	0,04
Commerzbank AG 4,625 % fällig am 17.01.2031	4.000	4.080	0,28	1,000 % fällig am 01.10.2050 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,500 % fällig am 01.10.2050	0 0 0	0 0 0	0,00 0,00 0,00	Bayer U.S. Finance LLC 4,375 % fällig am 15.12.2028 6,125 % fällig am 21.11.2026 6,375 % fällig am 21.11.2030 6,500 % fällig am 21.11.2033 6,875 % fällig am 21.11.2053	\$ 200 8.950 2.300 2.400 300	177 8.442 2.200 2.292 288	0,01 0,57 0,15 0,16 0,02
Cooperatieve Rabobank UA 4,655 % fällig am 22.08.2028	\$ 6.800	6.198	0,42	Nykredit Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2043 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,000 % fällig am 01.10.2053 1,500 % fällig am 01.10.2037 1,500 % fällig am 01.10.2050 2,500 % fällig am 01.10.2036	0 0 0 0 0 0	0 0 0 0 0	0,00 0,00 0,00 0,00 0,00	Carvana Co. (12,000 % PIK) 12,000 % fällig am 01.12.2028 (c)	829	797	0,05
Corestate Capital Holding S.A. (10,000 % bar oder 11,000 % PIK) 10,000 % fällig am 31.12.2026 (c)	€ 627	565	0,04					Carvana Co. (13,000 % PIK) 13,000 % fällig am 01.06.2030 (c)	2.400	2.344	0,16
Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK) 8,000 % fällig am 31.12.2026 (c)	2.600	1.053	0,07					Carvana Co. (14,000 % PIK) 14,000 % fällig am 01.06.2031 (c)	3.948	3.952	0,27
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % fällig am 12.07.2026 ^ 3,125 % fällig am 22.10.2025 ^	\$ 2.600 1.500	209 124	0,01 0,01								
Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 10.000	9.619	0,65								
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032 1,750 % fällig am 19.11.2030	700 6.200	584 5.457	0,04 0,37								







## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 5.654	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	€ (5.381)	€ 5.275	€ 5.275	0,36
Summe Pensionsgeschäfte						€ (5.381)	€ 5.275	€ 5.275	0,36

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	206	€ 353	0,02
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	4.127	(1.815)	(0,12)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	1.127	596	0,04
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	992	856	0,06
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	662	726	0,05
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	419	(247)	(0,02)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	22	(8)	0,00
				€ 461	0,03
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 461	0,03

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 2.400	€ (12)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	1.100	22	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2028	3.100	6	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	200	1	0,00
				€ 17	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000 %	20.12.2027	\$ 686	€ 48	0,00
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	5.346	190	0,01
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000	20.06.2029	10.600	(37)	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	2.400	13	0,00
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	31.400	(28)	0,00
				€ 186	0,01

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,700 %	28.03.2034	£ 1.000	€ 26	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	2.500	(136)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	62.300	(724)	(0,05)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320	20.10.2033	900	33	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 5.164.600	1.159	0,08
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,700	18.09.2029	1.033.000	(3)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	18.09.2034	532.000	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,868	05.05.2032	\$ 15.100	(1.958)	(0,13)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,040	25.05.2032	7.800	(908)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,068	11.05.2032	15.400	(1.794)	(0,12)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,153	18.05.2032	15.400	(1.687)	(0,11)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	39.900	5.447	0,37
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	3.085	(169)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	2.600	(126)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	14.06.2033	9.700	(415)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	12.07.2053	2.800	(216)	(0,02)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,420 %	24.05.2033	\$ 7.600	€ (272)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	40.200	(1.578)	(0,11)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	5.000	(187)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	12.200	(276)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	194.100	4.805	0,33
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	8.100	(231)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	248.300	10.847	0,73
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	27.000	(965)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	1.800	(49)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,555	05.03.2054	1.000	(30)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,594	09.01.2034	2.300	81	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,600	17.01.2034	2.200	84	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,620	31.01.2034	1.200	(34)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,648	08.01.2034	2.300	81	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	10.07.2033	4.600	(163)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.03.2034	2.400	(59)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,655	24.01.2034	1.300	(34)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,665	24.01.2034	2.300	(58)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,670	08.01.2034	2.500	84	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	1.200	39	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,685	24.01.2034	2.300	(54)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	05.03.2034	1.200	(25)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,710	05.03.2034	2.400	(49)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,725	07.02.2034	1.100	(21)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	1.300	(36)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	1.500	(40)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	23.01.2034	1.200	(24)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,738	23.01.2034	700	(14)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	74.000	(769)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	371.240	9.045	0,61
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	15.03.2030	46.000	1.983	0,13
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	3.300	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	12.07.2033	4.000	(109)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	1.200	32	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	240	3	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	120	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,760	23.08.2033	4.700	(115)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,783	07.02.2034	1.000	(14)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	5.000	(78)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	05.09.2028	8.500	(156)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	1.200	(26)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	30.08.2033	2.300	(48)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	1.200	27	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	700	4	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	1.200	24	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	2.200	42	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,860	21.02.2034	4.600	(39)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	700	9	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	700	10	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	30.08.2033	4.700	(63)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	10.04.2034	2.300	(10)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	15.04.2034	1.200	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	22.02.2029	6.800	(61)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	2.400	29	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	16.04.2034	2.500	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,970	27.02.2029	2.300	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	4.500	(7)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	2.200	13	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,078	29.04.2034	2.400	23	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	17.04.2034	2.300	22	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	05.06.2034	2.700	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,085	22.04.2034	2.300	25	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,090	30.04.2034	12.800	134	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,105	24.04.2034	6.600	79	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,130	03.05.2034	2.300	31	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	2.100	18	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	2.100	21	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,200	18.10.2033	1.800	22	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	2.200	30	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	1.100	16	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	2.200	(22)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	1.100	18	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	1.100	30	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	1.100	35	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	1.300	42	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	2.200	73	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,874	02.01.2026	BRL 10.600	(58)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,899	02.01.2026	5.400	(29)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,939	02.01.2026	9.200	(48)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,998	04.01.2027	15.500	(116)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,037	04.01.2027	4.200	(31)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,041	04.01.2027	17.100	(126)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,052 %	02.01.2026	BRL 21.000	€ (102)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,072	04.01.2027	7.860	(44)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,085	02.01.2026	20.900	(100)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,090	04.01.2027	32.200	(231)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,098	04.01.2027	23.760	(131)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,105	02.01.2026	20.700	(99)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,138	04.01.2027	8.000	(56)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,165	04.01.2027	12.050	(63)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,170	04.01.2027	20.100	(105)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,183	04.01.2027	36.110	(188)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,203	04.01.2027	28.140	(144)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,210	04.01.2027	4.050	(21)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,256	04.01.2027	28.110	(139)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,328	04.01.2027	21.530	(101)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,750	20.12.2025	CAD 23.100	275	0,02
Zahlung	3-Month EUR-EURIBOR		3,150	30.01.2025	€ 667.700	1.951	0,13
Zahlung	3-Month NZD-BBR		4,750	19.06.2029	NZD 9.700	17	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,360	07.08.2028	ZAR 26.500	16	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,380	04.08.2028	11.700	7	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,400	07.08.2028	26.500	18	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,410	31.07.2028	12.600	9	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,410	04.08.2028	28.300	20	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,410	07.08.2028	7.900	5	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,415	31.07.2028	10.100	7	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,415	04.08.2028	11.800	8	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,420	31.07.2028	37.700	27	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,421	04.08.2028	12.000	9	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,426	01.08.2028	15.200	11	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,428	31.07.2028	25.100	18	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,460	01.08.2028	25.700	20	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,460	02.08.2028	26.100	21	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,464	02.08.2028	26.100	21	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,543	04.08.2028	12.000	11	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,550	03.08.2028	24.200	23	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,500	20.09.2033	AUD 13.200	52	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,500	20.03.2034	11.200	60	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,500	18.09.2034	2.400	(26)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,830	09.12.2052	€ 26.700	1.430	0,10
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,520	07.07.2027	9.600	(415)	(0,03)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		2,500	18.09.2054	59.000	2.280	0,15
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		2,650	08.01.2034	2.200	52	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,670	03.04.2034	1.000	19	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	18.09.2029	576.900	(7.851)	(0,53)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	05.03.2034	1.600	(11)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		2,750	18.09.2034	335.900	(7.749)	(0,53)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,760	03.01.2029	1.800	24	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,760	04.03.2034	1.600	(10)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,770	16.04.2029	2.400	(14)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,770	29.04.2034	1.600	(6)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,780	02.05.2029	2.400	(12)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,818	26.06.2029	2.400	9	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,860	24.04.2029	3.600	(5)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,880	19.12.2028	2.600	(30)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,890	22.12.2033	2.100	(36)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,910	29.12.2033	1.400	(27)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,920	13.12.2028	3.100	(41)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,950	29.12.2028	1.700	(26)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		2,950	12.06.2029	1.900	9	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,970	15.12.2033	2.200	(52)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		2,990	08.12.2033	1.800	(45)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	18.09.2026	11.500	71	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,063	06.12.2033	1.300	(40)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,128	04.12.2033	1.000	(37)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,148	20.11.2033	1.600	(61)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,179	29.11.2028	1.300	(32)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,250	06.11.2033	1.600	(73)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,255	22.11.2028	1.200	(33)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,270	08.11.2028	2.600	(72)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,270	21.08.2033	1.600	86	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,280	22.11.2033	800	(39)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		3,305	27.11.2033	1.700	(88)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		3,450	20.10.2028	2.700	108	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,300	16.06.2028	MXN 20.600	(39)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,444	25.07.2028	48.100	(107)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,471	26.07.2028	24.200	(52)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,512	24.07.2028	36.400	(76)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,550	27.07.2028	12.300	(25)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,556	27.07.2028	73.000	(147)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,600	31.07.2028	23.500	(44)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,620	28.07.2028	12.000	(23)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,636	28.07.2028	23.800	(44)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,640	28.07.2028	4.800	(9)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,650 %	28.07.2028	MXN 12.100	€ (22)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,660	28.07.2028	11.900	(22)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIIE	8,673	31.05.2029	3.800	7	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,680	31.05.2029	5.400	10	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,681	31.05.2029	6.900	13	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIIE	8,683	31.05.2029	2.500	5	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,720	07.03.2029	2.200	4	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,725	07.03.2029	5.500	10	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,730	07.03.2029	3.300	6	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,760	01.03.2029	8.900	14	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,770	01.03.2029	4.500	7	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,780	01.03.2029	4.500	7	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,810	29.05.2031	4.600	8	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,073	03.06.2027	15.200	18	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,260	03.06.2027	9.000	8	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,340	03.06.2027	17.100	14	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,500	15.01.2025	€ 68.100	94	0,01
					€ 8.164	0,56
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>€ 8.367</b>	<b>0,57</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSoPTIONEN

##### DEVIsoENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
DUB	Call - OTC USD versus MXN	MXN 18,150	06.02.2025	1.581	€ (67)	€ (92)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	18,100	11.02.2025	631	(27)	(38)	0,02
	Call - OTC USD versus MXN	18,150	13.02.2025	1.579	(66)	(94)	(0,01)
MYI	Call - OTC USD versus MXN	18,230	29.01.2025	1.590	(71)	(88)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	18,250	30.01.2025	1.590	(70)	(87)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	18,150	10.02.2025	1.589	(66)	(94)	(0,01)
					€ (367)	€ (493)	(0,03)

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	2.300	€ (10)	€ (3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	2.300	(10)	0	0,00
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700	04.07.2024	2.400	(3)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	2.400	(3)	(1)	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,700	05.07.2024	1.500	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	1.500	(5)	(1)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	1.600	(6)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	1.600	(6)	(7)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,885	10.07.2024	31.200	(99)	(110)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,235	10.07.2024	31.200	(99)	(14)	(0,01)
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	3.500	(11)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	3.500	(11)	(1)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	1.200	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	1.200	(4)	(1)	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,800	03.07.2024	1.300	(5)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,150	03.07.2024	1.300	(5)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	2.400	(6)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	2.400	(8)	(6)	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	2.400	(9)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	2.400	(8)	(13)	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	2.400	(6)	(10)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	2.400	(9)	(3)	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	1.500	(4)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	1.500	(4)	(7)	0,00
					€ (341)	€ (203)	(0,02)		

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	\$ 94.969	08.07.2024	1.100	€ (4)	€ 0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97.266	08.07.2024	2.700	(5)	(3)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97.719	08.07.2024	1.200	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97.969	08.07.2024	1.100	(3)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	95.594	06.08.2024	1.700	(4)	(6)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	98.594	06.08.2024	1.700	(3)	(2)	0,00
					€ (21)	€ (12)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
GST	ADLER Real Estate AG	5,000 %	20.12.2026	€ 1.200	€ (6)	€ (31)	€ (37)	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AZD	07.2024	\$ 500	€ 466	€ 0	€ (1)	€ (1)	0,00
BOA	07.2024	€ 1.671	\$ 1.800	9	0	9	0,00
	07.2024	\$ 524.816	€ 483.390	0	(6.292)	(6.292)	(0,43)
	07.2024	2	KRW 2.861	0	0	0	0,00
	08.2024	575	TRY 20.137	6	0	6	0,00
	02.2025	636	MXN 11.608	0	(21)	(21)	0,00
BPS	07.2024	€ 1.329	£ 1.125	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	16.678	\$ 18.066	179	0	179	0,01
	07.2024	£ 1.520	€ 1.781	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	\$ 11.803	BRL 61.468	0	(687)	(687)	(0,05)
	07.2024	6.669	€ 6.166	0	(56)	(56)	0,00
	07.2024	2	KRW 2.846	0	0	0	0,00
	08.2024	499	\$ 14	0	0	0	0,00
	09.2024	CNH 277	39	0	0	0	0,00
	09.2024	MXN 49.817	2.673	0	(17)	(17)	0,00
	09.2024	TWD 1.384	43	0	0	0	0,00
	05.2029	KWD 675	2.320	128	0	128	0,01
BRC	07.2024	€ 343	AUD 551	1	0	1	0,00
	07.2024	2.071	CAD 3.028	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	1.187	£ 1.003	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	\$ 8.594	€ 8.045	26	0	26	0,00
	07.2024	4.563	TRY 157.074	118	0	118	0,01
	08.2024	AUD 551	€ 343	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	CAD 3.030	2.071	6	0	6	0,00
	08.2024	\$ 3.168	TRY 109.634	19	0	19	0,00
	09.2024	MXN 69.746	\$ 3.722	0	(43)	(43)	0,00
	09.2024	\$ 2.194	TRY 80.816	93	0	93	0,01
	11.2024	90	3.543	4	0	4	0,00
	02.2025	632	MXN 11.462	0	(24)	(24)	0,00
CBK	07.2024	BRL 61.485	\$ 11.284	200	0	200	0,01
	07.2024	\$ 752	TRY 25.363	3	0	3	0,00
	08.2024	11.284	BRL 61.691	0	(202)	(202)	(0,01)
	09.2024	TWD 528	\$ 16	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 8.449	INR 706.386	6	(3)	3	0,00
	01.2025	604	MXN 11.001	0	(20)	(20)	0,00
DUB	07.2024	¥ 70.000	€ 413	7	0	7	0,00
	08.2024	\$ 1.973	BRL 10.154	0	(141)	(141)	(0,01)
	02.2025	MXN 27.506	\$ 1.517	60	0	60	0,00
	02.2025	\$ 885	MXN 16.075	0	(34)	(34)	0,00
	03.2025	277	TRY 13.165	31	0	31	0,00
GLM	07.2024	€ 99.409	£ 83.899	0	(453)	(453)	(0,03)
	07.2024	27.308	¥ 4.639.438	0	(397)	(397)	(0,03)
	07.2024	£ 15.742	€ 18.582	15	0	15	0,00
	07.2024	\$ 7.533	7.015	0	(13)	(13)	0,00
	07.2024	331	TRY 11.306	8	0	8	0,00
	07.2024	ZAR 1.310	\$ 72	0	0	0	0,00
	08.2024	£ 84.008	€ 99.409	452	0	452	0,03
	08.2024	\$ 1.962	TRY 67.719	10	0	10	0,00
	09.2024	1.058	39.299	52	0	52	0,00
JPM	07.2024	DKK 710	€ 95	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	€ 2.411	\$ 2.598	€ 13	€ 0	€ 13	0,00
	07.2024	£ 90.129	€ 105.840	0	(464)	(464)	(0,03)
	07.2024	\$ 18.314	17.017	9	(80)	(71)	0,00
	07.2024	7.082	IDR 114.852.065	0	(58)	(58)	0,00
	07.2024	423	TRY 14.347	6	0	6	0,00
	07.2024	ZAR 2.482	\$ 135	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 1.330	TRY 45.732	5	0	5	0,00
	09.2024	TWD 898	\$ 28	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 1.150	INR 96.351	3	0	3	0,00
	10.2024	CNH 515	\$ 72	1	0	1	0,00
	03.2025	\$ 240	TRY 11.632	32	0	32	0,00
MBC	07.2024	AUD 561	€ 343	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	€ 12.729	\$ 13.636	20	(26)	(6)	0,00
	07.2024	€ 12.334	€ 11.492	0	(16)	(16)	0,00
	08.2024	€ 1.494	£ 1.266	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	\$ 11.968	€ 11.176	26	0	26	0,00
	02.2025	636	MXN 11.536	0	(25)	(25)	0,00
MYI	07.2024	€ 95	DKK 710	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 16.545	\$ 17.697	0	(33)	(33)	0,00
	07.2024	£ 1.503	€ 1.778	5	0	5	0,00
	07.2024	\$ 5.845	5.461	8	0	8	0,00
	08.2024	DKK 710	95	0	0	0	0,00
	09.2024	MXN 3.121	\$ 165	0	(3)	(3)	0,00
	09.2024	TWD 357	11	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 769	INR 64.314	0	0	0	0,00
	01.2025	MXN 11.005	\$ 604	20	0	20	0,00
	02.2025	23.148	1.272	45	0	45	0,00
SCX	07.2024	CAD 3.072	€ 2.071	0	(24)	(24)	0,00
	07.2024	€ 494.332	\$ 529.627	0	(162)	(162)	(0,01)
	07.2024	£ 69.926	€ 81.918	0	(558)	(558)	(0,04)
	07.2024	IDR 113.455.122	\$ 6.963	27	0	27	0,00
	07.2024	¥ 1.653.080	€ 9.625	37	0	37	0,00
	07.2024	\$ 2	KRW 2.887	0	0	0	0,00
	07.2024	4	MXN 75	0	0	0	0,00
	07.2024	262	ZAR 4.827	2	0	2	0,00
	08.2024	€ 9.625	¥ 1.647.744	0	(37)	(37)	0,00
	08.2024	\$ 530.405	€ 494.332	155	0	155	0,01
	09.2024	CNH 130	\$ 18	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 519	16	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 5.216	INR 436.586	7	0	7	0,00
TOR	07.2024	600	€ 551	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	145	ZAR 2.620	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07.2024	€ 7.000	\$ 7.569	62	0	62	0,01
	07.2024	\$ 12.724	€ 11.762	0	(110)	(110)	(0,01)
				€ 1.916	€ (10.046)	€ (8.130)	(0,55)
Summe Freiverkehrsfina- nzderivate						€ (8.875)	(0,60)
Summe Anlagen						€ 2.287.940	155,05
Sonstige Aktiva und Passiva						€ (812.327)	(55,05)
Nettovermögen						€ 1.475.613	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,18 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Corestate Capital Holding S.A.	22.08.2023	€ 0	€ 0	0,00

- (j) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 59.587 USD (31. Dezember 2023: 4.450 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 50.862 EUR (31. Dezember 2023: 49.537 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 9.442 EUR (31. Dezember 2023: 317 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 2.137.136	€ 1.047	€ 2.138.183
Investmentfonds	141.639	2.890	0	144.529
Pensionsgeschäfte	0	5.275	0	5.275
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.470)	1.423	0	(47)
<b>Summen</b>	<b>€ 140.169</b>	<b>€ 2.146.724</b>	<b>€ 1.047</b>	<b>€ 2.287.940</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.696.971	€ 1.173	€ 1.698.144
Investmentfonds	135.514	0	0	135.514
Pensionsgeschäfte	0	137.975	0	137.975
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.531)	23.389	0	21.858
<b>Summen</b>	<b>€ 133.983</b>	<b>€ 1.858.335</b>	<b>€ 1.173</b>	<b>€ 1.993.491</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
COM	3,730 %	14.06.2024	24.07.2024	€ (9.842)	€ (9.859)	(0,67)
	3,730	17.06.2024	24.07.2024	(7.965)	(7.976)	(0,54)
JML	3,700	27.06.2024	24.07.2024	(26.510)	(26.521)	(1,80)
MEI	3,730	24.06.2024	24.07.2024	(15.223)	(15.234)	(1,03)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>€ (59.590)</b>	<b>(4,04)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	€ (1)	€ 0	€ (1)	€ k. A.	€ k. A.	€ k. A.
BOA	(6.301)	6.811	510	(4)	0	(4)
BPS	(466)	270	(196)	(117)	0	(117)
BRC	186	(103)	83	95	0	95
CBK	(27)	0	(27)	361	(290)	71
DUB	(301)	299	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(124)	0	(124)	(26)	0	(26)
GLM	(332)	261	(71)	1.014	(643)	371
GST	(37)	93	56	(221)	317	96
JPM	(550)	821	271	(74)	0	(74)
MBC	(31)	0	(31)	(22)	0	(22)
MYC	(43)	0	(43)	(82)	0	(82)
MYI	(227)	215	(12)	1.828	(3.757)	(1.929)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	(224)	(40)	(264)
SCX	(553)	672	119	(297)	0	(297)
TOR	(11)	0	(11)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(48)	0	(48)	(6)	0	(6)
ULO	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	57,98	54,60
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	80,85	67,81
Sonstige übertragbare Wertpapiere	6,07	0,00
Investmentfonds	9,79	9,77
Pensionsgeschäfte	0,36	9,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,03	0,38
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,57	1,03
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,60)	0,16
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(4,04)	(0,31)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,93	0,88
Unternehmensanleihen und Wechsel	31,38	29,42
Wandelanleihen & Wechsel	0,05	0,07
US-Regierungsbehörden	56,39	47,18
US-Schatzobligationen	0,76	1,15
Non-Agency-MBS	24,81	21,02
Forderungsbesicherte Wertpapiere	18,72	14,58
Staatsemissionen	2,84	1,48
Stammaktien	0,00	0,03
Kurzfristige Instrumente	9,02	6,60
Investmentfonds	9,79	9,77
Pensionsgeschäfte	0,36	9,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,03	0,38
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,07
Zinsswaps	0,56	0,97
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,03)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,03)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,55)	0,20
Sonstige Aktiva und Passiva	(55,05)	(43,70)
Nettovermögen	100,00	100,00



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
FACT Master S.A. 4,306 % fällig am 20.07.2028 €	3.293	€ 3.300	0,28	OZLME DAC 4,684 % fällig am 27.07.2032 €	2.583	€ 2.583	0,22	5,875 % fällig am 30.04.2029 \$	1.100	€	0,09
FCT CA Leasing 4,665 % fällig am 26.02.2042	1.055	1.060	0,09	Palmer Square European Loan Funding DAC 4,626 % fällig am 15.10.2031	4.204	4.183	0,36	Europäische Union 3,000 % fällig am 04.12.2034 €	24.700	24.354	2,10
FTA Santander Consumer Spain Auto 4,400 % fällig am 22.06.2035	1.517	1.517	0,13	5,123 % fällig am 15.08.2033	2.500	2.497	0,22	3,000 % fällig am 04.03.2053	300	273	0,02
FTA Santander Consumo 4,514 % fällig am 21.12.2037	3.000	3.012	0,26	5,328 % fällig am 15.05.2033	1.014	1.013	0,09	3,250 % fällig am 04.02.2050	3.900	3.740	0,32
Ginkgo Personal Loans 4,388 % fällig am 23.09.2044	1.600	1.608	0,14	5,606 % fällig am 15.01.2033	2.687	2.692	0,23	France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.05.2072	6.750	2.364	0,20
Ginkgo Sales Finance 4,300 % fällig am 25.11.2049	187	188	0,02	Pony S.A., Compartement German Auto Loans 4,270 % fällig am 14.11.2032	1.600	1.610	0,14	0,750 % fällig am 25.05.2052	9.200	4.603	0,40
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,717 % fällig am 20.04.2034	3.600	3.577	0,31	Providus CLO DAC 4,558 % fällig am 14.05.2031	911	913	0,08	1,250 % fällig am 25.05.2053	30.000	14.635	1,26
Harvest CLO DAC 4,666 % fällig am 15.07.2031	298	297	0,03	Red & Black Auto Italy SRL 4,646 % fällig am 28.07.2034	1.194	1.203	0,10	25.05.2038 (c)	24.100	18.252	1,58
Hayfin Emerald CLO DAC 4,706 % fällig am 15.04.2034	2.500	2.486	0,21	Red & Black Auto Lease France 4,322 % fällig am 27.06.2035	5.900	5.919	0,51	1,500 % fällig am 25.05.2050	27.600	17.765	1,53
Hill FL BV 4,309 % fällig am 18.02.2032	2.300	2.316	0,20	Retail Automotive CP Germany UG 4,308 % fällig am 21.07.2034	4.556	4.577	0,40	1,750 % fällig am 25.05.2066	34.670	21.319	1,84
Laurelin DAC 4,617 % fällig am 20.10.2031	3.977	3.982	0,34	Revocar UG 4,168 % fällig am 21.02.2037	3.752	3.764	0,32	2,000 % fällig am 25.05.2048	25.600	18.962	1,64
LT Autorahoiitus DAC 4,159 % fällig am 18.05.2035	1.610	1.614	0,14	4,268 % fällig am 21.04.2036	215	216	0,02	2,500 % fällig am 25.05.2043	87.200	74.026	6,40
Madison Park Euro Funding DAC 4,622 % fällig am 25.10.2030	1.686	1.682	0,15	Rockford Tower Europe CLO DAC 5,220 % fällig am 24.04.2037	3.400	3.403	0,29	3,000 % fällig am 25.06.2049	6.200	5.561	0,48
Man Euro CLO DAC 5,656 % fällig am 15.10.2036	1.000	1.002	0,09	SC Germany S.A. Compartment Consumer 4,280 % fällig am 14.01.2038	4.000	4.016	0,35	3,000 % fällig am 25.05.2054	84.150	73.260	6,33
Man GLG Euro CLO DAC 4,586 % fällig am 15.10.2030	128	129	0,01	4,350 % fällig am 15.09.2037	1.600	1.609	0,14	3,250 % fällig am 25.05.2045	51.200	48.565	4,20
Marlay Park CLO DAC 4,646 % fällig am 15.10.2030	1.085	1.085	0,09	Silver Arrow Athlon NL BV 4,322 % fällig am 26.04.2031	278	278	0,02	4,000 % fällig am 25.10.2038	8.400	8.898	0,77
Marzio Finance SRL 4,685 % fällig am 28.05.2049	3.434	3.459	0,30	Silver Arrow S.A. 4,079 % fällig am 15.09.2030	1.224	1.226	0,11	4,000 % fällig am 25.04.2055	56.850	59.771	5,16
NovaStar Mortgage Funding Trust 6,165 % fällig am 25.01.2036 \$	134	124	0,01	Titihau CLO DAC 4,723 % fällig am 04.08.2034	347	347	0,03	4,000 % fällig am 25.04.2060	56.450	59.866	5,17
Oak Hill European Credit Partners DAC 4,627 % fällig am 20.01.2032 €	1.524	1.523	0,13	Toro European CLO DAC 4,638 % fällig am 15.02.2034	400	400	0,03	4,500 % fällig am 25.04.2041 (c)	119.950	134.356	11,62
				Vesey Park CLO DAC 4,774 % fällig am 16.11.2032	2.000	1.992	0,17	Ile-de-France Mobilites 3,400 % fällig am 25.05.2043	900	840	0,07
				Voya Euro CLO DAC 4,656 % fällig am 15.10.2030	280	280	0,02	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,662 % fällig am 15.10.2028	7.000	7.018	0,61
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>		167.252	14,45	Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap 3,500 % fällig am 22.06.2045	3.500	3.418	0,30
				Austria Government International Bond 0,850 % fällig am 30.06.2120	110	47	0,00	Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2038 (a)	20.800	14.056	1,21
				Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % fällig am 05.05.2026 \$	600	558	0,05	0,000 % fällig am 15.01.2052 (a)	35.500	16.531	1,43
								2,000 % fällig am 15.01.2054	37.200	30.602	2,64
								2,750 % fällig am 15.01.2047	28.950	28.202	2,44
								3,250 % fällig am 15.01.2044	12.700	13.260	1,15
								Bundesrepublik Deutschland 1,250 % fällig am 15.08.2048 (d)	25.300	18.945	1,64
								2,500 % fällig am 04.07.2044	55.900	54.132	4,68
								2,500 % fällig am 15.08.2046	48.900	47.288	4,09
								4,250 % fällig am 04.07.2039 (d)	800	954	0,08
								4,750 % fällig am 04.07.2040 (c)	10.300	13.049	1,13
								Romania Government International Bond 5,625 % fällig am 30.05.2037	1.300	1.255	0,11
								Slovenia Government International Bond 1,500 % fällig am 25.03.2035	16.700	13.968	1,21
								3,000 % fällig am 10.03.2034	100	97	0,01
										903.963	78,12
								<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>	<b>€ 1.343.825</b>	<b>116,13</b>	

### PENSIONS-GESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettvermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 898	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	€ (855)	€ 838	€ 838	0,07
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>€ (855)</b>	<b>€ 838</b>	<b>€ 838</b>	<b>0,07</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	325	€ (51)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	163	(82)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	278	(194)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	251	(190)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	1.953	3.462	0,29
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	384	327	0,03
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	39	18	0,00

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	1.592	€ (884)	(0,08)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	960	(596)	(0,05)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	689	481	0,04
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	141	(195)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	287	(142)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	203	(426)	(0,04)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	165	62	0,01
				€ 1.590	0,13

**VERKAUFSOPTIONEN****FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - EUREX Euro-Schatz August 2024 Futures	€ 106,200	26.07.2024	477	€ (77)	€ (31)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					€ 1.559	0,13

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250 %	18.09.2026	£ 39.900	€ 88	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	\$ 3.100	(47)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	6.700	38	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	6.300	(38)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	17.200	(355)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	34.500	470	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,611	31.10.2025	63.800	(584)	(0,05)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	18.09.2074	€ 100	(2)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	65.300	2.379	0,20
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	167.600	(3.345)	(0,29)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,670	24.07.2024	1.105.000	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,750	23.08.2024	463.000	168	0,01
					€ (1.229)	(0,11)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ (1.229)	(0,11)

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**VERKAUFSOPTIONEN****ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950 %	15.09.2025	16.000	€ (181)	€ (164)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	15.09.2025	16.000	(181)	(94)	(0,01)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	4.500	(53)	(41)	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	4.500	(54)	(26)	0,00
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	9.800	(115)	(79)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	9.800	(115)	(64)	(0,01)
							€ (699)	€ (468)	(0,04)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.**DEIVSINTERMINKONTRAKTE**

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD	18	\$ 12	€ 0	€ 0	0,00
	07.2024	NZD	475	292	2	0	0,00
	07.2024	\$	66	NZD 109	0	0	0,00
	08.2024	NZD	109	\$ 66	0	0	0,00
BOA	10.2024	\$	1.800	CNH 12.886	0	(19)	0,00
	07.2024	£	48.905	€ 57.467	21	(236)	(0,02)
	07.2024	KRW	2.659.266	\$ 1.944	12	0	0,00
	07.2024	SGD	44	32	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 24.067	€ 22.167	€ 0	€ (290)	€ (290)	(0,02)
	07.2024	405	PLN 1.613	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	33	SGD 44	0	0	0	0,00
BPS	08.2024	SGD 44	\$ 33	0	0	0	0,00
	07.2024	CNH 36.801	5.084	39	0	39	0,00
	07.2024	€ 1.689	1.820	9	0	9	0,00
	07.2024	KRW 2.639.341	1.923	6	0	6	0,00
	07.2024	\$ 12	AUD 18	0	0	0	0,00
	07.2024	5.084	CNY 36.140	0	(67)	(67)	(0,01)
	07.2024	3.555	€ 3.262	0	(56)	(56)	0,00
	07.2024	350	IDR 5.735.237	0	0	0	0,00
	07.2024	101	ILS 376	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	954	PLN 3.789	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	2.310	SGD 3.133	2	0	2	0,00
	08.2024	AUD 18	\$ 12	0	0	0	0,00
	08.2024	SGD 3.128	2.310	0	(2)	(2)	0,00
	09.2024	CNH 15.185	2.119	25	0	25	0,00
	09.2024	TWD 80.479	2.501	14	0	14	0,00
	09.2024	\$ 703	INR 58.806	1	0	1	0,00
	10.2024	CNH 5.234	\$ 731	7	0	7	0,00
BRC	10.2024	\$ 354	CNH 2.538	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	€ 3.713	AUD 5.973	9	0	9	0,00
	07.2024	3.815	CAD 5.578	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	4.053	\$ 4.380	34	0	34	0,00
	07.2024	£ 2.373	€ 2.786	0	(13)	(13)	0,00
	07.2024	MXN 7.214	\$ 390	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	\$ 551	PLN 2.202	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	AUD 5.977	€ 3.713	0	(9)	(9)	0,00
	08.2024	CAD 5.582	3.815	11	0	11	0,00
	08.2024	€ 2.140	\$ 2.291	0	(5)	(5)	0,00
	09.2024	MXN 10.777	570	0	(11)	(11)	0,00
	09.2024	\$ 2.666	MXN 49.955	31	0	31	0,00
CBK	07.2024	CHF 2	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 2.136	£ 1.807	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	KRW 185.491	\$ 136	1	0	1	0,00
	07.2024	NOK 4.792	€ 420	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.209	BRL 6.590	0	(21)	(21)	0,00
	07.2024	1.040	PLN 4.124	0	(13)	(13)	0,00
	08.2024	BRL 6.612	\$ 1.209	22	0	22	0,00
	09.2024	TWD 30.684	952	4	0	4	0,00
	09.2024	\$ 3.326	INR 278.105	2	(1)	1	0,00
DUB	07.2024	KRW 1.442.547	\$ 1.049	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 998	PLN 3.922	0	(21)	(21)	0,00
	08.2024	BRL 2.402	\$ 467	33	0	33	0,00
GLM	07.2024	€ 62.460	£ 52.715	0	(284)	(284)	(0,02)
	07.2024	£ 3.679	€ 4.343	4	0	4	0,00
	07.2024	¥ 23.978	141	2	0	2	0,00
	07.2024	MXN 6.386	\$ 344	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	\$ 648	PLN 2.558	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	1.422	ZAR 26.024	1	0	1	0,00
	08.2024	£ 52.783	€ 62.460	283	0	283	0,03
	08.2024	\$ 977	BRL 5.010	0	(73)	(73)	(0,01)
JPM	07.2024	CHF 991	€ 1.011	0	(17)	(17)	0,00
	07.2024	CNY 1.215	\$ 171	2	0	2	0,00
	07.2024	IDR 13.497.791	832	7	0	7	0,00
	07.2024	KRW 1.780.299	1.291	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	SGD 3.133	2.328	15	0	15	0,00
	07.2024	\$ 27	CHF 24	0	0	0	0,00
	07.2024	250	ILS 923	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	397	PLN 1.553	0	(10)	(10)	0,00
	07.2024	2.678	ZAR 49.294	17	0	17	0,00
	08.2024	CHF 24	\$ 27	0	0	0	0,00
	08.2024	NZD 209	127	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 79	CNY 564	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 52.204	\$ 1.621	8	0	8	0,00
	09.2024	\$ 382	INR 31.975	1	0	1	0,00
	10.2024	CNH 9.017	\$ 1.260	13	0	13	0,00
MBC	10.2024	\$ 354	CNH 2.530	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	AUD 5.756	€ 3.518	0	(69)	(69)	(0,01)
	07.2024	CHF 3.311	3.351	0	(87)	(87)	(0,01)
	07.2024	€ 1.164	NZD 2.037	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	1.216	\$ 1.324	19	0	19	0,00
MYI	07.2024	AUD 319	€ 195	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	BRL 6.588	\$ 1.275	83	0	83	0,01
	07.2024	€ 4.765	CHF 4.576	0	(14)	(14)	0,00
	07.2024	421	NOK 4.801	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 13	€ 1	0	0	0	0,00
	08.2024	CHF 4.566	4.765	14	0	14	0,00
	08.2024	NOK 4.805	421	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 20.767	\$ 647	5	0	5	0,00
	09.2024	\$ 255	INR 21.343	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	CHF 269	€ 273	0	(7)	(7)	0,00
SCX	07.2024	CAD 5.659	3.815	0	(44)	(44)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	CNY	34.925	\$ 4.911	€ 62	€ 0	0,01
	07.2024	€	141	¥ 24.238	0	(1)	0,00
	07.2024		18.470	\$ 19.789	0	(6)	0,00
	07.2024	IDR	164.120	10	0	0	0,00
	07.2024	KRW	1.339.328	982	9	9	0,00
	07.2024	MXN	54	3	0	0	0,00
	07.2024	ZAR	699	38	0	0	0,00
	08.2024	¥	24.160	€ 141	1	0	0,00
	08.2024	\$	19.818	18.470	6	0	0,00
	09.2024	CNH	6.231	\$ 869	9	0	0,00
	09.2024	TWD	30.186	936	4	0	0,00
	09.2024	\$	3.013	INR 252.215	4	0	0,00
TOR	07.2024		97	NZD 158	0	(1)	0,00
	08.2024	NZD	158	97	0	0	0,00
UAG	07.2024	CHF	22	25	0	0	0,00
	07.2024	ILS	1.635	441	6	0	0,00
					€ 861	€ (1.452)	€ (591) (0,05)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>€ (1.059)</b>	<b>(0,09)</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>€ 1.343.934</b>	<b>116,13</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>€ (186.626)</b>	<b>(16,13)</b>
<b>Nettovermögen</b>						<b>€ 1.157.308</b>	<b>100,00</b>

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (c) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 89.330 USD (31. Dezember 2023: 10.903 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.
- (d) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 986 USD (31. Dezember 2023: 84 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 595 EUR (31. Dezember 2023: 743 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 24.293 EUR (31. Dezember 2023: 20.472 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.343.825	€ 0	€ 1.343.825
Pensionsgeschäfte	0	838	0	838
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	3.321	(4.050)	0	(729)
<b>Summen</b>	<b>€ 3.321</b>	<b>€ 1.340.613</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 1.343.934</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 888.522	€ 2.083	€ 890.605
Investmentfonds	38.073	0	0	38.073
Pensionsgeschäfte	0	52.334	0	52.334
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	9.008	1.215	0	10.223
<b>Summen</b>	<b>€ 47.081</b>	<b>€ 942.071</b>	<b>€ 2.083</b>	<b>€ 991.235</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
COM	3,740 %	11.06.2024	24.07.2024	€ (79.383)	€ (79.548)	(6,87)
SOG	3,730	28.06.2024	24.07.2024	(10.824)	(10.827)	(0,94)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>€ (90.375)</b>	<b>(7,81)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	€ (17)	€ 0	€ (17)	€ (14)	€ 0	€ (14)
BOA	(496)	708	212	(96)	84	(12)
BPS	(37)	0	(37)	108	0	108
BRC	29	0	29	45	0	45
CBK	(269)	(270)	(539)	(426)	0	(426)
DUB	13	0	13	(9)	0	(9)
GLM	(149)	278	129	(3)	0	(3)
GST	(143)	0	(143)	(230)	0	(230)
JPM	26	0	26	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	(142)	0	(142)	300	(470)	(170)
MYI	84	0	84	(37)	0	(37)
RBC	(7)	0	(7)	(11)	0	(11)
SCX	44	0	44	(278)	0	(278)
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	(22)	0	(22)
TOR	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	6	0	6	5	0	5

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	97,25	84,69
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	14,92	11,18
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,96	0,52
Investmentfonds	k. A.	4,12
Pensionsgeschäfte	0,07	5,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,13	0,74
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,11)	0,44
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,09)	(0,07)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(7,81)	(1,13)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	3,81	1,42
US-Regierungsbehörden	12,34	7,63
US-Schatzobligationen	1,74	3,94
Non-Agency-MBS	5,67	4,56
Forderungsbesicherte Wertpapiere	14,45	8,81
Staatsemissionen	78,12	69,23
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,80
Investmentfonds	k. A.	4,12
Pensionsgeschäfte	0,07	5,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,13	0,74
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	(0,11)	0,44
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,04)	(0,08)
Devisenterminkontrakte	(0,05)	0,01
Sonstige Aktiva und Passiva	(16,13)	(7,28)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>





## PENSIONS-GESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
COM	3,650 %	28.06.2024	01.07.2024	€ 5.100	Land Niedersachsen 1,500 % fällig am 17.10.2029	€ (5.199)	€ 5.100	€ 5.102	2,46
Summe Pensionsgeschäfte						€ (5.199)	€ 5.100	€ 5.102	2,46

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	162	€ (108)	(0,05)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	560	(238)	(0,12)
				€ (346)	(0,17)

## VERKAUFSOPTIONEN

## FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - EUREX Euro-Schatz August 2024 Futures	€ 106,200	26.07.2024	83	€ (13)	€ (5)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (351)	€ (17)	

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 2.123	CHF 2.056	€ 11	€ 0	€ 11	0,01
	07.2024	£ 14.801	€ 17.378	0	(79)	(79)	(0,04)
	07.2024	\$ 9.454	8.708	0	(114)	(114)	(0,05)
BPS	07.2024	£ 150	176	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	€ 2.246	AUD 3.613	5	0	5	0,00
BRC	07.2024	264	£ 223	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	£ 145	€ 170	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	AUD 3.615	2.246	0	(5)	(5)	0,00
CBK	07.2024	€ 324	£ 274	0	(1)	(1)	0,00
	GLM	07.2024	17.136	14.462	0	(78)	(78)
GLM	08.2024	£ 14.481	€ 17.136	78	0	78	0,04
	09.2024	¥ 470.000	2.799	50	0	50	0,02
	MBC	07.2024	AUD 3.674	2.246	0	(44)	(44)
MBC	07.2024	CHF 1.919	1.942	0	(51)	(51)	(0,02)
	07.2024	¥ 1.390.000	8.565	489	0	489	0,24
	08.2024	€ 211	£ 179	0	0	0	0,00
	08.2024	¥ 330.000	€ 1.969	45	0	45	0,02
	10.2024	DKK 13.040	1.755	5	0	5	0,00
MYI	07.2024	CHF 137	143	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 143	CHF 137	0	0	0	0,00
	08.2024	¥ 360.000	€ 2.167	70	0	70	0,03
SCX	09.2024	270.000	1.607	29	0	29	0,01
	07.2024	€ 8.708	\$ 9.330	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	\$ 9.343	€ 8.708	3	0	3	0,00
UAG	09.2024	¥ 570.000	3.395	67	0	67	0,03
					€ 852	€ (378)	€ 474
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ 474	0,23
Summe Anlagen						€ 203.240	97,85
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 4.468	2,15
Nettovermögen						€ 207.708	100,00

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term Fund (Forts.)

Barmittel in Höhe von 1.440 EUR (31. Dezember 2023: 1.368 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von null EUR (31. Dezember 2023: 260 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 198.017	€ 0	€ 198.017
Pensionsgeschäfte	0	5.100	0	5.100
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(351)	474	0	123
<b>Summen</b>	<b>€ (351)</b>	<b>€ 203.591</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 203.240</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 174.163	€ 0	€ 174.163
Pensionsgeschäfte	0	12.400	0	12.400
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(524)	(299)	0	(823)
<b>Summen</b>	<b>€ (524)</b>	<b>€ 186.264</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 185.740</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (182)	€ 0	€ (182)	€ 16	€ 0	€ 16
BPS	(1)	0	(1)	(158)	0	(158)
BRC	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(1)	0	(1)	(23)	0	(23)
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
GLM	50	0	50	33	0	33
JPM	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)
MBC	444	(250)	194	53	0	53
MYI	99	0	99	k. A.	k. A.	k. A.
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	41	0	41
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	(49)	0	(49)
UAG	67	0	67	(210)	260	50

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	78,36	84,63
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	15,11	5,05
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,86	0,31
Pensionsgeschäfte	2,46	6,41
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,17)	(0,27)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	k. A.	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	0,23	(0,15)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	56,51	52,02
Non-Agency-MBS	7,97	12,82
Forderungsbesicherte Wertpapiere	18,91	13,26
Staatsemissionen	0,93	1,00
Kurzfristige Instrumente	11,01	10,89
Pensionsgeschäfte	2,46	6,41
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,17)	(0,27)
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen		
– Schutzverkauf	k. A.	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	0,23	(0,15)
Sonstige Aktiva und Passiva	2,15	4,02
Nettovermögen	100,00	100,00





## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
INEOS Finance PLC 6,375 % fällig am 15.04.2029	€ 2.500	€ 2.578	0,75	Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % fällig am 31.01.2031	€ 700	€ 618	0,18	IWG U.S. Finance LLC 6,500 % fällig am 28.06.2030	€ 1.700	€ 1.701	0,50
INEOS Quattro Finance PLC 2,500 % fällig am 15.01.2026	1.800	1.748	0,51	4,000 % fällig am 31.01.2029	£ 1.500	1.533	0,45	Kronos International, Inc. 3,750 % fällig am 15.09.2025	271	268	0,08
International Personal Finance PLC 10,750 % fällig am 14.12.2029	500	521	0,15	4,250 % fällig am 31.01.2031	\$ 200	155	0,05	Zenith Finco PLC 6,500 % fällig am 30.06.2027	1.539	1.674	0,49
John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034	£ 540	490	0,14	Zusammen		55.626	16,27	Olympus Water U.S. Holding Corp. 3,875 % fällig am 01.10.2028	2.700	2.535	0,74
6,125 % fällig am 21.01.2025	400	472	0,14	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028	1.900	1.791	0,52
Kier Group PLC 9,000 % fällig am 15.02.2029	900	1.089	0,32	INEOS Quattro Holdings U.K. Ltd. 8,146 % fällig am 02.04.2029	€ 1.500	1.500	0,44	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	\$ 1.179	1.116	0,33
Lloyds Banking Group PLC 4,947 % fällig am 27.06.2025 (d)(f)	€ 1.350	1.332	0,39	Lorca Holdco Ltd. TBD % fällig am 25.03.2031	700	701	0,20	SCIL LLC 9,500 % fällig am 15.07.2028 (h)	€ 600	649	0,19
7,500 % fällig am 27.09.2025 (d)(f)	\$ 600	561	0,16	7,389 % fällig am 17.09.2027	2.999	3.001	0,88	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	4.500	4.262	1,25
Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 3.100	2.949	0,86	Zusammen Großbritannien		60.828	17,79	UGI International LLC 2,500 % fällig am 01.12.2029	1.300	1.158	0,34
5,500 % fällig am 04.11.2027	£ 1.500	1.642	0,48	<b>USA</b>				Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	\$ 900	866	0,25
Miller Homes Group Finco PLC 7,000 % fällig am 15.05.2029	1.300	1.433	0,42	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				8,375 % fällig am 01.06.2031	900	872	0,25
Pinnacle Bidco PLC 8,250 % fällig am 11.10.2028	€ 800	850	0,25	American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % fällig am 01.11.2028	\$ 852	752	0,22	Zusammen USA		23.779	6,95
10,000 % fällig am 11.10.2028	£ 1.300	1.630	0,48	3,700 % fällig am 01.04.2028	1.664	1.484	0,43	Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 316.693	92,61	
SIG PLC 5,250 % fällig am 30.11.2026	€ 200	184	0,05	Avantor Funding, Inc. 3,875 % fällig am 15.07.2028	€ 800	781	0,23	<b>AKTIEN</b>			
Stonegate Pub Co. Financing PLC 8,250 % fällig am 31.07.2025	£ 3.700	4.295	1,26	Boxer Parent Co., Inc. 6,500 % fällig am 02.10.2025	600	601	0,17	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Thames Water Kemble Finance PLC 4,625 % fällig am 19.05.2026	300	26	0,01	Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % fällig am 01.07.2031	\$ 300	295	0,09	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
Thames Water Utilities Finance PLC 0,875 % fällig am 31.01.2028	€ 2.000	1.608	0,47	Chemours Co. 4,000 % fällig am 15.05.2026	€ 1.600	1.552	0,45	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	141.900	14.350	4,19
Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026	£ 700	786	0,23	Coty, Inc. 4,500 % fällig am 15.05.2027	600	605	0,18	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (e)	674.500	7.512	2,20
Victoria PLC 3,625 % fällig am 24.08.2026	€ 800	694	0,20	Credit Suisse AG AT1 Claim \$ 800	90	0,03	Summe Investmentfonds	€ 21.862	6,39		
Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 4.700	4.726	1,38	IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.03.2029	€ 800	727	0,21				

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	3,630 %	28.06.2024	01.07.2024	€ 13.900	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 3,375 % fällig am 30.08.2038	€ (14.159)	€ 13.900	€ 13.904	4,07
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	\$ 343	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(327)	320	320	0,09
Summe Pensionsgeschäfte						€ (14.486)	€ 14.220	€ 14.224	4,16

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2024	92	€ 106	0,03
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	1	3	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	416	191	0,06
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	34	(11)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	94	(59)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	41	18	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	41	(33)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	15	6	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 221	0,07

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
United Group BV	5,000 %	20.12.2027	€ 700	€ 211	0,06

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 41 5-Year Index	5,000 %	20.06.2029	€ 7.200	€ (106)	(0,03)

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	18.09.2054	£ 200	€ 10	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	800	2	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	18.09.2026	3.800	26	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2025	\$ 3.800	302	0,09
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	3.000	506	0,15
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	800	17	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,721	10.04.2025	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	1.300	(23)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	1.300	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	1.300	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	400	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	1.300	(20)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	1.300	(19)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	1.300	(19)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 200	8	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	1.500	(6)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	6.800	(111)	(0,03)
					€ 621	0,18
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>€ 726</b>	<b>0,21</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>**

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Deutsche Bank AG	1,000 %	20.06.2027	€ 600	€ (82)	€ 78	€ (4)	0,00

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European High Yield Bond Fund (Forts.)

### DEWISENTERMIN KONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2024	£ 39.340	€ 46.187	€ 0	€ (213)	€ (213)	(0,06)		
	07.2024	\$ 23.177	€ 21.347	0	(278)	(278)	(0,08)		
BPS	07.2024	€ 464	\$ 504	6	0	6	0,00		
	07.2024	€ 654	€ 766	0	(5)	(5)	0,00		
GLM	07.2024	€ 46.953	£ 39.627	0	(214)	(214)	(0,07)		
	08.2024	€ 39.679	€ 46.953	213	0	213	0,06		
MBC	07.2024	CHF 1.558	€ 1.577	0	(41)	(41)	(0,01)		
MYI	07.2024	€ 1.624	CHF 1.560	0	(5)	(5)	0,00		
	08.2024	CHF 1.556	€ 1.624	5	0	5	0,00		
SCX	07.2024	€ 20.883	\$ 22.374	0	(7)	(7)	0,00		
	08.2024	\$ 22.407	€ 20.883	6	0	6	0,00		
						€ 230	€ (763)	€ (533)	(0,16)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						€	(537)	(0,16)	
<b>Summe Anlagen</b>						€	353.185	103,28	
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						€	(11.202)	(3,28)	
<b>Nettovermögen</b>						€	341.983	100,00	

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,41 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Altice France S.A.	11,500 %	01.02.2027	20.12.2023	€ 974	€ 820	0,24

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 2.433 USD (31. Dezember 2023: 1.895 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.657 EUR (31. Dezember 2023: 9.183 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 490 EUR (31. Dezember 2023: 20 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 316.693	€ 0	€ 316.693
Investmentfonds	13.664	8.198	0	21.862
Pensionsgeschäfte	0	14.220	0	14.220
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	306	104	0	410
<b>Summen</b>	<b>€ 13.970</b>	<b>€ 339.215</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 353.185</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 306.261	€ 0	€ 306.261
Investmentfonds	18.291	0	0	18.291
Pensionsgeschäfte	0	30.300	0	30.300
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	932	2.759	0	3.691
<b>Summen</b>	<b>€ 19.223</b>	<b>€ 339.320</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 358.543</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
MYI	0,250 %	18.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.457)	€ (1.457)	(0,42)
	2,750	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(672)	(674)	(0,20)
	2,900	13.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(340)	(34)	(0,10)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>€ (2.471)</b>	<b>(0,72)</b>

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (491)	€ 490	€ (1)	€ (2)	€ 0	€ (2)
BPS	(3)	0	(3)	(12)	20	8
GLM	(1)	0	(1)	(54)	0	(54)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	58	0	58
MBC	(41)	0	(41)	131	(260)	(129)
SCX	(1)	0	(1)	(62)	0	(62)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	75,80	75,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	14,24	7,39
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,57	0,02
Investmentfonds	6,39	4,97
Pensionsgeschäfte	4,16	8,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,07	0,12
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,21	0,87
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,16)	0,02
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,72)	(0,51)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Österreich	0,84	0,61
Belgien	2,36	0,81
Brasilien	0,24	k. A.
Cayman-Inseln	0,26	k. A.
China	0,00	k. A.
Zypern	0,56	k. A.
Tschechische Republik	1,13	0,91
Dänemark	0,32	k. A.
Finnland	1,22	k. A.
Frankreich	10,39	11,44
Deutschland	11,68	8,27
Guernsey, Kanalinseln	0,22	k. A.
Hongkong	0,43	k. A.
Irland	1,23	0,86
Insel Man	0,43	k. A.
Israel	0,49	0,47
Italien	9,21	8,75
Japan	0,94	0,90
Jersey, Kanalinseln	1,14	1,13
Luxemburg	6,66	5,84
Multinational	k. A.	0,92
Niederlande	11,77	9,48
Norwegen	0,51	0,49
Panama	0,15	0,03
Spanien	2,45	2,99
Schweden	3,04	3,39
Schweiz	0,20	0,65
Großbritannien	17,79	11,13
USA	6,95	9,09

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kurzfristige Instrumente	k. A.	5,11
Investmentfonds	6,39	4,97
Pensionsgeschäfte	4,16	8,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,07	0,12
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,06	0,13
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,03)	0,44
Zinsswaps	0,18	0,30
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,16)	0,01
Sonstige Aktiva und Passiva	(3,28)	2,51
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>





## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
COM	3,650 %	28.06.2024	01.07.2024	€ 2.000	Land Berlin 0,010 % fällig am 02.07.2030	€ (2.060)	€ 2.000	€ 2.001	0,22
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	\$ 1.553	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.01.2026	(1.478)	1.449	1.449	0,15
Summe Pensionsgeschäfte						€ (3.538)	€ 3.449	€ 3.450	0,37

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	264	€ (41)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	165	16	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	31	(42)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	547	(562)	(0,06)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	95	(292)	(0,03)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	110	121	0,01
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	2.249	945	0,10
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	1.269	(795)	(0,08)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	712	(529)	(0,06)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	157	(14)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	88	(122)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	27	(48)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	255	(145)	(0,02)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	76	29	0,00
				€ (1.479)	(0,16)

## VERKAUFSOPTIONEN

## FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - EUREX Euro-Schatz August 2024 Futures	€ 106,200	26.07.2024	386	€ (62)	€ (25)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					€ (1.504)	(0,16)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 41 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2029	€ 2.700	€ 34	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000 %	20.06.2029	\$ 1.600	€ (2)	0,00
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	1,000	20.06.2029	€ 4.800	(17)	0,00
				€ (19)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		3,750 %	18.09.2054	£ 200	€ 11	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		4,250	18.09.2026	27.200	60	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		2,865	13.02.2054	\$ 20.800	140	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,085	13.02.2034	43.200	(254)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,250	20.12.2025	1.400	19	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,750	18.01.2026	2.700	35	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,827	15.12.2025	2.700	34	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		2,500	18.09.2054	€ 53.500	1.127	0,12

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750 %	18.09.2034	€ 109.600	€ (1.108)	(0,12)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,804	19.05.2033	2.700	(27)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026	36.400	225	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,670	24.07.2024	112.700	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,750	23.08.2024	52.200	16	0,00
					€ 278	0,03
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ 293	0,03

(1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900 %	29.08.2025	7.400	€ (88)	€ (67)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	7.400	(88)	(42)	(0,01)
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	10.900	(352)	(121)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	5.500	(342)	(109)	(0,01)
							€ (870)	€ (339)	(0,04)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	€ 1.397	NZD 2.445	€ 0	€ (7)	€ (7)	0,00
	10.2024	\$ 180	CNH 1.288	0	(2)	(2)	0,00
BOA	07.2024	€ 17.637	£ 14.947	22	(30)	(8)	0,00
	07.2024	£ 83.969	€ 98.597	3	(445)	(442)	(0,05)
	07.2024	KRW 2.157.615	\$ 1.577	9	0	9	0,00
	07.2024	SGD 1.239	918	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 20	PLN 80	0	0	0	0,00
	07.2024	21	SGD 28	0	0	0	0,00
	08.2024	SGD 28	\$ 21	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	£ 3.939	€ 4.616	0	(30)	(30)	0,00
	07.2024	¥ 272.702	1.611	30	0	30	0,00
	07.2024	KRW 2.141.449	\$ 1.560	5	0	5	0,00
	07.2024	NZD 938	€ 531	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	\$ 2.788	2.575	0	(26)	(26)	0,00
	07.2024	1.367	IDR 22.381.195	1	0	1	0,00
	07.2024	101	ILS 373	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	64	PLN 257	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	1.511	SGD 2.049	1	0	1	0,00
	08.2024	SGD 2.046	\$ 1.511	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	CNH 2.022	282	3	0	3	0,00
	09.2024	TWD 78.681	2.445	14	0	14	0,00
	10.2024	CNH 1.260	AUD 176	2	0	2	0,00
BRC	07.2024	€ 2.533	AUD 4.074	6	0	6	0,00
	07.2024	7.565	CAD 11.145	46	(11)	35	0,00
	07.2024	10.398	£ 8.833	28	(8)	20	0,00
	07.2024	2.686	\$ 2.882	3	0	3	0,00
	07.2024	MXN 5.501	298	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	PLN 28	7	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 744	551	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 451	PLN 1.802	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	AUD 4.077	€ 2.533	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	CAD 5.473	3.740	11	0	11	0,00
	09.2024	CNH 1.507	\$ 210	2	0	2	0,00
	09.2024	MXN 8.785	465	0	(9)	(9)	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	09.2024	\$ 3.112	MXN 58.306	€ 36	€ 0	€ 36	0,00
	10.2024	556	CNH 3.996	0	(4)	(4)	0,00
CBK	07.2024	€ 9.362	£ 7.920	0	(21)	(21)	0,00
	07.2024	KRW 20.612	\$ 15	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 531	€ 47	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 185	PLN 735	0	(2)	(2)	0,00
	09.2024	TWD 29.999	\$ 931	4	0	4	0,00
	09.2024	\$ 3.043	INR 254.592	4	(1)	3	0,00
DUB	07.2024	€ 8.094	DKK 60.369	1	0	1	0,00
	07.2024	33.257	¥ 5.617.400	0	(673)	(673)	(0,07)
	07.2024	KRW 1.170.421	\$ 851	1	0	1	0,00
	08.2024	DKK 60.350	€ 8.094	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 143	BRL 735	0	(10)	(10)	0,00
FAR	07.2024	115.875	€ 106.390	0	(1.728)	(1.728)	(0,18)
GLM	07.2024	€ 64.455	£ 54.398	0	(294)	(294)	(0,03)
	07.2024	¥ 5.128.176	€ 30.185	439	0	439	0,05
	07.2024	MXN 5.474	\$ 295	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	\$ 2.440	PLN 9.639	0	(40)	(40)	0,00
	07.2024	1.626	ZAR 29.750	1	0	1	0,00
	08.2024	£ 54.469	€ 64.455	292	0	292	0,03
	08.2024	\$ 242	BRL 1.239	0	(18)	(18)	0,00
IND	10.2024	CNH 57.940	\$ 8.119	106	0	106	0,01
JPM	07.2024	CHF 1.638	€ 1.669	0	(31)	(31)	0,00
	07.2024	CNY 137	\$ 19	0	0	0	0,00
	07.2024	DKK 107.835	€ 14.462	2	0	2	0,00
	07.2024	€ 1.361	£ 1.159	6	0	6	0,00
	07.2024	KRW 1.444.459	\$ 1.047	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	SGD 95	€ 70	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 21	IDR 341.012	0	0	0	0,00
	07.2024	200	ILS 738	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	3.061	ZAR 56.352	20	0	20	0,00
	08.2024	19	CNY 137	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 51.038	\$ 1.585	8	0	8	0,00
	09.2024	\$ 332	INR 27.859	1	0	1	0,00
MBC	10.2024	CNH 2.062	\$ 288	3	0	3	0,00
	07.2024	AUD 3.882	€ 2.372	0	(46)	(46)	0,00
	07.2024	CHF 87	€ 88	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	DKK 46.125	€ 6.186	1	0	1	0,00
	07.2024	€ 24.755	\$ 26.864	310	0	310	0,03
	07.2024	IDR 3.232.184	€ 196	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	¥ 206.800	€ 1.222	23	0	23	0,00
	10.2024	\$ 2.256	CNH 16.203	0	(16)	(16)	0,00
MYI	07.2024	AUD 262	€ 160	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	€ 3.038	CHF 2.917	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	47	NOK 532	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 1	€ 0	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2.975	€ 2.780	4	0	4	0,00
	08.2024	CHF 2.911	€ 3.038	9	0	9	0,00
	08.2024	NOK 533	€ 47	0	0	0	0,00
	09.2024	¥ 5.560.000	€ 33.085	600	0	600	0,06
	09.2024	TWD 20.303	\$ 633	5	0	5	0,00
	09.2024	\$ 222	INR 18.595	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	CHF 1.189	€ 1.204	0	(30)	(30)	0,00
	07.2024	DKK 311.767	€ 41.820	14	0	14	0,00
SCX	07.2024	CAD 14.956	€ 10.082	0	(117)	(117)	(0,01)
	07.2024	€ 2.517	CAD 3.735	30	0	30	0,00
	07.2024	84.304	\$ 90.323	0	(28)	(28)	0,00
	07.2024	IDR 164.120	€ 10	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 40.931	€ 238	1	0	1	0,00
	07.2024	KRW 1.086.673	\$ 797	7	0	7	0,00
	07.2024	MXN 63	€ 3	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 19	CNY 137	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 238	¥ 40.799	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 90.456	€ 84.304	26	0	26	0,00
	09.2024	CNH 1.411	\$ 197	2	0	2	0,00
	09.2024	TWD 29.512	€ 915	4	0	4	0,00
	09.2024	\$ 1.636	INR 136.966	2	0	2	0,00
UAG	07.2024	49	ILS 183	0	(1)	(1)	0,00
				€ 2.153	€ (3.671)	€ (1.518)	(0,16)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ (1.857)	(0,20)
Summe Anlagen						€ 1.058.480	112,35
Sonstige Aktiva und Passiva						€ (116.373)	(12,35)
Nettovermogen						€ 942.107	100,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Nullkuponwertpapier.  
 (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
 (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
 (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (e) Mit dem Fonds verbunden.  
 (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (g) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 676 USD (31. Dezember 2023: null USD) und Barmittel in Höhe von 2.453 USD (31. Dezember 2023: 39 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 11.677 EUR (31. Dezember 2023: 1.867 EUR) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 979.959	€ 0	€ 979.959
Investmentfonds	77.700	440	0	78.140
Pensionsgeschäfte	0	3.449	0	3.449
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	149	(3.217)	0	(3.068)
<b>Summen</b>	<b>€ 77.849</b>	<b>€ 980.631</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 1.058.480</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 132.036	€ 0	€ 132.036
Investmentfonds	7.680	0	0	7.680
Pensionsgeschäfte	0	1.000	0	1.000
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(105)	(2.648)	0	(2.753)
<b>Summen</b>	<b>€ 7.575</b>	<b>€ 130.388</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 137.963</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	€ (9)	€ 0	€ (9)	€ k. A.	€ k. A.	€ k. A.
BOA	(438)	615	177	(23)	0	(23)
BPS	(6)	0	(6)	(32)	0	(32)
BRC	91	0	91	17	0	17
CBK	(16)	0	(16)	1	0	1
DUB	(682)	606	(76)	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(1.728)	1.847	119	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	267	0	267	(174)	0	(174)
IND	106	0	106	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	4	0	4	5	0	5
MBC	269	(350)	(81)	66	0	66
MYC	(230)	(252)	(482)	(269)	(244)	(513)
MYI	606	(336)	270	(8)	9	1
RBC	(16)	0	(16)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	(74)	61	(13)	(90)	30	(60)
UAG	(1)	0	(1)	1	0	1

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,45	89,78
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	15,92	10,88
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,65	0,43
Investmentfonds	8,29	5,88
Pensionsgeschäfte	0,37	0,77
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,16)	(0,50)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,03	(1,22)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,20)	(0,39)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	24,30	29,12
US-Regierungsbehörden	13,98	10,83
US-Schatzobligationen	6,80	8,43
Non-Agency-MBS	8,40	16,56
Forderungsbesicherte Wertpapiere	19,56	22,67
Staatsemissionen	20,31	12,85
Vorzugswertpapiere	0,36	0,40
Kurzfristige Instrumente	10,31	0,23
Investmentfonds	8,29	5,88
Pensionsgeschäfte	0,37	0,77
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,16)	(0,49)
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	(0,10)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,03
Zinsswaps	0,03	(1,15)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,04)	(0,37)
Devisenterminkontrakte	(0,16)	(0,02)
Sonstige Aktiva und Passiva	(12,35)	(5,63)
Nettovermögen	100,00	100,00









## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>US-SCHATZ OblIGATIONEN</b>				<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
Fannie Mae				6,000 % fällig am 01.08.2054	\$ 27.500	\$ 27.568	6,55	0,136 % fällig am 20.06.2025 (d)(e)	¥ 134.000	\$ 832	0,20
3,000 % fällig am 01.03.2060	\$ 374	\$ 317	0,08	6,500 % fällig am 01.08.2054	62.100	63.172	14,99	0,140 % fällig am 20.06.2025 (d)(e)	16.000	99	0,02
3,500 % fällig am 01.01.2059	1.157	1.017	0,24	<b>US-TREASURY BONDS</b>				0,155 % fällig am 21.04.2025 (d)(e)	168.000	1.043	0,25
5,850 % fällig am 25.06.2036	13	13	0,00	1,625 % fällig am 15.11.2050	1.300	712	0,17	0,165 % fällig am 21.04.2025 (d)(e)	192.000	1.193	0,28
6,124 % fällig am 25.01.2051	582	582	0,14	1,875 % fällig am 15.02.2041	9.000	6.162	1,46	0,188 % fällig am 20.05.2025 (d)(e)	70.000	435	0,10
<b>Freddie Mac</b>				2,875 % fällig am 15.05.2052	300	220	0,05	0,203 % fällig am 20.05.2025 (d)(e)	200.000	1.242	0,30
0,553 % fällig am 15.01.2038 (a)	202	12	0,00	4,000 % fällig am 15.11.2052	400	364	0,09				
5,793 % fällig am 15.01.2038	202	201	0,05	4,250 % fällig am 15.02.2054	1.200	1.143	0,27				
<b>Ginnie Mae</b>				4,750 % fällig am 15.11.2043	3.100	3.142	0,75				
3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2052	8.207	7.154	1,70	4,750 % fällig am 15.11.2053	1.800	1.861	0,44				
5,777 % fällig am 20.12.2062	199	198	0,05	<b>US-TREASURY INFLATION PROTECTED SECURITIES (f)</b>							
<b>Ginnie Mae, TBA</b>				0,125 % fällig am 15.04.2025	3.216	3.129	0,74				
2,500 % fällig am 01.07.2054 - 01.08.2054	4.100	3.449	0,82	0,125 % fällig am 15.07.2030	2.079	1.861	0,44				
3,000 % fällig am 01.08.2054	5.000	4.359	1,04	0,125 % fällig am 15.07.2031	1.287	1.130	0,27				
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>				0,125 % fällig am 15.01.2032	4.071	3.527	0,84				
2,500 % fällig am 01.02.2051 - 01.01.2052	1.861	1.523	0,36	0,250 % fällig am 15.01.2025	6.883	6.741	1,60				
3,000 % fällig am 01.10.2042 - 01.10.2049	1.443	1.241	0,30	0,250 % fällig am 15.02.2050	1.219	745	0,18				
3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.07.2050	797	726	0,17	0,500 % fällig am 15.01.2028	10.422	9.823	2,33				
4,000 % fällig am 01.09.2040 - 01.06.2050	408	379	0,09	0,625 % fällig am 15.07.2032	1.726	1.549	0,37				
4,500 % fällig am 01.04.2041	56	55	0,01	0,750 % fällig am 15.07.2028	2.123	2.018	0,48				
5,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.04.2039	136	137	0,03	1,125 % fällig am 15.01.2033	3.999	3.702	0,88				
<b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b>				<b>US-TREASURY NOTES</b>							
2,500 % fällig am 01.08.2054	2.000	1.635	0,39	2,875 % fällig am 30.04.2025	9.300	9.126	2,17				
3,500 % fällig am 01.07.2054	400	354	0,08	3,500 % fällig am 15.02.2033	1.300	1.219	0,29				
4,000 % fällig am 01.08.2054	3.600	3.296	0,78	4,000 % fällig am 29.02.2028	300	295	0,07				
4,500 % fällig am 01.07.2054 - 01.08.2054	26.100	24.610	5,84	4,000 % fällig am 15.02.2034	2.600	2.524	0,60				
5,000 % fällig am 01.07.2054 - 01.08.2054	35.600	34.406	8,17	4,500 % fällig am 15.11.2033	3.900	3.937	0,93				
				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
				<b>HUNGARY TREASURY BILLS</b>							
				7,096 % fällig am 04.07.2024 (d)(e)	HUF 361.000	979	0,23				

Summe kurzfristige Instrumente 5.823 1,38

Summe Übertragbare Wertpapiere \$ 559.493 132,85

### AKTIEN

### INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN

<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)</b>	70.074	698	0,16
----------------------------------------------------------------------------------	--------	-----	------

<b>PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)</b>	446.527	6.150	1,46
-------------------------------------------------------------------------	---------	-------	------

Summe Investmentfonds \$ 6.848 1,62

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Zu erhaltende Erlöse aus			
						Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 617	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (629)	\$ 617	\$ 617	0,15
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (629)	\$ 617	\$ 617	0,15

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	308	\$ 335	0,08
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2024	67	(76)	(0,02)
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2025	154	(136)	(0,03)
Australia Government 3-Year Note September Futures	Long	09.2024	6	(1)	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	53	0	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	6	4	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	58	(72)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	95	138	0,03
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	5	(16)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	59	85	0,02
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	14	(7)	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	58	164	0,04
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	10	(6)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	458	(336)	(0,08)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	3	(2)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	90	(78)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	103	(31)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	11	0	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	174	(103)	(0,02)
				\$ (138)	(0,03)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (138)	(0,03)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.06.2025	\$ 400	\$ 3	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 10-Year Index	(1,000) %	20.06.2033	\$ 4.600	\$ (71)	(0,02)
CDX.IG-41 10-Year Index	(1,000)	20.12.2033	12.000	(199)	(0,05)
CDX.IG-42 10-Year Index	(1,000)	20.06.2034	17.700	27	0,01
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	(1,000)	20.06.2029	€ 12.700	36	0,01
				\$ (207)	(0,05)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 500	\$ 3	0,00
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	14.700	(17)	0,00
				\$ (14)	0,00

#### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000 %	17.06.2027	£ 11.700	\$ (226)	(0,05)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000	17.06.2035	2.500	151	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	29.950	(493)	(0,12)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	1.300	(76)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	14.100	(222)	(0,05)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	18.09.2029	INR 1.110.320	(24)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	¥ 230.000	(56)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	280.000	257	0,06
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,600	18.09.2029	3.696.900	(41)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,789	23.01.2033	980.300	56	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850	20.09.2033	130.000	5	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	18.09.2034	2.460.000	(57)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	18.09.2029	SGD 30.170	156	0,04
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,250	18.09.2029	THB 404.000	137	0,03
Erhalt	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,418	17.04.2029	93.500	1	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	18.09.2029	386.910	(44)	(0,01)
Erhalt	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,750	18.09.2034	40.800	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	\$ 4.960	363	0,09
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	9.280	(366)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,249	31.08.2024	9.500	281	0,07
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,298	25.08.2024	8.100	251	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2024	200	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,310	16.01.2025	16.900	(462)	(0,11)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,697	04.04.2025	2.000	(35)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,721	10.04.2025	600	(10)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,790	10.04.2025	1.700	(28)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	400	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	900	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	1.200	(23)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	16.400	797	0,19
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	600	(11)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	400	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	500	(9)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	300	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	600	(10)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,150	13.05.2025	32.800	562	0,13
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	600	(9)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,200	13.05.2025	2.700	53	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	500	(8)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	5.710	(168)	(0,04)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2025	18.300	105	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	13.451	(308)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	100	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	1.000	(14)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	1.300	(19)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,655	31.05.2028	800	16	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,662 %	31.05.2028	\$ 2.300	\$ 46	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,691	31.05.2028	5.600	105	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	20.02.2049	2.700	76	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	1.600	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	900	(12)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	9.600	84	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	19.400	(467)	(0,11)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	27.980	(42)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	100	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,807	31.05.2028	400	6	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,857	31.03.2030	4.000	(55)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,970	27.02.2029	2.900	(24)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.06.2026	7.200	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.03.2054	1.600	122	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,159	31.03.2025	14.500	191	0,04
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,228	30.08.2025	5.300	35	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	54.396	693	0,16
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,291	04.01.2027	BRL 1.600	38	0,01
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,500	17.06.2030	CAD 1.600	15	0,00
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,750	16.12.2046	1.400	(8)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,900	18.12.2029	3.700	29	0,01
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	15.03.2033	1.900	(6)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033	780	6	0,00
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053	2.400	(8)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	18.12.2025	23.900	(30)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	19.03.2026	13.400	(25)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	19.06.2026	29.100	21	0,01
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.09.2033	2.500	(35)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,898	19.06.2026	11.600	25	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,925	19.06.2026	8.700	20	0,00
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 1.700	(38)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	4.400	(89)	(0,02)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,300	15.02.2027	1.700	(37)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	1.300	(24)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	900	(40)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	18.09.2029	CNY 91.480	104	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	18.09.2029	KRW 8.966.520	(8)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,750	19.06.2029	NZD 4.400	(1)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	5,250	20.03.2025	11.500	80	0,02
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	SEK 16.100	(155)	(0,04)
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 5.700	469	0,11
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	1.900	(90)	(0,02)
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.06.2031	1.750	181	0,04
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033	14.600	(82)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	1.100	(4)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	12.400	(266)	(0,06)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,335	25.09.2024	27.800	2	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	22.500	55	0,01
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	19.06.2034	6.500	(17)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	18.500	262	0,06
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 200	56	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	500	170	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035	300	75	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	500	(6)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	1.400	(98)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	900	(60)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	700	(49)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	1.600	(96)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	700	(42)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	1.400	(6)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	13.380	683	0,16
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	24.940	(241)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	05.03.2034	1.100	(8)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	48.600	(1.111)	(0,26)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,801	25.05.2033	1.600	(3)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,833	15.08.2033	2.200	(9)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,841	25.05.2033	7.200	(35)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,849	15.08.2033	3.200	(17)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,857	15.08.2033	8.300	(49)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026	1.000	(8)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	17.660	(62)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033	7.860	(23)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,536	18.09.2025	26.000	(251)	(0,06)
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,635	18.03.2025	NOK 6.200	29	0,01
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,993	12.11.2024	4.200	16	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN 41.500	(36)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	26.02.2025	10.500	(19)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,380	25.02.2025	12.300	(27)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,415	25.02.2025	300	(1)	0,00
					\$ 298	0,07
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 80	0,02

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**OPTIONSKAUF**
**DEVIENOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,400	06.12.2024	80	\$ 7	\$ 12	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	14.01.2025	120	11	20	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	14.01.2025	80	6	10	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	23.01.2025	50	5	6	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	100	11	15	0,01
BRC	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.01.2025	50	5	9	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,450	14.02.2025	50	5	6	0,00
MBC	Call - OTC USD versus CNH	7,350	06.12.2024	100	10	18	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,375	14.02.2025	110	11	15	0,00
SCX	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	60	6	9	0,00
					\$ 77	\$ 120	0,03

**ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750 %	15.07.2024	8.600	\$ 17	\$ 21	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,930	23.06.2025	1.600	58	71	0,02
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,005	25.09.2025	400	15	18	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750	10.07.2024	37.800	103	96	0,02
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,960	25.06.2025	2.100	72	89	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,005	25.09.2025	500	21	23	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,065	24.06.2025	1.500	45	55	0,01
							\$ 331	\$ 373	0,09

**OPTIONEN AUF WERTPAPIERE**

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	\$ 40,000	08.07.2024	32.000	\$ 1	\$ 0	0,00
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	800	61	385	0,09
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2054	\$ 75,000	06.08.2024	24.100	1	0	0,00
MSC	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,500 % fällig am 01.07.2054	92,000	08.07.2024	50.000	4	0	0,00
					\$ 67	\$ 385	0,09

**VERKAUFSOPTIONEN**
**ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250 %	15.07.2024	8.600	\$ (9)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	23.06.2025	6.200	(59)	(68)	(0,02)
BPS	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	800	(61)	(319)	(0,08)
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	25.09.2025	1.500	(14)	(17)	(0,01)
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	1.600	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	1.600	(6)	(8)	0,00
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250	10.07.2024	37.800	(57)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,280	25.06.2025	1.500	(15)	(16)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,300	25.06.2025	6.500	(57)	(68)	(0,02)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,330	25.09.2025	1.900	(21)	(23)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,400	24.06.2025	5.800	(45)	(53)	(0,01)
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	1.900	(7)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	1.900	(7)	(12)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	4.600	(33)	(1)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	800	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	800	(3)	(2)	0,00
			Zahlung	4,040	29.07.2024	800	(3)	(5)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
ULO	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090 %	29.07.2024	800	\$ (2)	\$ (3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	1.400	(4)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	1.400	(4)	(7)	0,00
							\$ (415)	\$ (615)	(0,15)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.06.2029	\$ 850	\$ (25)	\$ 0	\$ (25)	(0,01)
MYC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	850	(25)	1	(24)	(0,01)
					\$ (50)	\$ 1	\$ (49)	(0,02)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - Schutzverkauf<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 500	\$ (12)	\$ 16	\$ 4	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	(10)	13	3	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	500	(12)	16	4	0,00
MYC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2029	5.600	50	5	55	0,02
					\$ 16	\$ 50	\$ 66	0,02

(1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nenn-betrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 700	\$ 527	\$ 3	\$ (65)	\$ (62)	(0,01)
BPS	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,591 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026	\$ 3.006	¥ 444.300	(33)	280	247	0,06
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,605 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	19.03.2026	3.532	518.700	(14)	324	310	0,07
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,605 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	19.03.2026	13.499	1.976.900	118	1.103	1.221	0,29
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,605 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	19.03.2026	3.535	518.000	(7)	324	317	0,08
BRC	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,590 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026	2.574	360.400	137	200	337	0,08
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,600 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	21.01.2026	6.716	935.500	349	558	907	0,22

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,586 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026	\$ 2.977	¥ 439.100	\$ (27)	\$ 277	\$ 250	0,06
	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	AUD 5.900	\$ 4.071	(1)	(114)	(115)	(0,03)
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	5.600	3.864	(11)	(98)	(109)	(0,03)
GST	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,610 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	21.01.2026	\$ 5.650	¥ 787.000	348	415	763	0,18
						\$ 862	\$ 3.204	\$ 4.066	0,97

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750 %	18.09.2029	MYR 2.400	\$ (2)	\$ 0	\$ (2)	0,00
CBK	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	950	1	0	1	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2029	4.300	6	(1)	5	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	20.09.2033	13.530	86	(67)	19	0,01
JPM	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	11.02.2029	COP 15.800	0	0	0	0,00
	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	MYR 1.000	1	0	1	0,00
	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2034	1.940	4	0	4	0,00
SCX	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2034	370	1	0	1	0,00
						\$ 97	\$ (68)	\$ 29	0,01

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DEVISETERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD 752	\$ 460	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	08.2024	\$ 460	NZD 752	0	(2)	(2)	0,00
	10.2024	2.549	CNH 18.244	0	(29)	(29)	(0,01)
BOA	07.2024	KRW 3.055.257	\$ 2.234	15	0	15	0,00
	07.2024	\$ 1.064	HKD 8.304	0	0	0	0,00
	07.2024	99	MYR 464	0	0	0	0,00
	07.2024	233	PLN 928	0	(2)	(2)	0,00
BPS	02.2025	CNH 1.143	\$ 160	1	0	1	0,00
	07.2024	AUD 4.684	3.119	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	BRL 1.729	344	32	0	32	0,01
	07.2024	CNY 3.031	426	9	0	9	0,00
	07.2024	€ 1.941	2.089	8	0	8	0,00
	07.2024	£ 5.550	7.085	69	0	69	0,02
	07.2024	KRW 3.032.855	2.210	7	0	7	0,00
	07.2024	\$ 426	CNH 3.088	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	3.235	CNY 23.014	0	(14)	(14)	0,00
	07.2024	982	€ 913	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	150	IDR 2.457.959	0	0	0	0,00
	07.2024	175	KRW 242.420	1	0	1	0,00
	07.2024	435	NZD 708	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	4.804	PLN 19.428	34	(6)	28	0,01
	07.2024	250	SEK 2.635	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	3.009	SGD 4.081	2	0	2	0,00
	08.2024	SGD 4.075	\$ 3.009	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	\$ 2.873	AUD 4.308	7	0	7	0,00
	09.2024	CNH 4.272	\$ 595	7	0	7	0,00
	09.2024	INR 71.426	854	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 16.834	523	3	0	3	0,00
	09.2024	\$ 13.639	CNH 97.593	0	(194)	(194)	(0,05)
	09.2024	351	INR 29.403	1	0	1	0,00
	09.2024	169	TWD 5.450	0	(1)	(1)	0,00
	10.2024	12.512	CNH 89.604	0	(135)	(135)	(0,03)
	12.2024	340	2.438	0	(2)	(2)	0,00
	01.2025	CNH 1.286	\$ 180	1	0	1	0,00
BRC	07.2024	3.374	466	4	0	4	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	DKK 150	\$ 22	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	MXN 3.607	195	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	SGD 707	523	2	0	2	0,00
	07.2024	TRY 7.162	211	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	\$ 1.252	CHF 1.116	0	(10)	(10)	0,00
	07.2024	1.981	NOK 20.842	0	(24)	(24)	(0,01)
	07.2024	301	PLN 1.201	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	812	RON 3.742	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	1	THB 37	0	0	0	0,00
	09.2024	MXN 2.085	\$ 112	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	\$ 466	CNH 3.357	0	(4)	(4)	0,00
	09.2024	4.684	MXN 88.041	73	0	73	0,02
	10.2024	CNH 2.464	\$ 341	1	0	1	0,00
	10.2024	\$ 981	CNH 7.050	0	(7)	(7)	0,00
	10.2024	2.985	¥ 449.997	0	(149)	(149)	(0,04)
	02.2025	160	CNH 1.142	0	(1)	(1)	0,00
	04.2025	¥ 147.000	\$ 1.004	51	0	51	0,01
	05.2025	270.000	1.846	90	0	90	0,02
CBK	07.2024	CHF 368	405	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	CNY 8.112	1.139	16	0	16	0,00
	07.2024	SEK 13.477	1.269	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	\$ 1.510	BRL 8.228	0	(29)	(29)	(0,01)
	07.2024	467	CNH 3.384	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	1.171	CNY 8.337	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	595	DKK 4.135	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	1.052	£ 823	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	287	KRW 391.594	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	502	PLN 1.991	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	2.556	THB 93.570	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	BRL 8.256	\$ 1.510	29	0	29	0,01
	09.2024	INR 4.369	52	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 5.206	161	1	0	1	0,00
	09.2024	\$ 296	CLP 269.928	0	(10)	(10)	0,00
	09.2024	8.450	INR 706.435	6	(3)	3	0,00
	09.2024	657	MXN 12.381	12	0	12	0,00
	09.2024	480	PHP 28.199	2	0	2	0,00
	10.2024	CNH 3.682	\$ 513	4	0	4	0,00
	10.2024	\$ 490	¥ 70.000	0	(48)	(48)	(0,01)
	10.2024	1.024	VND 25.691.912	0	(15)	(15)	0,00
	01.2025	180	CNH 1.285	0	(1)	(1)	0,00
	01.2026	¥ 70.000	\$ 516	48	0	48	0,01
DUB	07.2024	KRW 1.516.897	1.103	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 508	CLP 469.599	0	(10)	(10)	0,00
	07.2024	6	MYR 26	0	0	0	0,00
	07.2024	499	PLN 1.962	0	(11)	(11)	0,00
	08.2024	BRL 990	\$ 192	15	0	15	0,00
	10.2024	\$ 1.195	¥ 180.003	0	(61)	(61)	(0,02)
	04.2025	¥ 213.000	\$ 1.455	74	0	74	0,02
FAR	07.2024	€ 47.260	51.473	822	0	822	0,19
	07.2024	NZD 1.445	881	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 3.121	AUD 4.684	7	0	7	0,00
	07.2024	348	CNY 2.479	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	10.114	¥ 1.579.383	0	(295)	(295)	(0,07)
	07.2024	1.139	NZD 1.849	0	(12)	(12)	0,00
	08.2024	881	1.445	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2024	CNY 207	\$ 29	1	0	1	0,00
	07.2024	MXN 3.193	172	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	\$ 33	CNY 236	0	0	0	0,00
	07.2024	214	MXN 3.860	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	2	MYR 8	0	0	0	0,00
	07.2024	301	PLN 1.190	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	1.202	TRY 41.071	32	0	32	0,01
	07.2024	1.400	ZAR 25.614	1	0	1	0,00
	08.2024	7.765	BRL 41.075	0	(398)	(398)	(0,09)
	09.2024	1.022	TRY 40.854	137	0	137	0,03
	10.2024	2.379	¥ 350.000	0	(173)	(173)	(0,04)
	06.2025	¥ 150.000	\$ 1.000	21	0	21	0,00
	01.2026	200.000	1.486	151	0	151	0,04
IND	07.2024	CNY 9.987	1.402	27	0	27	0,01
	07.2024	\$ 1.402	CNY 9.992	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07.2024	BRL 496	\$ 99	9	0	9	0,00
	07.2024	CHF 1.219	1.357	1	(1)	0	0,00
	07.2024	CNY 5.169	725	8	0	8	0,00
	07.2024	DKK 6.239	895	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	€ 3.133	3.352	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	KRW 1.872.058	1.357	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	SGD 3.375	2.505	15	0	15	0,00
	07.2024	\$ 911	CHF 805	0	(15)	(15)	0,00
	07.2024	647	€ 593	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	3.375	IDR 54.741.012	0	(30)	(30)	(0,01)
	07.2024	100	ILS 369	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	198	PLN 775	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	2.636	ZAR 48.518	18	0	18	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	\$ 1.152	CHF 1.030	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	08.2024	725	CNY 5.172	0	0	0	0,00
	08.2024	895	DKK 6.228	1	0	1	0,00
	09.2024	TWD 4.922	\$ 153	1	0	1	0,00
	09.2024	\$ 1.199	INR 100.465	3	0	3	0,00
	10.2024	¥ 110.000	\$ 890	196	0	196	0,05
	10.2024	\$ 5.428	CNH 38.856	0	(61)	(61)	(0,02)
	12.2024	CNH 2.439	\$ 340	2	0	2	0,00
MBC	07.2024	CAD 585	428	0	0	0	0,00
	07.2024	CNH 3.081	426	4	0	4	0,00
	07.2024	€ 2.690	2.920	37	0	37	0,01
	07.2024	IDR 19.045.779	1.155	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	¥ 1.579.481	9.838	19	0	19	0,00
	07.2024	NOK 16.213	1.522	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 2.010	CHF 1.791	0	(17)	(17)	0,00
	07.2024	735	CZK 16.948	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	975	DKK 6.780	1	(1)	0	0,00
	07.2024	3.590	€ 3.333	0	(18)	(18)	0,00
	07.2024	1.958	£ 1.537	0	(15)	(15)	0,00
	07.2024	2.054	SEK 21.375	0	(36)	(36)	(0,01)
	08.2024	428	CAD 585	0	0	0	0,00
	08.2024	9.838	¥ 1.572.088	0	(19)	(19)	(0,01)
	08.2024	1.522	NOK 16.200	1	0	1	0,00
	09.2024	3.342	CNH 24.064	0	(27)	(27)	(0,01)
	09.2024	200	TWD 6.431	0	(1)	(1)	0,00
	10.2024	¥ 340.000	\$ 2.725	582	0	582	0,14
	12.2024	CNH 2.741	384	4	0	4	0,00
	12.2024	\$ 384	CNH 2.740	0	(4)	(4)	0,00
MYI	07.2024	BRL 6.000	\$ 1.162	81	0	81	0,02
	07.2024	DKK 4.282	613	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	€ 3.155	3.383	2	0	2	0,00
	07.2024	HUF 149.509	403	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	NOK 4.630	434	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	SEK 10.546	998	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 428	CAD 585	0	0	0	0,00
	07.2024	1.033	CNY 7.355	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	450	NZD 734	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	613	DKK 4.274	2	0	2	0,00
	08.2024	434	NOK 4.626	1	0	1	0,00
	08.2024	998	SEK 10.530	0	(3)	(3)	0,00
	09.2024	TWD 1.958	\$ 61	1	0	1	0,00
	09.2024	\$ 764	INR 63.862	0	0	0	0,00
	10.2024	¥ 600.000	\$ 4.906	1.126	0	1.126	0,27
RBC	07.2024	\$ 4.045	£ 3.190	0	(13)	(13)	0,00
	08.2024	£ 3.190	\$ 4.046	13	0	13	0,00
SCX	07.2024	CNY 514	72	1	0	1	0,00
	07.2024	€ 1.188	1.276	3	0	3	0,00
	07.2024	KRW 1.669.601	1.224	12	0	12	0,00
	07.2024	MXN 76	4	0	0	0	0,00
	07.2024	PEN 5.222	1.393	30	0	30	0,01
	07.2024	\$ 2.520	CNY 17.937	0	(47)	(47)	(0,01)
	07.2024	€ 58.945	€ 55.017	19	0	19	0,00
	08.2024	€ 55.017	\$ 59.032	0	(19)	(19)	(0,01)
	09.2024	CNH 3.661	510	6	0	6	0,00
	09.2024	TWD 2.846	88	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 5.541	INR 463.794	8	0	8	0,00
	09.2024	373	KZT 171.575	0	(15)	(15)	0,00
	09.2024	480	PHP 28.168	1	0	1	0,00
	09.2024	221	TWD 7.118	0	(2)	(2)	0,00
SSB	07.2024	€ 499	\$ 541	6	0	6	0,00
	09.2024	COP 1.185.476	296	13	0	13	0,00
TOR	07.2024	CHF 9	10	0	0	0	0,00
	07.2024	NZD 1.095	671	3	0	3	0,00
	08.2024	\$ 671	NZD 1.095	0	(3)	(3)	0,00
UAG	07.2024	CHF 2.114	\$ 2.340	0	(13)	(13)	0,00
	07.2024	DKK 232	34	0	0	0	0,00
	07.2024	ILS 297	80	1	0	1	0,00
	08.2024	€ 317	339	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 4.062	\$ (2.171)	\$ 1.891	0,45

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	\$ 91	NZD 149	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	NZD 149	\$ 91	0	0	0	0,00
BOA	07.2024	\$ 1.191	CHF 1.072	1	0	1	0,00
BPS	07.2024	CAD 1	\$ 1	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	07.2024	£ 3.394	\$ 4.336	\$ 45	\$ 0	\$ 45	0,01
	07.2024	¥ 428	3	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2.320	AUD 3.481	5	0	5	0,00
BRC	08.2024	AUD 3.481	\$ 2.322	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	CHF 263	296	3	0	3	0,00
	07.2024	DKK 1.383	201	3	0	3	0,00
	07.2024	NOK 7.927	753	9	0	9	0,00
CBK	07.2024	SEK 8.919	840	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	\$ 3.538	CHF 3.220	45	0	45	0,01
FAR	07.2024	AUD 3.481	\$ 2.320	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	€ 22.112	24.083	386	0	386	0,09
	07.2024	¥ 1.113.687	7.132	208	0	208	0,05
	07.2024	NZD 652	402	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 6.986	¥ 1.113.166	0	(67)	(67)	(0,02)
	07.2024	175	NZD 286	0	0	0	0,00
	08.2024	¥ 1.107.944	\$ 6.986	66	0	66	0,02
	08.2024	NZD 286	175	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	CHF 55	61	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	37.923	42.253	55	(4)	51	0,01
	07.2024	\$ 246	CHF 217	0	(4)	(4)	0,00
MBC	08.2024	41.623	37.215	0	(54)	(54)	(0,01)
	07.2024	CAD 3.790	\$ 2.784	14	0	14	0,00
	07.2024	CHF 108	121	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 2.771	CAD 3.793	2	0	2	0,00
	07.2024	562	CHF 500	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	580	NOK 6.174	0	0	0	0,00
	07.2024	2	SEK 23	0	0	0	0,00
	08.2024	CAD 3.791	\$ 2.771	0	(2)	(2)	0,00
MYI	08.2024	NOK 6.134	576	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 539	CHF 482	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	205	DKK 1.434	1	0	1	0,00
	07.2024	164	NOK 1.753	0	0	0	0,00
	07.2024	843	SEK 8.907	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	DKK 1.432	\$ 205	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	NOK 1.752	164	0	0	0	0,00
	08.2024	SEK 8.893	843	2	0	2	0,00
RBC	07.2024	\$ 4.304	£ 3.394	0	(14)	(14)	0,00
	08.2024	£ 3.394	\$ 4.305	14	0	14	0,00
RYL	07.2024	DKK 4	1	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	CHF 365	409	2	0	2	0,00
	07.2024	€ 306	329	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 258	CHF 231	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	24.018	€ 22.418	8	0	8	0,00
	08.2024	€ 22.418	\$ 24.053	0	(8)	(8)	0,00
TOR	07.2024	\$ 41.148	CHF 37.169	215	0	215	0,05
	07.2024	133	NZD 217	0	(1)	(1)	0,00
UAG	08.2024	NZD 217	\$ 133	1	0	1	0,00
	07.2024	CHF 37.190	41.451	64	0	64	0,02
	07.2024	DKK 2.141	311	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 40.817	CHF 36.885	231	0	231	0,05
	08.2024	41.451	37.053	0	(63)	(63)	(0,01)
				\$ 1.389	\$ (242)	\$ 1.147	0,27

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	07.2024	\$ 172	NZD 281	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	08.2024	NZD 281	\$ 172	1	0	1	0,00
BOA	07.2024	€ 10	11	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	\$ 42.820	€ 39.440	0	(550)	(550)	(0,13)
	07.2024	CAD 1	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 6.396	8.171	85	0	85	0,02
	07.2024	¥ 816	5	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 4.287	AUD 6.434	10	0	10	0,00
	07.2024	1.598	€ 1.485	0	(6)	(6)	0,00
BRC	08.2024	AUD 6.434	\$ 4.291	0	(10)	(10)	0,00
	07.2024	DKK 2.574	375	5	0	5	0,00
	07.2024	€ 236	253	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 14.545	1.383	17	0	17	0,00
CBK	07.2024	CHF 165	181	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	€ 42	45	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 16.614	1.565	0	(4)	(4)	0,00
FAR	07.2024	AUD 6.434	4.287	0	(10)	(10)	0,00
	07.2024	¥ 2.124.927	13.607	398	0	398	0,09
	07.2024	NZD 1.228	757	8	0	8	0,00
	07.2024	\$ 79.309	€ 72.817	0	(1.267)	(1.267)	(0,30)
	07.2024	13.516	¥ 2.153.484	0	(128)	(128)	(0,03)
	07.2024	329	NZD 539	0	0	0	0,00
	08.2024	¥ 2.143.381	\$ 13.516	128	0	128	0,03

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	NZD 539	\$ 329	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	07.2024	€ 1.409	1.525	15	0	15	0,00
JPM	07.2024	\$ 2.132	CHF 1.914	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	558	DKK 3.889	1	0	1	0,00
	07.2024	1.693	€ 1.582	3	0	3	0,00
	08.2024	CHF 1.907	\$ 2.132	3	0	3	0,00
MBC	08.2024	DKK 3.882	558	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	CAD 7.001	5.142	25	0	25	0,01
	07.2024	€ 42.943	45.919	0	(105)	(105)	(0,02)
	07.2024	¥ 29.577	186	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 5.118	CAD 7.007	3	0	3	0,00
	07.2024	2.103	€ 1.935	0	(28)	(28)	(0,01)
	07.2024	1.064	NOK 11.328	0	0	0	0,00
	07.2024	4	SEK 43	0	0	0	0,00
	08.2024	CAD 7.002	\$ 5.118	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	NOK 11.256	1.058	0	(1)	(1)	0,00
MYI	08.2024	\$ 45.986	€ 42.943	105	0	105	0,03
	07.2024	382	DKK 2.669	1	0	1	0,00
	07.2024	302	NOK 3.217	0	0	0	0,00
	07.2024	1.571	SEK 16.591	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	DKK 2.664	\$ 382	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	NOK 3.214	302	0	0	0	0,00
RBC	08.2024	SEK 16.566	1.571	4	0	4	0,00
	07.2024	€ 9	10	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 8.111	£ 6.396	0	(26)	(26)	(0,01)
	08.2024	£ 6.396	\$ 8.112	26	0	26	0,01
RYL	07.2024	DKK 7	1	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 823	881	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2024	CHF 8	9	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 72.873	78.076	0	(26)	(26)	(0,01)
	07.2024	\$ 648	€ 603	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	78.191	72.873	25	0	25	0,01
SSB	07.2024	267	246	0	(3)	(3)	0,00
TOR	07.2024	250	NZD 409	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	NZD 409	\$ 250	1	0	1	0,00
UAG	07.2024	CHF 1.742	1.927	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	DKK 3.985	579	6	0	6	0,00
				\$ 872	\$ (2.195)	\$ (1.323)	(0,31)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	\$ 35	NZD 58	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	NZD 58	\$ 35	0	0	0	0,00
BOA	07.2024	\$ 72	NOK 768	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	CAD 90	\$ 66	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 1.711	2.185	22	0	22	0,01
	07.2024	¥ 210	1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.105	AUD 1.658	3	0	3	0,00
	08.2024	AUD 1.658	\$ 1.106	0	(2)	(2)	0,00
BRC	07.2024	DKK 683	99	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 20.680	NOK 217.570	0	(246)	(246)	(0,06)
CBK	07.2024	CHF 42	\$ 46	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	SEK 4.124	388	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 21.002	NOK 221.394	0	(209)	(209)	(0,05)
FAR	07.2024	AUD 1.658	\$ 1.105	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	€ 10.849	11.816	189	0	189	0,04
	07.2024	¥ 545.822	3.495	102	0	102	0,02
	07.2024	NZD 253	156	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 3.505	¥ 558.448	0	(33)	(33)	(0,01)
	07.2024	68	NZD 111	0	0	0	0,00
	08.2024	¥ 555.828	\$ 3.505	33	0	33	0,01
	08.2024	NZD 111	68	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	€ 148	160	2	0	2	0,00
JPM	07.2024	\$ 538	CHF 482	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	176	DKK 1.224	0	0	0	0,00
	08.2024	CHF 481	\$ 538	1	0	1	0,00
	08.2024	DKK 1.222	176	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	CAD 1.791	1.316	7	0	7	0,00
	07.2024	DKK 325	47	1	0	1	0,00
	07.2024	NOK 168.268	15.796	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	\$ 1.375	CAD 1.883	1	0	1	0,00
	07.2024	92	€ 85	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	0	NOK 4	0	0	0	0,00
	07.2024	1	SEK 11	0	0	0	0,00
	08.2024	CAD 1.882	\$ 1.375	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 15.846	NOK 168.668	7	0	7	0,00
MYI	07.2024	NOK 209.716	\$ 19.671	0	(26)	(26)	(0,01)
	07.2024	\$ 120	DKK 840	0	0	0	0,00
	07.2024	1.699	NOK 17.909	0	(17)	(17)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 390	SEK 4.119	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	08.2024	DKK 839	\$ 120	0	0	0	0,00
	08.2024	SEK 4.112	390	1	0	1	0,00
	08.2024	\$ 19.671	NOK 209.549	26	0	26	0,01
RBC	07.2024	£ 2.170	£ 1.711	0	(7)	(7)	0,00
	08.2024	£ 1.711	\$ 2.170	7	0	7	0,00
RYL	07.2024	DKK 2	0	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 9.997	939	2	(2)	0	0,00
SCX	07.2024	\$ 709	NOK 7.521	1	(3)	(2)	0,00
	07.2024	CHF 2	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 11.600	€ 10.827	4	0	4	0,00
	08.2024	€ 10.827	\$ 11.617	0	(4)	(4)	0,00
SSB	07.2024	¥ 12.892	83	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 92	€ 85	0	(1)	(1)	0,00
TOR	07.2024	52	NZD 84	0	0	0	0,00
	08.2024	NZD 84	\$ 52	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	CHF 439	486	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	DKK 1.057	154	2	0	2	0,00
				\$ 416	\$ (569)	\$ (153)	(0,04)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 5.937	1,41

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2039	\$ 7.700	\$ (6.768)	(1,61)
2,000 % fällig am 01.08.2054	31.550	(24.704)	(5,87)
3,000 % fällig am 01.08.2054	11.100	(9.452)	(2,24)
3,500 % fällig am 01.07.2054 (h)	1.400	(1.239)	(0,29)
5,500 % fällig am 01.08.2054	1.200	(1.183)	(0,28)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (43.346)	(10,29)
Summe Anlagen		\$ 529.491	125,73
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (108.346)	(25,73)
Nettovermögen		\$ 421.145	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (g) Mit dem Fonds verbunden.
- (h) Zum 30. Juni 2024 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,29 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	\$ 321	\$ 375	0,09

Barmittel in Höhe von 10.775 USD (31. Dezember 2023: 14.326 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 870 USD (31. Dezember 2023: 870 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 558.843	\$ 650	\$ 559.493
Investmentfonds	6.848	0	0	6.848
Pensionsgeschäfte	0	617	0	617
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	192	5.687	0	5.879
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(43.346)	0	(43.346)
<b>Summen</b>	<b>\$ 7.040</b>	<b>\$ 521.801</b>	<b>\$ 650</b>	<b>\$ 529.491</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 556.360	\$ 1.793	\$ 558.153
Investmentfonds	18.210	0	0	18.210
Pensionsgeschäfte	0	534	0	534
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(3.319)	10.953	0	7.634
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(42.127)	0	(42.127)
<b>Summen</b>	<b>\$ 14.891</b>	<b>\$ 525.720</b>	<b>\$ 1.793</b>	<b>\$ 542.404</b>

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (91)	\$ 0	\$ (91)	\$ (55)	\$ 0	\$ (55)
BOA	(507)	590	83	332	(270)	62
BPS	2.160	(320)	1.840	(275)	280	5
BRC	161	0	161	326	(230)	96
CBK	838	280	1.118	559	(600)	(41)
DUB	110	(50)	60	(17)	(50)	(67)
FAR	528	(550)	(22)	(5)	0	(5)
GLM	(345)	0	(345)	1.938	(1.980)	(42)
GST	762	0	762	10	0	10
IND	25	0	25	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	118	0	118	(82)	0	(82)
MBC	539	(420)	119	(127)	320	193
MYC	19	0	19	(42)	0	(42)
MYI	1.180	(1.030)	150	2.281	(2.710)	(429)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
RYL	(4)	0	(4)	(7)	0	(7)
SCX	5	0	5	41	0	41
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	7	0	7
SSB	17	0	17	3	0	3
TOR	215	(320)	(105)	(432)	270	(162)
UAG	216	(290)	(74)	1.111	(1.380)	(269)
ULO	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	79,85	74,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	51,16	54,44
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,84	0,14
Investmentfonds	1,62	4,21
Pensionsgeschäfte	0,15	0,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	(1,16)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,02	1,64
Freiverkehrsfinanzderivate	1,41	1,29
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,29)	(9,75)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Argentinien	0,04	0,03
Australien	2,46	1,65
Belgien	0,43	k. A.
Brasilien	k. A.	0,00
Bulgarien	k. A.	0,43
Kanada	2,79	1,57
Cayman-Inseln	3,20	3,87
Chile	0,47	0,29
China	0,08	0,07
Kolumbien	0,77	0,50
Tschechische Republik	0,10	0,11
Dänemark	0,14	2,49
Dominikanische Republik	0,46	0,30
Ecuador	0,09	k. A.
Finnland	0,10	k. A.
Frankreich	2,42	2,78
Deutschland	1,36	2,02
Guatemala	0,09	0,09
Ungarn	1,38	1,38
Indien	0,26	k. A.
Indonesien	0,36	1,11
Irland	4,24	4,79
Israel	1,85	1,88
Italien	7,35	7,28
Elfenbeinküste	0,53	0,53
Japan	4,57	6,33
Kasachstan	0,43	0,43
Luxemburg	0,70	1,24
Malaysia	0,46	0,46
Mexiko	0,45	k. A.
Multinational	0,21	0,21
Niederlande	2,24	1,28
Neuseeland	0,02	0,07
Norwegen	0,42	0,19
Peru	0,50	0,50
Philippinen	0,08	0,08
Polen	0,95	0,78
Portugal	0,18	0,18
Katar	k. A.	0,07
Rumänien	1,06	1,07
Russland	k. A.	0,08
Saudi-Arabien	0,67	0,83
Senegal	0,32	k. A.
Serbien	0,93	0,82
Singapur	1,63	0,42
Slowenien	k. A.	0,19
Südafrika	0,09	0,09
Südkorea	3,49	2,67
Spanien	0,74	0,87
Supranational	0,70	0,67
Schweiz	1,48	1,10
Thailand	k. A.	0,22
Vereinigte Arabische Emirate	0,46	0,46
Großbritannien	8,48	8,07
USA	69,24	62,17
Kurzfristige Instrumente	1,38	4,40
Investmentfonds	1,62	4,21
Pensionsgeschäfte	0,15	0,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,03)	(1,16)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,05)	(0,18)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,09
Zinsswaps	0,07	1,73
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,03	k. A.
Zinsswapoptionen	0,09	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,09	0,08
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	(0,02)
Zinsswapoptionen	(0,15)	(0,19)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,02)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,00
Cross-Currency Swaps	0,97	0,01
Zinsswaps	0,01	0,01
Devisenterminkontrakte	0,45	0,47
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,08)	0,89
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,29)	(9,75)
Sonstige Aktiva und Passiva	(25,73)	(25,47)
Nettovermögen	100,00	100,00







# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	5.564.330	\$ 4.035	0,03	<b>SCHWEIZ</b>					<b>NON-AGENCY-MBS</b>				
3,250 % fällig am 10.09.2042		11.134.180	8.104	0,05	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>Alba PLC</b>				
4,250 % fällig am 10.12.2032		166.495.000	129.507	0,84	<b>UBS AG</b>					3,879 % fällig am 15.12.2038				
5,500 % fällig am 10.03.2028		14.900.000	11.665	0,08	0,250 % fällig am 05.01.2026					€ 84 \$ 87 0,00				
Summe Südkorea			371.865	2,42	<b>UBS Group AG</b>					€ 3.825 4.740 0,03				
<b>SPANIEN</b>					<b>2,193 % fällig am 05.06.2026</b>					<b>Brass PLC</b>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					<b>2,875 % fällig am 02.04.2032</b>					5,954 % fällig am 16.11.2066				
<b>BBVA Consumer Auto</b>					<b>3,091 % fällig am 14.05.2032</b>					<b>Canada Square Funding PLC</b>				
0,270 % fällig am 20.07.2031					<b>3,869 % fällig am 12.01.2029</b>					6,014 % fällig am 17.06.2058				
€ 1.106					€ 22.500					13.710 17.324 0,11				
1.183 0,01					€ 1.600					6,184 % fällig am 17.06.2058				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>4,125 % fällig am 09.06.2033</b>					6,484 % fällig am 17.12.2057				
<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b>					<b>4,194 % fällig am 01.04.2031</b>					<b>Eurohome UK Mortgages PLC</b>				
6,033 % fällig am 13.03.2035					<b>4,488 % fällig am 12.05.2026</b>					5,502 % fällig am 15.06.2044				
\$ 15.400 15.370 0,10					<b>4,550 % fällig am 17.04.2026</b>					77 96 0,00				
<b>Banco Santander S.A.</b>					<b>6,373 % fällig am 15.07.2026</b>					<b>Euroisail PLC</b>				
1,849 % fällig am 25.03.2026					<b>6,442 % fällig am 11.08.2028</b>					3,959 % fällig am 15.12.2044				
6,607 % fällig am 07.11.2028					<b>6,537 % fällig am 12.08.2033</b>					€ 83 88 0,00				
CaixaBank S.A.					<b>4,550 % fällig am 17.04.2026</b>					3,979 % fällig am 13.03.2045				
4,125 % fällig am 09.02.2032					<b>6,373 % fällig am 15.07.2026</b>					5,503 % fällig am 13.03.2045				
€ 11.600 12.476 0,08					<b>6,442 % fällig am 11.08.2028</b>					6,053 % fällig am 13.09.2045				
<b>Lorca Telecom Bondco S.A.</b>					<b>7,750 % fällig am 01.03.2029</b>					6,303 % fällig am 13.06.2045				
5,750 % fällig am 30.04.2029					<b>3,304 % fällig am 05.03.2029</b>					€ 318 337 0,00				
21.400 23.537 0,15					<b>Summe Schweiz</b>					€ 4.670 5.805 0,04				
70.271 0,45					<b>214.976 1,40</b>					\$ 19 19 0,00				
<b>NON-AGENCY-MBS</b>					<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>					<b>Hops Hill PLC</b>				
<b>Fondo de Titulizacion de Activos Santander Hipotecario</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					0,000 % fällig am 21.04.2056				
4,054 % fällig am 18.01.2049					<b>MDGH GMTN RSC Ltd.</b>					€ 28.200 35.737 0,23				
260 277 0,00					5,500 % fällig am 28.04.2033					€ 395 410 0,00				
<b>Fondo de Titulizacion de Activos UCI</b>					<b>GROSSBRITANNIEN</b>					<b>Mansard Mortgages PLC</b>				
3,859 % fällig am 15.09.2041					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					6,002 % fällig am 15.12.2049				
560 591 0,01					<b>Barclays PLC</b>					€ 4.332 5.440 0,04				
868 0,01					2,885 % fällig am 31.01.2027					<b>Newgate Funding PLC</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>					4,375 % fällig am 12.01.2026					4,148 % fällig am 01.12.2050				
<b>Autonomous Community of Catalonia</b>					4,506 % fällig am 31.01.2033					€ 1.493 1.496 0,01				
4,220 % fällig am 26.04.2035					6,496 % fällig am 13.09.2027					395 408 0,00				
3,900 4.182 0,03					<b>HSBC Holdings PLC</b>					4,319 % fällig am 15.12.2050				
<b>Autonomous Community of Madrid</b>					2,848 % fällig am 04.06.2031					1,700 1.758 0,01				
1,571 % fällig am 30.04.2029					2,999 % fällig am 10.03.2026					2,966 3.057 0,02				
1.300 1.292 0,01					3,973 % fällig am 22.05.2030					€ 512 632 0,01				
<b>Spain Government International Bond</b>					4,041 % fällig am 13.03.2028					5,522 % fällig am 01.12.2050				
1,450 % fällig am 31.10.2071					4,583 % fällig am 19.06.2029					428 527 0,00				
7,375 3.761 0,02					4,755 % fällig am 09.06.2028					332 399 0,00				
<b>1,900 % fällig am 31.10.2052</b>					4,787 % fällig am 10.03.2032					2.133 2.621 0,02				
2,700 1.900 0,01					5,210 % fällig am 11.08.2028					1.900 2.311 0,02				
<b>2,800 % fällig am 31.05.2026</b>					5,719 % fällig am 04.03.2035					<b>Paragon Mortgages PLC</b>				
14.700 15.651 0,10					<b>John Lewis PLC</b>					5,804 % fällig am 15.11.2038				
<b>3,450 % fällig am 30.07.2066</b>					6,125 % fällig am 21.01.2025					€ 18 17 0,00				
53.300 50.666 0,33					€ 100 127 0,00					€ 1.097 1.388 0,01				
<b>5,250 % fällig am 06.04.2029</b>					<b>Lloyds Banking Group PLC</b>					<b>Polaris PLC</b>				
€ 800 1.033 0,01					4,650 % fällig am 24.03.2026					6,000 % fällig am 23.12.2058				
78.485 0,51					<b>Mitsubishi HC Capital UK PLC</b>					<b>Resloc UK PLC</b>				
150.807 0,98					3,733 % fällig am 02.02.2027					5,512 % fällig am 15.12.2043				
<b>SUPRANATIONAL</b>					<b>Nationwide Building Society</b>					5,531 % fällig am 15.12.2043				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					2,972 % fällig am 16.02.2028					€ 2.184 2.587 0,02				
<b>Europäische Investitionsbank</b>					<b>NatWest Group PLC</b>					<b>Ripon Mortgages PLC</b>				
4,600 % fällig am 30.01.2037					5,076 % fällig am 27.01.2030					5,934 % fällig am 28.08.2056				
CAD 1.050 781 0,01					5,778 % fällig am 01.03.2035					€ 65.941 83.365 0,54				
<b>Inter-American Development Bank</b>					<b>NatWest Markets PLC</b>					<b>RMAC Securities PLC</b>				
2,500 % fällig am 14.04.2027					0,125 % fällig am 12.11.2025					3,993 % fällig am 12.06.2044				
AUD 15.200 9.616 0,06					<b>Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC</b>					€ 743 777 0,01				
10.397 0,07					0,000 % fällig am 05.04.2032 (a)					€ 300 368 0,00				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>					<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>					206 252 0,00				
<b>Europäische Union</b>					6,534 % fällig am 10.01.2029					<b>Southern Pacific Financing PLC</b>				
3,375 % fällig am 04.10.2039					7,482 % fällig am 29.08.2029					5,613 % fällig am 10.03.2044				
€ 49.170 52.443 0,34					<b>Santander UK PLC</b>					334 419 0,00				
Summe Supranational					3,000 % fällig am 12.03.2029					<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>				
62.840 0,41					5,783 % fällig am 12.02.2027					0,000 % fällig am 25.06.2049				
<b>TP ICAP Finance PLC</b>					3,250 % fällig am 18.06.2029					27.000 34.154 0,22				
2,625 % fällig am 18.11.2028					<b>Standard Chartered PLC</b>					<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>				
€ 9.800 10.627 0,07					1,822 % fällig am 23.11.2025					6,583 % fällig am 20.07.2045				
<b>TSB Bank PLC</b>					2,608 % fällig am 12.01.2028					<b>Trinity Square PLC</b>				
3,319 % fällig am 05.03.2029					2,678 % fällig am 29.06.2032					0,000 % fällig am 15.07.2059				
€ 22.400 24.064 0,16					4,196 % fällig am 04.03.2032					10.700 13.562 0,09				
<b>492.936 3,21</b>					<b>TP ICAP Finance PLC</b>					<b>Twin Bridges PLC</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>					2,625 % fällig am 18.11.2028					9.782 12.377 0,08				
<b>United Kingdom Gilt</b>					2,625 % fällig am 18.11.2028					<b>Uropa Securities PLC</b>				
0,625 % fällig am 22.10.2050					<b>TSB Bank PLC</b>					5,552 % fällig am 10.10.2040				
46.810 23.653 0,16					3,319 % fällig am 05.03.2029					<b>Warwick Finance Residential Mortgages PLC</b>				
328.112 2,14					€ 22.400 24.064 0,16					0,000 % fällig am 21.12.2049 (a)				
<b>492.936 3,21</b>					<b>492.936 3,21</b>					6,184 % fällig am 21.12.2049				
										7.280 9.251 0,06				
										3.640 4.583 0,03				
										2.080 2.610 0,02				
										2.080 2.587 0,02				
										328.112 2,14				









BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Intel Corp. 5,500 % fällig am 18.07.2024	\$ 9.600	\$ 9.571	0,06	<b>INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)	345.274	\$ 4.755	0,03
Marathon Oil Corp. 5,830 % fällig am 05.07.2024	4.800	4.795	0,03	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (d)	5.766.349	\$ 67.120	0,44			736.080	4,80
Parker-Hannifin Corp. 5,520 % fällig am 28.08.2024	2.450	2.427	0,02	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (d)	1.355.380	16.836	0,11	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
Penske Truck Leasing Co. LP 5,510 % fällig am 02.08.2024	3.600	3.580	0,02	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Bond Ex-US Fund (d)	10.956.929	117.130	0,76	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)	3.455.880	362.837	2,35
		47.702	0,31	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - UK Corporate Bond Fund (d)	5.823.621	68.611	0,45	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)	4.369.740	437.214	2,84
				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (d)	354.800	3.615	0,02			800.051	5,19
<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	45.959.722	458.013	2,99	Summe Investmentfonds		\$ 1.536.131	9,99
TER Finance Jersey Ltd. 7,020 % fällig am 02.01.2025 (a)(b)	4.000	3.857	0,02								
<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>											
0,004 % fällig am 17.09.2024 (a)(b)	¥ 21.360.000	132.780	0,87								
0,155 % fällig am 21.04.2025 (a)(b)	4.991.000	30.998	0,20								
0,166 % fällig am 21.04.2025 (a)(b)	4.689.000	29.123	0,19								
		192.901	1,26								
Summe kurzfristige Instrumente		244.460	1,59								
Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 16.181.473	105,46								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
CEW	4,720 %	24.06.2024	02.07.2024	CAD 130.000	Province of Ontario 3,650 % fällig am 02.06.2033	\$ (70.627)	\$ 95.005	\$ 95.091	0,62
	4,720	25.06.2024	03.07.2024	100.000	Province of Quebec 1,500 % fällig am 01.09.2031	(25.391)	73.081	73.137	0,48
	4,720	27.06.2024	05.07.2024	190.000	Province of Ontario 2,600 % fällig am 02.06.2027	(14.874)	138.853	138.925	0,90
	4,720	28.06.2024	08.07.2024	220.000	Province of Quebec 3,100 % fällig am 01.12.2051	(58.729)	160.778	160.840	1,06
DEU	5,400	28.06.2024	01.07.2024	\$ 35.800	Province of Ontario 3,500 % fällig am 02.06.2043	(2.489)	35.800	35.816	0,23
	5,430	28.06.2024	01.07.2024	70.600	Province of Quebec 2,850 % fällig am 01.12.2053	(138.055)	70.600	70.632	0,46
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	4.685	Province of Ontario 1,900 % fällig am 02.12.2051	(157.637)	4.685	4.685	0,03
					Province of Quebec 4,250 % fällig am 01.12.2043	(5.635)	3.200	3.201	0,02
SAL	5,270	28.06.2024	01.07.2024	3.200	U.S. Treasury Bonds 3,750 % fällig am 15.08.2041	(36.124)	3.200	3.201	0,02
					U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2029	(70.527)			
					fällig am 15.01.2026	(4.779)			
					U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 30.11.2025	(3.276)			
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (588.143)	\$ 582.002	\$ 582.327	3,80

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	10.382	\$ 11.216	0,07
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2024	2.590	(2.871)	(0,02)
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2025	5.224	(4.573)	(0,03)
Australia Government 3-Year Note September Futures	Long	09.2024	174	(39)	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	1.890	(5)	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	1.511	848	0,01
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	1.735	(1.664)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	2.467	(3.062)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	3.428	4.997	0,03
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	16	53	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	511	810	0,01
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	1.166	(583)	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	1.433	4.539	0,03
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	11.610	(4.972)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	4.622	(749)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	1.451	(1.506)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	2.840	\$ (2.682)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	45	5	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	4.861	(3.601)	(0,02)
				<b>\$ (3.839)</b>	<b>(0,02)</b>
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				<b>\$ (3.839)</b>	<b>(0,02)</b>

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.06.2026	\$ 800	\$ 33	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.IG-39 10-Year Index	(1,000) %	20.12.2032	\$ 2.060	\$ (37)	0,00
CDX.IG-40 10-Year Index	(1,000)	20.06.2033	63.070	(1.046)	(0,01)
CDX.IG-41 10-Year Index	(1,000)	20.12.2033	96.900	(1.443)	(0,01)
CDX.IG-42 10-Year Index	(1,000)	20.06.2034	345.000	489	0,01
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	(1,000)	20.06.2029	€ 465.400	1.319	0,01
				<b>\$ (718)</b>	<b>0,00</b>

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 1.400	\$ 20	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	16.600	110	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	207.600	(86)	0,00
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	3.944.100	(4.832)	(0,03)
				<b>\$ (4.788)</b>	<b>(0,03)</b>

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	1-Day	GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000 %	17.06.2027	£ 357.180	\$ (6.909)	(0,05)
Erhalt	1-Day	GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000	17.06.2035	77.260	4.662	0,03
Zahlung	1-Day	GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	896.250	(18.175)	(0,12)
Zahlung	1-Day	GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	45.800	(2.692)	(0,02)
Zahlung	1-Day	GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	740.500	(8.491)	(0,06)
Zahlung	1-Day	INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	18.09.2029	INR 13.819.670	(142)	0,00
Zahlung	1-Day	JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	¥ 14.710.000	(3.844)	(0,03)
Zahlung	1-Day	JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	17.222.400	(2.030)	(0,01)
Erhalt	1-Day	JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	13.160.000	10.730	0,07
Zahlung	1-Day	JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,600	18.09.2029	95.678.500	(1.166)	(0,01)
Zahlung	1-Day	JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	18.09.2034	72.160.000	(1.690)	(0,01)
Zahlung	1-Day	JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,500	18.09.2054	4.800.000	(82)	0,00
Erhalt	1-Day	SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	18.09.2029	SGD 975.310	5.038	0,03
Erhalt	1-Day	THB-THORON Compounded-OIS	2,250	18.09.2029	THB 14.507.550	4.960	0,03
Erhalt	1-Day	THB-THORON Compounded-OIS	2,418	17.04.2029	3.391.900	25	0,00
Erhalt	1-Day	THB-THORON Compounded-OIS	2,500	18.09.2029	14.437.520	(1.655)	(0,01)
Erhalt	1-Day	THB-THORON Compounded-OIS	2,750	18.09.2034	1.522.450	75	0,00
Erhalt	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	1,249	31.08.2024	\$ 178.000	1.481	0,01
Erhalt	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	1,298	25.08.2024	155.100	1.267	0,01
Erhalt	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	17.09.2024	53.950	433	0,00
Zahlung	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	1,488	15.08.2031	25.600	(4.833)	(0,03)
Erhalt	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2025	6.500	(162)	0,00
Erhalt	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	185.971	(2.253)	(0,02)
Zahlung	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	2,310	16.01.2025	441.600	(12.059)	(0,08)
Zahlung	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	2,688	04.04.2025	14.400	(251)	0,00
Zahlung	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	2,690	04.04.2025	33.700	(586)	0,00
Zahlung	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	2,697	04.04.2025	6.300	(109)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	2,721	10.04.2025	15.300	(264)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	2,790	10.04.2025	39.000	(640)	0,00
Zahlung	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	14.900	(288)	0,00
Zahlung	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	25.900	(485)	0,00
Zahlung	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	31.800	(618)	0,00
Erhalt	1-Day	USD-SOFR Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	565.100	27.296	0,18



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
Zahlung		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500 %	19.06.2026	CAD	636.700	\$ 6	0,00
Erhalt		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.06.2032		169.600	1.387	0,01
Erhalt		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.09.2033		78.900	(771)	(0,01)
Erhalt		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	18.06.2034		75.500	(217)	0,00
Erhalt		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,700	01.09.2033		31.200	(480)	0,00
Erhalt		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2033		76.800	(1.103)	(0,01)
Zahlung		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,898	19.06.2026		453.200	979	0,01
Zahlung		3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,925	19.06.2026		402.900	928	0,01
Zahlung		3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF	47.000	(1.062)	(0,01)
Zahlung		3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027		42.300	(266)	0,00
Zahlung		3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027		31.300	(580)	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	18.09.2029	CNY	7.037.318	8.685	0,06
Erhalt		3-Month KRW-KORIBOR	3,250	18.09.2029	KRW	251.634.750	(237)	0,00
Zahlung		3-Month KRW-KORIBOR	3,250	18.09.2034		5.462.080	18	0,00
Zahlung		3-Month NZD-BBR	4,750	19.06.2029	NZD	77.500	(24)	0,00
Zahlung		3-Month NZD-BBR	5,000	20.03.2025		307.600	1.857	0,01
Zahlung		3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	SEK	56.700	(607)	0,00
Erhalt		6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD	128.300	16.705	0,11
Erhalt		6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027		83.400	406	0,00
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033		698.300	(2.787)	(0,02)
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032		40.100	(156)	0,00
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033		206.600	(4.626)	(0,03)
Erhalt		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,335	25.09.2024		1.012.600	84	0,00
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032		866.100	2.387	0,02
Erhalt		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	19.06.2034		153.300	(323)	0,00
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033		445.800	5.973	0,04
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK	158.300	(685)	(0,01)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€	7.450	3.522	0,02
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052		17.650	9.370	0,06
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024		12.500	(149)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027		34.400	(2.419)	(0,02)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027		24.400	(1.628)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027		19.200	(1.337)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027		41.000	(2.464)	(0,02)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027		18.100	(1.081)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037		55.870	(1.312)	(0,01)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054		460.690	21.173	0,14
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029		1.415.850	(15.959)	(0,10)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034		1.580.220	(39.185)	(0,26)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2039		46.900	(676)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,760	04.03.2034		3.400	(23)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,765	25.05.2033		29.900	40	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,801	25.05.2033		56.700	(91)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029		34.100	(94)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,833	15.08.2033		76.300	(299)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,836	25.05.2033		144.500	(641)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,849	15.08.2033		104.200	(549)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,857	15.08.2033		4.800	(28)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,859	15.08.2033		292.400	(1.766)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026		674.940	(5.078)	(0,03)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027		561.480	(2.237)	(0,02)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033		252.755	(588)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028		1.550	66	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,535	18.09.2025		909.200	(8.775)	(0,06)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN	393.200	(1.361)	(0,01)
						\$	(47.128)	(0,31)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						\$	<b>(52.601)</b>	<b>(0,34)</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## OPTIONSKAUF

## DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,275	06.12.2024	1.300	\$ 156	\$ 331	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	06.12.2024	3.350	419	645	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	06.12.2024	2.960	269	422	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	14.01.2025	2.570	249	421	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	14.01.2025	3.370	268	421	0,00
CBK	Call - OTC USD versus CNH	7,400	23.01.2025	2.450	232	310	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.01.2025	2.750	289	514	0,01
MBC	Call - OTC USD versus CNH	7,450	14.02.2025	2.450	233	279	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,350	06.12.2024	3.400	328	620	0,01
SCX	Call - OTC USD versus CNH	7,375	14.02.2025	2.780	272	379	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	1.420	145	216	0,00
					\$ 2.860	\$ 4.558	0,03

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750 %	15.07.2024	230.900	\$ 462	\$ 567	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,930	23.06.2025	62.700	2.255	2.767	0,02
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,005	25.09.2025	9.600	353	440	0,00
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750	10.07.2024	1.210.100	3.297	3.059	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,960	25.06.2025	79.700	2.736	3.394	0,02
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,005	25.09.2025	1.800	75	82	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,065	24.06.2025	54.900	1.645	2.019	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,960	25.06.2025	5.700	214	243	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,005	25.09.2025	16.300	677	746	0,01
						\$ 11.714	\$ 13.317	0,09	

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	26.800	\$ 2.027	\$ 12.894	0,08

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250 %	15.07.2024	230.900	\$ (231)	\$ (8)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	23.06.2025	240.600	(2.286)	(2.654)	(0,02)
BPS	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	26.800	(2.027)	(10.682)	(0,07)
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	25.09.2025	36.400	(349)	(413)	0,00
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250	10.07.2024	1.210.100	(1.815)	(28)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,280	25.06.2025	40.400	(404)	(432)	(0,01)
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,300	25.06.2025	266.000	(2.341)	(2.770)	(0,02)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,330	25.09.2025	6.600	(73)	(81)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,400	24.06.2025	211.100	(1.646)	(1.930)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,280	25.06.2025	21.300	(213)	(227)	0,00
JPM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,330	25.09.2025	62.400	(686)	(765)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	47.700	(186)	(90)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	37.900	(127)	(60)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	47.700	(186)	(245)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	37.900	(127)	(10)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	18.07.2024	32.100	(107)	(30)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	18.07.2024	32.100	(107)	(136)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	123.600	(873)	(23)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	6.700	(26)	(12)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	24.300	(95)	(23)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	6.700	(26)	(35)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	24.300	(95)	(12)	0,00
RYL	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	19.000	(49)	(37)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	19.000	(70)	(52)	0,00
RYL	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	19.000	(70)	(108)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	19.000	(49)	(83)	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	52.700	(84)	(75)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	52.700	(84)	(40)	0,00
						\$ (14.432)	\$ (21.061)	(0,14)	

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.06.2029	\$ 27.200	\$ (794)	\$ 13	\$ (781)	0,00
MYC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	27.700	(809)	14	(795)	0,00
					\$ (1.603)	\$ 27	\$ (1.576)	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - Schutzverkauf<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 11.810	\$ (285)	\$ 381	\$ 96	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	17.350	(421)	561	140	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	4.020	(97)	129	32	0,00
GST	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2029	1.200	(15)	(8)	(23)	0,00
JPM	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2029	750	(8)	(6)	(14)	0,00
					\$ (826)	\$ 1.057	\$ 231	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückertlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückertlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 106.300	\$ 80.086	\$ 526	\$ (9.894)	\$ (9.368)	(0,06)
BPS	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,591 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026	\$ 98.017	¥ 14.486.900	(1.090)	9.143	8.053	0,05
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,605 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	19.03.2026	65.449	9.611.200	(264)	6.016	5.752	0,04
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,605 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	19.03.2026	242.057	35.495.400	1.764	19.825	21.589	0,14
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,605 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	19.03.2026	65.449	9.597.400	(130)	6.008	5.878	0,04
BRC	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,590 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026	98.474	13.786.300	5.225	7.633	12.858	0,08

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,600 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	21.01.2026	\$ 211.114	¥ 29.408.200	\$ 10.977	\$ 17.524	\$ 28.501	0,18	
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,586 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026		97.062	14.316.700	(880)	9.031	8.151	0,05
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,605 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	19.03.2026		337.529	49.460.000	1.705	28.621	30.326	0,20
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	AUD 105.500	\$ 72.795	(26)	(2.026)	(2.052)	(0,01)	
	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029		69.828	101.200	(205)	(1.759)	(1.964)	(0,01)
GST	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,610 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	21.01.2026	\$ 182.464	¥ 25.417.200	11.247	13.401	24.648	0,16	
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	AUD 65.900	\$ 47.343	287	(3.741)	(3.454)	(0,02)	
						\$ 29.136	\$ 99.782	\$ 128.918	0,84	

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750 %	18.09.2029	MYR 100.260	\$ (68)	\$ (36)	\$ (104)	0,00
CBK	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	34.380	44	3	47	0,00
	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2034	19.860	38	5	43	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2029	467.180	493	9	502	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	20.09.2033	275.030	1.742	(1.361)	381	0,00
JPM	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	40.370	55	0	55	0,00
	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2034	23.120	45	5	50	0,00
SCX	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2034	39.910	82	4	86	0,00
						\$ 2.431	\$ (1.371)	\$ 1.060	0,01

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD 24.298	\$ 14.898	\$ 92	\$ 0	\$ 92	0,00
	08.2024	\$ 5.511	NZD 8.999	0	(27)	(27)	0,00
	10.2024	52.684	CNH 376.919	0	(619)	(619)	0,00
BOA	07.2024	DKK 127.654	\$ 18.630	284	0	284	0,00
	07.2024	€ 14.757	16.090	274	0	274	0,00
	07.2024	KRW 194.882.344	142.476	933	0	933	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	SGD	6.260	\$ 4.625	\$ 8	\$ (2)	0,00
	07.2024	\$	2.259	AUD 3.399	11	0	0,00
	07.2024		2.380	HUF 878.126	1	0	0,00
	07.2024		1.431	MYR 6.734	0	(3)	0,00
	07.2024		8.621	PLN 34.386	0	(69)	0,00
	08.2024	TRY	260	\$ 7	0	0	0,00
	09.2024	\$	40.846	INR 3.421.569	96	0	0,00
	02.2025	CNH	37.568	\$ 5.260	26	0	0,00
	04.2025	DKK	513.300	75.684	717	0	0,01
	07.2024	AUD	12.930	8.554	0	(81)	0,00
	07.2024	BRL	62.327	12.392	1.171	0	0,01
	07.2024	CNH	363.208	50.155	400	0	0,00
	07.2024	DKK	49.219	7.148	74	0	0,00
	07.2024	€	2.926.588	3.167.811	31.239	0	0,20
	07.2024	£	36.553	46.448	241	0	0,00
	07.2024	IDR	765.941	47	0	0	0,00
	07.2024	KRW	193.818.176	141.207	436	0	0,00
	07.2024	\$	125.707	AUD 188.722	331	0	0,00
	07.2024		200	BRL 1.071	0	(7)	0,00
	07.2024		2.137	CAD 2.932	6	0	0,00
	07.2024		11.088	CNH 80.379	0	(76)	0,00
	07.2024		72.708	CNY 517.177	0	(965)	(0,01)
	07.2024		3.432.533	€ 3.209.042	6.885	(126)	0,04
	07.2024		33.540	IDR 547.944.966	10	(60)	0,00
	07.2024		1.814	ILS 6.726	0	(28)	0,00
	07.2024		19.955	¥ 3.117.000	0	(578)	0,00
	07.2024		6.231	KRW 8.646.044	48	0	0,00
	07.2024		15.940	NZD 25.947	0	(129)	0,00
	07.2024		79.598	PLN 321.176	490	(210)	0,00
	07.2024		9.150	SEK 96.390	0	(49)	0,00
	08.2024	AUD	178.345	\$ 118.934	0	(274)	0,00
	08.2024	€	3.201.634	3.429.469	0	(6.886)	(0,04)
	08.2024	TRY	180	5	0	0	0,00
	09.2024	CNH	818.505	114.112	1.347	0	0,01
	09.2024	COP	38.555.499	9.626	433	0	0,00
	09.2024	INR	2.545.469	30.449	0	(9)	0,00
	09.2024	TWD	2.018.099	62.710	375	0	0,00
	09.2024	\$	12.848	INR 1.075.319	19	0	0,00
	09.2024		21.463	MXN 400.026	152	0	0,00
	09.2024		4.352	TWD 139.946	0	(29)	0,00
	10.2024	CNH	190.982	\$ 26.673	292	0	0,00
	10.2024	\$	15.050	CNH 107.768	0	(164)	0,00
	12.2024		11.260	80.751	0	(66)	0,00
	01.2025	CNH	70.703	\$ 9.898	70	0	0,00
	05.2029	KWD	10.514	36.145	1.040	0	0,01
	07.2024	CAD	6.584	4.792	0	(20)	0,00
	07.2024	DKK	368.860	53.700	689	0	0,00
	07.2024	¥	95.516.361	616.190	22.405	0	0,15
	07.2024	MXN	123.334	6.672	0	(59)	0,00
	07.2024	NOK	71.045	6.753	80	0	0,00
	07.2024	PLN	139	35	1	0	0,00
	07.2024	RON	1.305	283	2	0	0,00
	07.2024	SGD	16.782	12.427	44	0	0,00
	07.2024	THB	11.230	307	0	0	0,00
	07.2024	\$	6.797	CAD 9.296	2	(6)	0,00
	07.2024		45.565	CHF 40.621	0	(360)	0,00
	07.2024		9.962	CNH 72.092	0	(82)	0,00
	07.2024		1.690	£ 1.322	0	(19)	0,00
	07.2024		1.556	MXN 28.467	0	(1)	0,00
	07.2024		10.678	PLN 42.654	0	(70)	0,00
	07.2024		4.941	TRY 168.592	46	0	0,00
	09.2024	CNH	552.962	\$ 76.710	529	0	0,00
	09.2024	COP	4.027	1	0	0	0,00
	09.2024	¥	21.360.000	138.114	3.774	0	0,02
	09.2024	MXN	232.067	12.399	0	(141)	0,00
	09.2024	\$	1.769	CLP 1.634.011	0	(39)	0,00
	09.2024		36.493	MXN 694.830	1.052	0	0,01
	10.2024	CNH	514	\$ 71	0	0	0,00
	10.2024	\$	18.593	¥ 2.800.052	0	(946)	(0,01)
	02.2025		5.260	CNH 37.549	0	(28)	0,00
	04.2025	¥	3.570.000	\$ 24.383	1.239	0	0,01
	07.2024	CAD	325.336	237.718	114	(161)	0,00
	07.2024	CHF	22.646	24.884	0	(317)	0,00
	07.2024	CNH	191.690	26.446	170	0	0,00
	07.2024	CNY	76.771	10.779	213	0	0,00
	07.2024	COP	62.436.650	15.287	272	(6)	0,00
	07.2024	NOK	6.983	662	7	0	0,00
	07.2024	PLN	60	15	0	0	0,00
	07.2024	THB	230.975	6.311	8	0	0,00
	07.2024	\$	10.024	AUD 15.127	78	0	0,00
	07.2024		57.994	BRL 293.601	0	(5.137)	(0,03)
	07.2024		1.141	CAD 1.567	4	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	07.2024	\$ 37.730	CNH 273.001	\$ 0	\$ (309)	\$ (309)	0,00
	07.2024	87.943	CNY 625.966	0	(269)	(269)	0,00
	07.2024	17.109	DKK 118.905	0	(20)	(20)	0,00
	07.2024	4.500	€ 4.131	0	(72)	(72)	0,00
	07.2024	44.854	£ 35.096	0	(489)	(489)	0,00
	07.2024	10.365	KRW 14.138.565	0	(96)	(96)	0,00
	07.2024	18.500	PLN 73.361	0	(255)	(255)	0,00
	07.2024	140	ZAR 2.571	0	0	0	0,00
	08.2024	BRL 25.367	\$ 4.630	80	0	80	0,00
	08.2024	CAD 5.415	3.959	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	PEN 15.252	4.037	56	0	56	0,00
	09.2024	CNH 310.998	43.195	349	0	349	0,00
	09.2024	COP 37.558.691	9.363	408	0	408	0,00
	09.2024	INR 141.261	1.690	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	TWD 725.278	22.501	99	0	99	0,00
	09.2024	\$ 3.538	CLP 3.226.830	0	(121)	(121)	0,00
	09.2024	66.194	INR 5.534.012	53	(27)	26	0,00
	10.2024	8.463	¥ 1.210.000	0	(837)	(837)	(0,01)
	01.2025	9.898	CNH 70.662	0	(76)	(76)	0,00
	01.2026	¥ 1.210.000	\$ 8.914	837	0	837	0,01
DUB	07.2024	AUD 12.099	8.008	0	(73)	(73)	0,00
	07.2024	BRL 1.319	250	13	0	13	0,00
	07.2024	£ 514.982	657.107	6.119	0	6.119	0,04
	07.2024	IDR 1.631.100	100	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 100.332.209	72.925	54	0	54	0,00
	07.2024	MYR 401.032	85.059	0	(14)	(14)	0,00
	07.2024	\$ 4.049	BRL 20.348	0	(386)	(386)	0,00
	07.2024	10.767	CLP 9.957.580	0	(219)	(219)	0,00
	07.2024	18.274	PLN 71.818	0	(413)	(413)	0,00
	08.2024	BRL 38.784	\$ 7.535	578	0	578	0,00
	09.2024	\$ 5.508	CLP 5.067.472	0	(143)	(143)	0,00
	10.2024	44.777	¥ 6.742.398	0	(2.282)	(2.282)	(0,01)
FAR	04.2025	¥ 6.110.000	\$ 41.739	2.127	0	2.127	0,01
	07.2024	AUD 174.628	116.349	0	(276)	(276)	0,00
	07.2024	CAD 95.098	69.415	0	(88)	(88)	0,00
	07.2024	NZD 17.293	10.547	10	0	10	0,00
	07.2024	\$ 5	£ 4	0	0	0	0,00
	07.2024	1.220.007	¥ 190.517.811	0	(35.637)	(35.637)	(0,23)
	08.2024	932	AUD 1.396	1	0	1	0,00
GLM	08.2024	10.547	NZD 17.293	0	(10)	(10)	0,00
	07.2024	CNH 118	\$ 16	0	0	0	0,00
	07.2024	CNY 3.318	465	9	0	9	0,00
	07.2024	HUF 6.965	19	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 34.644	25	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 124.079	6.682	0	(91)	(91)	0,00
	07.2024	MYR 516	110	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 4.811	3.578	28	0	28	0,00
	07.2024	\$ 5.701	AUD 8.569	22	0	22	0,00
	07.2024	20.750	CNY 147.693	0	(54)	(54)	0,00
	07.2024	450	KRW 618.208	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	21.025	PLN 84.076	88	(203)	(115)	0,00
	07.2024	4.262	SGD 5.764	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	30.351	ZAR 555.287	21	0	21	0,00
	08.2024	8.783	BRL 46.458	0	(449)	(449)	0,00
	09.2024	970	MXN 18.484	29	0	29	0,00
	10.2024	25.947	¥ 3.670.000	0	(2.818)	(2.818)	(0,02)
IND	01.2026	¥ 3.670.000	\$ 27.264	2.765	0	2.765	0,02
	07.2024	CNY 160.102	22.467	433	0	433	0,00
	07.2024	\$ 22.467	CNY 160.169	0	(28)	(28)	0,00
JPM	07.2024	AUD 2.465	\$ 1.643	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	BRL 17.887	3.556	336	0	336	0,00
	07.2024	CAD 26.866	19.646	12	0	12	0,00
	07.2024	CHF 6.897	7.625	0	(50)	(50)	0,00
	07.2024	CNY 152.622	21.400	230	0	230	0,00
	07.2024	€ 46.856	50.138	0	(80)	(80)	0,00
	07.2024	KRW 123.858.055	89.791	0	(167)	(167)	0,00
	07.2024	SGD 171.494	127.324	784	0	784	0,01
	07.2024	\$ 33.505	CHF 29.605	0	(559)	(559)	0,00
	07.2024	5.475	CLP 5.009.476	0	(168)	(168)	0,00
	07.2024	100	CNY 714	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	26.336	DKK 183.532	40	0	40	0,00
	07.2024	7.163	£ 5.655	0	(15)	(15)	0,00
	07.2024	4.491	ILS 16.610	0	(79)	(79)	0,00
	07.2024	171	KRW 235.187	0	0	0	0,00
	07.2024	14.872	PLN 58.461	0	(333)	(333)	0,00
	07.2024	38.565	TRY 1.312.101	1.089	0	1.089	0,01
	07.2024	57.138	ZAR 1.051.833	393	0	393	0,00
	08.2024	AUD 8.731	\$ 5.826	0	(10)	(10)	0,00
	08.2024	DKK 183.208	26.336	0	(40)	(40)	0,00
	08.2024	\$ 1.644	AUD 2.465	3	0	3	0,00
	08.2024	21.400	CNY 152.719	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	499	NZD 818	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	08.2024	\$	29.960	TRY 1.051.464	\$ 257	\$ 0	\$ 257	0,00
	09.2024	INR	1.484	\$ 18	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD	1.090.503	33.872	188	0	188	0,00
	09.2024	\$	9.011	INR 755.000	23	0	23	0,00
	10.2024	CNH	478.646	\$ 66.889	771	0	771	0,01
	10.2024	¥	7.740.000	62.332	13.551	0	13.551	0,09
	10.2024	\$	15.105	CNH 107.880	0	(203)	(203)	0,00
	10.2024		24.140	¥ 3.490.000	0	(2.144)	(2.144)	(0,01)
	12.2024	CNH	80.789	\$ 11.260	61	0	61	0,00
	01.2025	DKK	300.600	44.421	739	0	739	0,01
	04.2025		243.500	35.857	294	0	294	0,00
	01.2026	¥	3.490.000	25.465	2.168	0	2.168	0,01
MBC	07.2024	CAD	741.832	543.844	1.832	(147)	1.685	0,01
	07.2024	CZK	40.633	1.762	22	0	22	0,00
	07.2024	DKK	393.652	57.303	729	0	729	0,00
	07.2024	€	47.891	51.880	553	0	553	0,00
	07.2024	HUF	395.051	1.060	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	IDR	580.831.452	35.234	0	(265)	(265)	0,00
	07.2024	¥	100.278.400	640.938	17.549	0	17.549	0,11
	07.2024	SEK	1.601.475	152.468	1.246	0	1.246	0,01
	07.2024	SGD	6.864	5.087	22	0	22	0,00
	07.2024	\$	392.918	CAD 537.968	236	(3)	233	0,00
	07.2024		75.112	CHF 66.918	0	(643)	(643)	0,00
	07.2024		24.198	CNH 175.171	0	(204)	(204)	0,00
	07.2024		17.633	DKK 122.655	13	(19)	(6)	0,00
	07.2024		5.782	€ 5.388	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024		643.812	£ 508.624	0	(861)	(861)	(0,01)
	07.2024		1.805	¥ 285.300	0	(32)	(32)	0,00
	07.2024		5.698	NOK 60.696	3	0	3	0,00
	07.2024		499	NZD 818	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024		69.177	SEK 719.935	0	(1.196)	(1.196)	(0,01)
	08.2024	CAD	534.657	\$ 390.763	0	(245)	(245)	0,00
	08.2024	£	474.352	600.251	514	0	514	0,00
	08.2024	NOK	60.648	5.698	0	(3)	(3)	0,00
	09.2024	CNH	403.668	56.063	450	0	450	0,00
	09.2024	\$	5.130	TWD 165.130	0	(29)	(29)	0,00
	10.2024	¥	10.172.450	\$ 81.581	17.470	0	17.470	0,11
	12.2024	CNH	93.074	13.040	138	0	138	0,00
	12.2024	\$	13.040	CNH 93.040	0	(143)	(143)	0,00
	01.2025	DKK	246.800	\$ 36.224	360	0	360	0,00
	04.2025		966.900	142.757	1.543	0	1.543	0,01
MYI	07.2024	BRL	233.430	45.191	3.165	0	3.165	0,02
	07.2024	CNH	5.318	736	7	0	7	0,00
	07.2024	€	143.794	154.183	72	0	72	0,00
	07.2024	£	228	288	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	76	CHF 68	0	0	0	0,00
	07.2024		18.849	CNY 134.227	0	(42)	(42)	0,00
	07.2024		40.725	DKK 284.250	126	0	126	0,00
	07.2024		3.422	€ 3.195	3	0	3	0,00
	07.2024		1.399	£ 1.106	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024		1.660	NOK 17.699	2	0	2	0,00
	07.2024		16.939	NZD 27.619	0	(109)	(109)	0,00
	07.2024		23	SGD 31	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK	283.744	\$ 40.725	0	(126)	(126)	0,00
	08.2024	NOK	17.319	1.626	0	(2)	(2)	0,00
	09.2024	TWD	433.808	13.522	122	0	122	0,00
	09.2024	\$	6.026	INR 503.851	3	0	3	0,00
RBC	07.2024		930	AUD 1.396	2	0	2	0,00
	07.2024		2.451	CAD 3.369	11	0	11	0,00
	07.2024		5.531	€ 5.092	0	(74)	(74)	0,00
RYL	07.2024	AUD	15.091	\$ 10.068	0	(10)	(10)	0,00
	07.2024	DKK	1.415	206	2	0	2	0,00
	07.2024	\$	1.072	£ 838	0	(13)	(13)	0,00
	07.2024		700	NZD 1.133	0	(10)	(10)	0,00
SCX	07.2024	CNH	197.223	\$ 27.267	234	0	234	0,00
	07.2024	CNY	8.234	1.155	22	0	22	0,00
	07.2024	€	43.834	47.092	113	0	113	0,00
	07.2024	IDR	2.297.680	140	0	0	0	0,00
	07.2024	¥	60.476.100	386.180	10.226	0	10.226	0,07
	07.2024	KRW	103.340.058	75.778	722	0	722	0,00
	07.2024	PEN	30.707	8.191	175	0	175	0,00
	07.2024	SGD	1.746	1.294	6	(1)	5	0,00
	07.2024	\$	749	CHF 670	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024		36.266	CNY 257.881	0	(222)	(222)	0,00
	07.2024		718	¥ 112.900	0	(16)	(16)	0,00
	07.2024		9	MXN 168	0	0	0	0,00
	07.2024		739	SGD 996	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024		55	ZAR 1.015	0	0	0	0,00
	08.2024	PEN	17.706	\$ 4.683	61	0	61	0,00
	08.2024	\$	546	¥ 87.200	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	CNH	396.960	\$ 55.307	618	0	618	0,00
	09.2024	TWD	630.563	19.558	82	0	82	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2024	\$ 4.129	INR 345.579	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
	09.2024	480	MXN 9.030	8	0	8	0,00
	09.2024	5.687	TWD 182.757	0	(42)	(42)	0,00
SSB	07.2024	COP 22.102.232	\$ 5.572	249	0	249	0,00
	07.2024	\$ 427	¥ 67.600	0	(7)	(7)	0,00
	09.2024	COP 14.171.662	\$ 3.538	159	0	159	0,00
	09.2024	\$ 11.817	CLP 10.911.662	0	(265)	(265)	0,00
TOR	07.2024	CHF 190.835	\$ 211.266	0	(1.103)	(1.103)	(0,01)
	07.2024	NZD 13.108	8.028	41	0	41	0,00
	07.2024	\$ 61	CNH 448	0	0	0	0,00
	07.2024	388.831	¥ 62.174.139	0	(2.320)	(2.320)	(0,01)
	08.2024	CNH 447	\$ 61	0	0	0	0,00
	08.2024	¥ 61.882.593	388.831	2.314	0	2.314	0,02
	08.2024	\$ 8.028	NZD 13.108	0	(41)	(41)	0,00
UAG	07.2024	ILS 95.132	\$ 25.671	401	0	401	0,00
	07.2024	SGD 567	419	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 91.952	CHF 82.502	0	(141)	(141)	0,00
	08.2024	CHF 82.197	\$ 91.952	139	0	139	0,00
				\$ 175.120	\$ (75.836)	\$ 99.284	0,65

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional AUD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD 14.184	\$ 9.448	\$ 0	\$ (25)	\$ (25)	0,00
	07.2024	\$ 16.002	AUD 24.100	94	0	94	0,00
	08.2024	9.456	14.184	25	0	25	0,00
BOA	07.2024	463	696	2	0	2	0,00
BRC	07.2024	AUD 96	\$ 63	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 4.404	AUD 6.655	40	0	40	0,00
	08.2024	37	55	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	AUD 35	\$ 23	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 6.688	AUD 10.110	64	0	64	0,00
GLM	07.2024	9	13	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	AUD 133	\$ 88	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 25	AUD 37	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	AUD 10	\$ 7	0	0	0	0,00
				\$ 225	\$ (27)	\$ 198	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	\$ 8.410	CAD 11.509	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
CBK	07.2024	CAD 16.619	\$ 12.145	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 12.393	CAD 16.882	0	(56)	(56)	0,00
	08.2024	12.145	16.607	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	CAD 34.269	\$ 25.030	0	(13)	(13)	0,00
	07.2024	\$ 9.945	CAD 13.541	0	(49)	(49)	0,00
	08.2024	25.030	34.246	14	0	14	0,00
MYI	07.2024	6.566	8.962	0	(16)	(16)	0,00
				\$ 15	\$ (134)	\$ (119)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 207.676	CHF 186.807	\$ 210	\$ 0	\$ 210	0,00
BRC	07.2024	CHF 882	\$ 988	7	0	7	0,00
	07.2024	\$ 174	CHF 155	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2024	CHF 102	\$ 112	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 20.904	CHF 19.024	267	0	267	0,00
GLM	07.2024	CHF 254	\$ 284	1	0	1	0,00
JPM	07.2024	222.203	247.610	334	(1)	333	0,00
	08.2024	\$ 247.180	CHF 221.001	0	(323)	(323)	0,00
MBC	07.2024	CHF 772	\$ 865	6	0	6	0,00
	07.2024	\$ 90	CHF 80	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	CHF 44	\$ 49	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	1.115	1.245	5	0	5	0,00
SCX	07.2024	575	644	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 2.725	CHF 2.449	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	243.513	219.964	1.272	0	1.272	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
UAG	07/2024	CHF	220.442	\$ 245.693	\$ 376	\$ 0	0,00
	07/2024	\$	240.785	CHF 217.589	1.357	0	0,01
	08/2024		245.693	219.627	0	(370)	0,00
					\$ 3.839	\$ (698)	0,02

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional GBP (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, E Class GBP (Currency Exposure) thesaurierend, E Class USD (Currency Exposure) ausschüttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD	519	\$ 318	\$ 2	\$ 2	0,00
	08.2024	\$	318	NZD 519	0	(2)	0,00
BOA	07.2024	CLP	241.756	\$ 259	3	3	0,00
	07.2024	€	7	7	0	0	0,00
	07.2024	ILS	3.342	890	3	3	0,00
	07.2024	TWD	3.877	120	0	0	0,00
	07.2024	\$	163	€ 150	0	(3)	0,00
	07.2024		658	MXN 11.040	0	(55)	0,00
	08.2024		259	CLP 241.756	0	(3)	0,00
BPS	08.2024		890	ILS 3.338	0	(3)	0,00
	07.2024	AUD	13.538	\$ 9.021	0	(21)	0,00
	07.2024	€	75	81	1	0	0,00
	07.2024	SGD	2.048	1.510	0	(1)	0,00
	07.2024	\$	3.672	CAD 5.011	0	(9)	0,00
	07.2024		9	€ 8	0	0	0,00
	07.2024		24.937	£ 19.521	0	(260)	0,00
	07.2024		23	¥ 3.600	0	(1)	0,00
	07.2024		16	KRW 22.839	0	0	0,00
	08.2024	KRW	22.799	\$ 16	0	0	0,00
	08.2024	\$	9.028	AUD 13.538	21	21	0,00
	08.2024		1.510	SGD 2.045	1	1	0,00
BRC	07.2024	€	48	\$ 51	0	0	0,00
	07.2024	KRW	9.936.967	7.139	0	(77)	0,00
	07.2024	MXN	33.120	1.815	4	4	0,00
	07.2024	\$	532	DKK 3.652	0	(7)	0,00
	07.2024		2.560	IDR 41.605.039	0	(18)	0,00
	07.2024		18	KRW 24.679	0	0	0,00
	07.2024		569	NOK 5.990	0	(7)	0,00
	07.2024		1.543	THB 56.684	2	2	0,00
	08.2024		7.139	KRW 9.919.833	72	72	0,00
	08.2024		1.806	MXN 33.120	0	(3)	0,00
CBK	07.2024	€	4	\$ 4	0	0	0,00
	07.2024	£	438	558	4	4	0,00
	07.2024	PEN	1.112	292	2	2	0,00
	07.2024	PLN	5.682	1.409	0	(5)	0,00
	07.2024	\$	280	CHF 255	4	4	0,00
	07.2024		770	COP 2.969.063	0	(54)	0,00
	07.2024		409	€ 381	0	0	0,00
	07.2024		901	ILS 3.346	0	(13)	0,00
	07.2024		659	MXN 11.040	0	(55)	0,00
	07.2024		297	PEN 1.112	0	(7)	0,00
	07.2024		2.703	SEK 28.695	7	7	0,00
	08.2024		292	PEN 1.112	0	(2)	0,00
	08.2024		1.409	PLN 5.684	5	5	0,00
DUB	07.2024		7.197	KRW 9.889.443	0	(15)	0,00
FAR	07.2024	CNY	9.664	\$ 1.358	18	18	0,00
	07.2024	NZD	997	608	1	1	0,00
	07.2024	\$	9.020	AUD 13.538	21	21	0,00
	07.2024		139.978	€ 128.520	0	(2.237)	(0,01)
	07.2024		60.003	¥ 9.370.149	0	(1.753)	(0,01)
	07.2024		1.399	NZD 2.271	0	(15)	0,00
	08.2024		608	997	0	(1)	0,00
GLM	07.2024	€	25	\$ 27	0	0	0,00
	07.2024	MYR	12.270	2.608	7	7	0,00
	07.2024	\$	2.613	MYR 12.270	0	(12)	0,00
	08.2024		2.612	12.270	0	(8)	0,00
JPM	07.2024	CHF	2.958	\$ 3.296	4	4	0,00
	07.2024	CNY	409.973	57.484	619	619	0,00
	07.2024	DKK	5.517	792	0	(1)	0,00
	07.2024	\$	1.047	CNY 7.453	0	(13)	0,00
	07.2024		161	€ 151	0	0	0,00
	07.2024		1.522	SGD 2.048	0	(10)	0,00
	08.2024		3.296	CHF 2.947	0	(4)	0,00
	08.2024		57.484	CNY 410.232	0	(16)	0,00
	08.2024		792	DKK 5.508	1	0	0,00
MBC	07.2024	CAD	22.526	\$ 16.453	0	(10)	0,00
	07.2024	COP	2.969.063	712	0	(4)	0,00
	07.2024	€	479	518	4	4	0,00
	07.2024	¥	9.374.320	58.414	137	137	0,00
	07.2024	NOK	4.665	438	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2024	SEK	74	\$	7	\$	0	0,00
	07.2024	\$	13.236	CAD	18.022	\$	(65)	0,00
	07.2024		42	€	39		0	0,00
	07.2024		463	HUF	166.277		(12)	0,00
	07.2024		1.444	PLN	5.678		(31)	0,00
	08.2024		16.453	CAD	22.511		10	0,00
	08.2024		708	COP	2.969.063		5	0,00
	08.2024		57.068	¥	9.119.356		(109)	0,00
	08.2024		435	NOK	4.635		0	0,00
MYI	07.2024	CZK	26.383	\$	1.131		2	0,00
	07.2024	DKK	3.787		543		(2)	0,00
	07.2024	IDR	41.641.279		2.534		(10)	0,00
	07.2024	NOK	1.325		124		0	0,00
	07.2024	SEK	28.656		2.713		7	0,00
	07.2024	\$	18	CNY	131		0	0,00
	07.2024		1.149	CZK	26.323		(22)	0,00
	07.2024		106	€	99		0	0,00
	08.2024		1.131	CZK	26.372		(2)	0,00
	08.2024		543	DKK	3.780		2	0,00
	08.2024		2.534	IDR	41.668.649		12	0,00
	08.2024		124	NOK	1.324		0	0,00
	08.2024		2.713	SEK	28.611		(7)	0,00
RBC	07.2024	CAD	521	\$	380		(1)	0,00
	07.2024	£	19.083		24.200		76	0,00
	07.2024	\$	137	€	127		(2)	0,00
	08.2024		24.204	£	19.083		(76)	0,00
RYL	07.2024	€	181	\$	193		0	0,00
	07.2024	\$	1	DKK	9		0	0,00
SCX	07.2024	CHF	0	\$	0		0	0,00
	07.2024	€	128.412		137.589		(44)	0,00
	07.2024	\$	56.176	CNY	399.475		(767)	(0,01)
	08.2024		134.680	€	125.520		42	0,00
SSB	07.2024	€	293	\$	318		4	0,00
	07.2024	\$	1.727	CNY	12.290		(22)	0,00
	07.2024		659	MXN	11.040		(55)	0,00
TOR	07.2024	HUF	166.299	\$	448		(3)	0,00
	07.2024	NZD	756		463		2	0,00
	07.2024	\$	13	CHF	12		0	0,00
	07.2024		267	CLP	241.756		(11)	0,00
	08.2024		448	HUF	166.495		4	0,00
	08.2024		463	NZD	756		(2)	0,00
UAG	07.2024	THB	56.684	\$	1.539		(6)	0,00
	07.2024	\$	2.979	CHF	2.692		17	0,00
	07.2024		821	DKK	5.653		(9)	0,00
	08.2024		43	€	40		0	0,00
	08.2024		1.541	THB	56.684		7	0,00
						\$	1.140	
						\$	(5.963)	
						\$	(4.823)	
							(0,03)	

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2024	€	519	\$	566	\$	10	0,00
	07.2024	\$	1.290.215	€	1.188.374		(16.574)	(0,11)
BPS	07.2024	€	1.099.961	\$	1.176.548		20	(2,356)
	07.2024	\$	1.104.547	€	1.020.273		0	(11,070)
	08.2024		1.173.351		1.095.400		2.356	0,01
BRC	07.2024	€	2.604	\$	2.787		0	(5)
CBK	07.2024		1.149		1.233		1	0
	07.2024	\$	11.506	€	10.563		0	(185)
FAR	07.2024		1.259.077		1.156.014		0	(20.119)
GLM	07.2024		21.007		19.403		0	(211)
JPM	07.2024		1.916		1.790		3	0
MBC	07.2024	€	1.133.153	\$	1.211.686		4	(2.775)
	07.2024	\$	1.178	€	1.086		0	(14)
	08.2024		1.212.879		1.132.619		2.774	0
MYI	07.2024		387		361		0	0
RBC	07.2024	€	253	\$	274		4	0
RYL	07.2024		42.958		45.956		0	(85)
SCX	07.2024		1.132.305		1.213.151		0	(397)
	07.2024	\$	911	€	848		0	(2)
	08.2024		1.214.935		1.132.305		382	0
SSB	07.2024		15.392		14.189		0	(185)
UAG	08.2024		279		261		1	0
						\$	5.555	
						\$	(53.978)	
						\$	(48.423)	
							(0,32)	

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) thesaurierend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens		
BPS	07.2024	£	114.448	\$	144.720	\$ 47	0,00		
	07.2024	\$	290.833	£	228.225	0	(0,01)		
	08.2024		144.744		114.448	0	0,00		
BRC	07.2024	£	55	\$	70	1	0,00		
CBK	07.2024		513		652	3	0,00		
	07.2024	\$	3.410	£	2.680	0	(22)		
	08.2024		40		32	0	0		
DUB	07.2024		151.322		118.593	0	(1.409)		
MBC	07.2024	£	117.883	\$	149.145	130	0		
	07.2024	\$	1.316	£	1.038	0	(4)		
	08.2024		149.170		117.883	0	(128)		
RBC	07.2024	£	117.825	\$	149.414	471	0		
	08.2024	\$	149.439	£	117.825	0	(470)		
RYL	07.2024		241		188	0	(3)		
						\$ 652	\$ (4.414)	\$ (3.762)	(0,02)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional NOK (Hedged) thesaurierend, Investor NOK (Hedged) thesaurierend und W Class NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens		
BOA	07.2024	NOK	587	\$	55	\$ 0	0,00		
BRC	07.2024		53		5	0	0,00		
	07.2024	\$	77.018	NOK	810.259	0	(920)		
CBK	07.2024	NOK	336	\$	32	0	0,00		
	07.2024	\$	76.628	NOK	807.757	0	(765)		
MBC	07.2024	NOK	635.970	\$	59.703	2	(28)		
	07.2024	\$	1.382	NOK	14.520	0	(18)		
	08.2024		59.570		634.067	28	0		
MYI	07.2024	NOK	810.493	\$	76.021	0	(99)		
	07.2024	\$	70.661	NOK	744.788	0	(711)		
	08.2024		76.021		809.847	99	0		
RYL	07.2024	NOK	36.481	\$	3.462	36	0		
	07.2024	\$	2.984	NOK	31.712	2	(8)		
SCX	07.2024		38		406	0	0		
						\$ 167	\$ (2.549)	\$ (2.382)	(0,02)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens		
AZD	07.2024	NZD	13.298	\$	8.144	\$ 41	0,00		
	07.2024	\$	24.843	NZD	40.487	0	(172)		
	08.2024		8.144		13.298	0	(40)		
BOA	07.2024		22.755		37.266	0	(47)		
CBK	07.2024	NZD	256	\$	157	1	0,00		
FAR	07.2024		38.830		23.682	21	0		
	07.2024	\$	24.902	NZD	40.419	0	(273)		
	08.2024		23.682		38.830	0	(21)		
JPM	07.2024		6		10	0	0		
	08.2024		23.553		38.648	0	(3)		
MYI	07.2024	NZD	4.961	\$	3.039	16	0,00		
RYL	07.2024		296		183	2	0,00		
	08.2024		107		65	0	0		
SCX	07.2024	\$	247	NZD	401	0	(2)		
TOR	07.2024	NZD	12.925	\$	7.917	41	0		
	08.2024	\$	7.917	NZD	12.925	0	(41)		
						\$ 122	\$ (599)	\$ (477)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2024	SEK	1.010	\$	97	\$ 1	0,00
BPS	07.2024		149		14	0	0,00
BRC	07.2024		173.909		16.409	0	(13)
	08.2024	\$	16.409	SEK	173.643	12	0
CBK	07.2024	SEK	801	\$	76	1	0,00
	07.2024	\$	16.455	SEK	174.704	42	0
DUB	07.2024	SEK	156.386	\$	14.776	9	0,00
	08.2024	\$	14.776	SEK	156.146	0	(9)
MBC	07.2024	SEK	589	\$	56	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 15.893	SEK 166.907	\$ 0	\$ (132)	\$ (132)	0,00
	08.2024	2	26	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	SEK 174.537	\$ 16.524	43	0	43	0,00
	08.2024	\$ 16.524	SEK 174.268	0	(44)	(44)	0,00
RYL	07.2024	SEK 520	\$ 50	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 15.878	SEK 166.948	0	(113)	(113)	0,00
SCX	07.2024	SEK 439	\$ 42	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	174	17	0	0	0	0,00
				\$ 110	\$ (311)	\$ (201)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II und W Class SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 239.048	\$ 176.120	\$ 0	\$ (266)	\$ (266)	0,00
	07.2024	\$ 164.497	SGD 222.019	1	(677)	(676)	0,00
	08.2024	176.120	238.696	267	0	267	0,00
BPS	07.2024	SGD 240.072	\$ 177.012	0	(130)	(130)	0,00
	08.2024	\$ 177.012	SGD 239.725	136	0	136	0,00
BRC	07.2024	418	564	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2024	4.176	5.633	0	(20)	(20)	0,00
GLM	07.2024	SGD 1.948	\$ 1.442	5	0	5	0,00
	07.2024	\$ 391	SGD 528	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07.2024	178.562	240.340	0	(1.222)	(1.222)	(0,01)
MBC	07.2024	SGD 10.631	\$ 7.863	19	0	19	0,00
	07.2024	\$ 913	SGD 1.231	0	(5)	(5)	0,00
MYI	07.2024	97	131	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	178.503	240.525	0	(1.026)	(1.026)	(0,01)
				\$ 428	\$ (3.349)	\$ (2.921)	(0,02)

Summe Freiverkehrsfinaiznderivate

\$ 177.856 1,17

#### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Ginnie Mae, TBA			
3,000 % fällig am 01.07.2054	\$ 36.800	\$ (32.068)	(0,21)
4,000 % fällig am 01.07.2054	7.500	(6.931)	(0,05)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2039	276.200	(242.754)	(1,58)
2,000 % fällig am 01.07.2054	866.150	(677.559)	(4,42)
2,000 % fällig am 01.08.2054	166.900	(130.684)	(0,85)
3,000 % fällig am 01.08.2054	404.100	(344.116)	(2,24)
3,500 % fällig am 01.07.2054 (e)	103.000	(91.171)	(0,59)
4,000 % fällig am 01.07.2054 (e)	133.000	(121.711)	(0,79)
4,000 % fällig am 01.08.2054	11.400	(10.438)	(0,07)
5,500 % fällig am 01.07.2054	91.800	(90.549)	(0,59)
5,500 % fällig am 01.08.2054	18.500	(18.245)	(0,12)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (1.766.226)	(11,51)
Summe Anlagen		\$ 16.654.796	108,55
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.311.737)	(8,55)
Nettovermögen		\$ 15.343.059	100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Zum 30. Juni 2024 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(f) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 3.552 USD (31. Dezember 2023: 2.151 USD) und Barmittel in Höhe von 2.576 USD (31. Dezember 2023: 323 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Barmittel in Höhe von 440.445 USD (31. Dezember 2023: 394.447 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 84.080 USD (31. Dezember 2023: 103.060 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 16.115.634	\$ 65.839	\$ 16.181.473
Investmentfonds	1.173.294	362.837	0	1.536.131
Pensionsgeschäfte	0	582.002	0	582.002
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2.293	119.123	0	121.416
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(1.766.226)	0	(1.766.226)
Summen	\$ 1.175.587	\$ 15.413.370	\$ 65.839	\$ 16.654.796

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 14.901.954	\$ 33.617	\$ 14.935.571
Investmentfonds	875.438	435.751	0	1.311.189
Pensionsgeschäfte	0	371.917	0	371.917
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(50.364)	56.030	0	5.666
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(930.028)	0	(930.028)
Summen	\$ 825.074	\$ 14.835.624	\$ 33.617	\$ 15.694.315

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swapvereinbarungen, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten	
					Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,500 %	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (455)	\$ (488)	0,00
	5,300	26.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (1.911)	(1.947)	(0,01)
MEI	0,500	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.001)	(1.073)	(0,01)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (3.508)	(0,02)

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (9.999)	\$ 550	\$ (9.449)	\$ (4.504)	\$ 5.510	\$ 1.006
BOA	(14.087)	14.990	903	(10.306)	9.930	(376)
BPS	67.609	(29.600)	38.009	(14.522)	19.830	5.308
BRC	40.201	(25.770)	14.431	(61.368)	56.470	(4.898)
CBK	59.611	4.430	64.041	10.530	(12.210)	(1.680)
DUB	7.250	(6.880)	370	(1.810)	1.710	(100)
FAR	(60.358)	60.580	222	(358)	0	(358)
GLM	(3.421)	2.220	(1.201)	5.715	(7.530)	(1.815)
GST	24.727	(1.010)	23.717	(88)	710	622
IND	405	0	405	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	16.435	(16.550)	(115)	392	(910)	(518)
MBC	39.606	(38.630)	976	35.995	(42.350)	(6.355)
MYC	(4.529)	940	(3.589)	(1.021)	1.360	339
MYI	2.492	(2.480)	12	(3.178)	1.180	(1.998)
RBC	(59)	70	11	6	0	6
RYL	(314)	300	(14)	8	0	8
SCX	10.483	(10.950)	(467)	(6.224)	6.360	136
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	19	0	19
SSB	(122)	0	(122)	926	(800)	126
TOR	153	(430)	(277)	1.353	(1.250)	103
UAG	1.773	(1.730)	43	4.837	(4.470)	367

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	50,22	67,03
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	53,33	47,18
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,91	0,00
Investmentfonds	9,99	10,03
Pensionsgeschäfte	3,80	2,84
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	(0,55)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,34)	0,92
Freiverkehrsfinanzderivate	1,17	(0,33)
Leerverkaufte Wertpapiere	(11,51)	(7,11)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,02)	0,00

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	0,59	1,56
Belgien	0,19	k. A.
Kanada	3,35	1,31
Cayman-Inseln	1,99	1,95
Chile	0,09	k. A.
China	0,06	0,07
Tschechische Republik	0,00	0,00
Dänemark	2,77	2,02
Finnland	0,01	0,01
Frankreich	3,04	2,14
Deutschland	0,70	1,35
Ungarn	0,33	0,18
International	0,18	0,21
Irland	3,83	4,97
Israel	1,26	1,20
Italien	0,94	1,01
Japan	4,70	7,62
Jersey, Kanalinseln	0,07	0,08
Luxemburg	0,30	0,51
Malaysia	0,71	0,83
Mexiko	0,05	0,06
Multinational	0,06	0,08
Niederlande	1,08	0,59
Neuseeland	0,10	0,14
Norwegen	0,38	0,20
Peru	0,11	0,14
Polen	0,42	0,28
Portugal	0,02	0,02
Katar	0,08	0,08
Rumänien	0,90	0,78
Saudi-Arabien	0,84	0,68
Singapur	0,93	0,14
Slowenien	k. A.	0,18
Südkorea	2,42	3,32
Spanien	0,98	0,70
Supranational	0,41	0,08
Schweden	k. A.	0,00
Schweiz	1,40	1,08
Thailand	k. A.	0,23
Vereinigte Arabische Emirate	0,05	0,06
Großbritannien	6,16	5,89
USA	62,37	53,69
Kurzfristige Instrumente	1,59	18,77
Investmentfonds	9,99	10,03
Pensionsgeschäfte	3,80	2,84
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,02)	(0,55)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	(0,08)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,03)	0,14
Zinsswaps	(0,31)	0,86
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,03	k. A.
Zinsswapoptionen	0,09	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,08	0,08
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,14)	(0,19)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,84	0,01
Zinsswaps	0,01	0,01
Devisenterminkontrakte	0,65	(0,89)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,39)	0,63
Leerverkaufte Wertpapiere	(11,51)	(7,11)
Sonstige Aktiva und Passiva	(8,55)	(20,01)
Nettovermögen	100,00	100,00









## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	
								Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,380 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 21.400	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 15.05.2025	\$ (21.838)	\$ 21.400	\$ 21.410	0,55
	5,390	28.06.2024	01.07.2024	121.500	U.S. Treasury Notes 1,000 % fällig am 31.07.2028	(123.870)	121.500	121.555	3,12
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	1.176	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(1.200)	1.176	1.176	0,03
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (146.908)	\$ 144.076	\$ 144.141	3,70

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	2.570	\$ 2.792	0,07
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2024	597	(671)	(0,02)
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2025	1.285	(1.131)	(0,03)
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2024	25	6	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	396	(1)	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	397	225	0,01
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	1.111	(1.065)	(0,03)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	417	(517)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2024	706	(15)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	814	1.188	0,03
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	14	(46)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	275	(95)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	281	(140)	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	322	1.011	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	2.393	(990)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	234	(154)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	311	(462)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	627	(555)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	175	393	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	1.111	(895)	(0,02)
				\$ (1.122)	(0,03)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (1.122)	(0,03)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000 %	17.06.2027	£ 95.700	\$ (1.852)	(0,05)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000	17.06.2035	20.700	1.249	0,03
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	219.100	(4.111)	(0,11)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	18.300	(946)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	182.900	(1.989)	(0,05)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	18.09.2029	INR 3.004.550	(30)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	18.09.2029	458.420	7	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	¥ 1.500.000	(206)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	1.981.000	(248)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	430.000	212	0,01
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	505.230	(233)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,600	18.09.2029	22.340.800	(253)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	18.09.2034	15.500.000	(366)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,500	18.09.2054	1.760.000	(31)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	18.09.2029	SGD 242.790	1.254	0,03
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,250	18.09.2029	THB 3.478.600	1.175	0,03
Erhalt	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,418	17.04.2029	832.900	6	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	18.09.2029	3.777.800	(435)	(0,01)
Erhalt	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,750	18.09.2034	398.370	19	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,684	30.04.2025	\$ 900	13	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,696	30.04.2025	900	13	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,710	30.04.2025	1.000	15	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,714	30.04.2025	1.900	28	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,310	16.01.2025	76.400	(2.086)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,697	04.04.2025	9.300	(161)	0,00



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750 %	16.06.2031	AUD	6.450	\$ 0	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033		141.900	(495)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032		5.700	(22)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033		40.300	(974)	(0,03)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,335	25.09.2024		246.000	20	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032		233.470	615	0,01
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	19.06.2034		45.100	(104)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033		164.500	1.959	0,05
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK	7.400	12	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€	600	84	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052		1.300	197	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2036		1.400	(112)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027		6.000	(227)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027		4.300	(155)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027		3.300	(129)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027		7.200	(304)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027		3.500	(147)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037		11.890	(456)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042		6.060	(930)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054		90.300	3.997	0,10
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,670	03.04.2034		5.000	101	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029		184.700	(2.859)	(0,07)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034		221.500	(5.503)	(0,14)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2039		11.700	(169)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029		20.200	(105)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,801	25.05.2033		15.100	(24)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029		13.700	(38)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,833	15.08.2033		17.700	(69)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,841	25.05.2033		5.300	(26)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,849	15.08.2033		24.200	(128)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,857	15.08.2033		69.300	(408)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029		19.300	96	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026		210.400	(1.667)	(0,04)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027		136.070	(500)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033		58.910	(174)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,535	18.09.2025		133.100	(1.285)	(0,03)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,536	18.09.2025		34.600	(334)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN	20.400	32	0,00
						\$ (11.120)	(0,29)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (11.120)	(0,29)

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEIVENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH	7,275	06.12.2024	300	\$ 36	\$ 76	0,00
	Call - OTC USD versus CNH		7,325	06.12.2024	510	64	98	0,00
	Call - OTC USD versus CNH		7,400	06.12.2024	730	66	104	0,01
	Call - OTC USD versus CNH		7,325	14.01.2025	650	63	107	0,00
	Call - OTC USD versus CNH		7,400	14.01.2025	720	57	90	0,00
	Call - OTC USD versus CNH		7,400	23.01.2025	660	63	84	0,00
BRC	Call - OTC USD versus CNH		7,300	14.02.2025	300	32	46	0,00
	Call - OTC USD versus CNH		7,300	14.01.2025	660	69	123	0,01
MBC	Call - OTC USD versus CNH		7,450	14.02.2025	660	63	75	0,00
	Call - OTC USD versus CNH		7,350	06.12.2024	900	87	164	0,01
SCX	Call - OTC USD versus CNH		7,375	14.02.2025	760	75	104	0,00
	Call - OTC USD versus CNH		7,300	14.02.2025	240	24	36	0,00
						\$ 699	\$ 1.107	0,03

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750 %	15.07.2024	384.700	\$ 769	\$ 946	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,930	23.06.2025	14.900	536	658	0,02
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,005	25.09.2025	33.300	1.223	1.525	0,04
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,960	25.06.2025	4.300	161	183	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,005	25.09.2025	4.200	175	192	0,01
							\$ 2.864	\$ 3.504	0,09

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97.000	23.05.2025	2.200	\$ 166	\$ 1.058	0,03

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250 %	15.07.2024	384.700	\$ (385)	\$ (14)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	23.06.2025	57.300	(544)	(632)	(0,02)
BPS	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	2.200	(166)	(877)	(0,02)
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	25.09.2025	128.100	(1.230)	(1.454)	(0,04)
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689	15.07.2024	29.500	(61)	(13)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	29.500	(61)	(69)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,280	25.06.2025	16.600	(166)	(177)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,330	25.09.2025	16.200	(178)	(199)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	20.700	(75)	(37)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	20.700	(75)	(135)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	20.100	(142)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	13.900	(54)	(25)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	13.900	(54)	(74)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,800	03.07.2024	13.500	(55)	(17)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,150	03.07.2024	13.500	(55)	(1)	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	26.500	(42)	(62)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	26.500	(42)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	7.400	(19)	(15)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	7.400	(27)	(20)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	7.400	(27)	(42)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	7.400	(19)	(32)	0,00
							\$ (3.477)	\$ (3.906)	(0,10)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.06.2029	\$ 6.900	\$ (202)	\$ 4	\$ (198)	(0,01)
MYC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	7.100	(207)	3	(204)	(0,01)
					\$ (409)	\$ 7	\$ (402)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 1.700	\$ (41)	\$ 55	\$ 14	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.100	(27)	36	9	0,00
					\$ (68)	\$ 91	\$ 23	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 14.600	\$ 11.000	\$ 72	\$ (1.359)	\$ (1.287)	(0,03)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BPS	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,591 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026	\$ 25.027	¥ 3.699.000	\$ (278)	\$ 2.334	\$ 2.056	0,05
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,605 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	19.03.2026	88.950	13.051.600	(286)	8.170	7.884	0,20
BRC	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,590 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026	22.713	3.179.800	1.205	1.761	2.966	0,08
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,600 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	21.01.2026	55.754	7.766.600	2.899	4.628	7.527	0,19
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,586 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026	24.784	3.655.600	(225)	2.306	2.081	0,05
	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	AUD 5.100	\$ 3.519	(1)	(98)	(99)	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	5.000	3.450	(10)	(87)	(97)	0,00
GST	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,610 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	21.01.2026	\$ 47.057	¥ 6.555.000	2.900	3.457	6.357	0,16
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,605 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	19.03.2026	83.347	12.200.400	1.062	6.506	7.568	0,19
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	AUD 10.100	\$ 7.256	44	(573)	(529)	(0,01)
						\$ 7.382	\$ 27.045	\$ 34.427	0,88

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BPS	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750 %	18.09.2029	MYR 19.090	\$ (13)	\$ (7)	\$ (20)	0,00
CBK	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	10.590	14	1	15	0,00
	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2034	11.640	22	3	25	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2029	139.860	185	(35)	150	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	20.09.2033	59.060	374	(292)	82	0,00
JPM	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	10.520	14	1	15	0,00
SCX	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2034	10.300	21	1	22	0,00
						\$ 617	\$ (328)	\$ 289	0,01

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.









Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2024	CAD 1.134	\$ 828	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2024	COP 87.533	\$ 21	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 981	1.242	1	0	1	0,00
	07.2024	¥ 464.388	2.892	5	0	5	0,00
	07.2024	NOK 122	11	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 3	0	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 818	CAD 1.115	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	1.240	£ 974	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	13	HUF 4.836	0	0	0	0,00
	07.2024	0	ILS 0	0	0	0	0,00
	07.2024	2.974	¥ 465.180	0	(82)	(82)	0,00
	07.2024	53	PLN 208	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	828	CAD 1.133	1	0	1	0,00
	08.2024	21	COP 87.533	0	0	0	0,00
	08.2024	1.242	£ 981	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	2.892	¥ 462.214	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	11	NOK 121	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	15	CAD 21	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	0	DKK 0	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	€ 6.506	\$ 6.970	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	\$ 1	CHF 1	0	0	0	0,00
	07.2024	2.790	CNY 19.839	0	(38)	(38)	0,00
	07.2024	7	DKK 48	0	0	0	0,00
	07.2024	83	€ 77	0	0	0	0,00
	07.2024	58	SGD 78	0	0	0	0,00
	08.2024	6.981	€ 6.506	2	0	2	0,00
SSB	07.2024	47	CNY 334	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	1	£ 1	0	0	0	0,00
	07.2024	8	IDR 127.631	0	0	0	0,00
	07.2024	27	MXN 449	0	(2)	(2)	0,00
TOR	07.2024	HUF 4.841	\$ 13	0	0	0	0,00
	07.2024	NZD 21	13	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 3	CLP 2.836	0	0	0	0,00
	07.2024	334	KRW 458.457	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	13	HUF 4.847	0	0	0	0,00
	08.2024	13	NZD 21	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	CHF 137	\$ 152	0	0	0	0,00
	07.2024	CZK 891	38	0	0	0	0,00
	07.2024	THB 3.724	101	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 138	CHF 124	1	0	1	0,00
	07.2024	29	DKK 200	0	0	0	0,00
	07.2024	19	RON 86	0	0	0	0,00
	08.2024	152	CHF 136	0	0	0	0,00
	08.2024	38	CZK 890	0	0	0	0,00
	08.2024	101	THB 3.724	0	0	0	0,00
				\$ 18	\$ (256)	\$ (238)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 215	\$ 235	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	07.2024	\$ 476.402	€ 438.811	0	(6.106)	(6.106)	(0,16)
BPS	07.2024	€ 418.457	\$ 447.591	7	(897)	(890)	(0,02)
	07.2024	\$ 413.551	€ 381.994	0	(4.149)	(4.149)	(0,11)
	08.2024	446.648	416.975	898	0	898	0,02
CBK	07.2024	€ 2.113	\$ 2.266	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 497	€ 457	0	(8)	(8)	0,00
FAR	07.2024	458.919	421.353	0	(7.334)	(7.334)	(0,18)
GLM	07.2024	€ 82	\$ 89	1	0	1	0,00
JPM	07.2024	825	882	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2024	432.463	462.445	8	(1.055)	(1.047)	(0,03)
	07.2024	\$ 84	€ 78	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	461.005	430.498	1.056	0	1.056	0,03
RBC	07.2024	642	591	0	(9)	(9)	0,00
RYL	07.2024	38.714	36.189	71	0	71	0,00
SCX	07.2024	€ 429.749	\$ 460.434	1	(151)	(150)	0,00
	08.2024	\$ 460.913	€ 429.565	145	0	145	0,01
SSB	07.2024	4.807	4.431	0	(58)	(58)	0,00
UAG	08.2024	688	643	2	0	2	0,00
				\$ 2.194	\$ (19.769)	\$ (17.575)	(0,44)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£	\$	63.854	\$	0	0,00
	07.2024	\$	£	240.212	0	(1.715)	(0,04)
	08.2024			80.757	0	(25)	0,00
BRC	07.2024			1.637	0	(19)	0,00
	07.2024	£	\$	624	6	0	0,00
CBK	07.2024	\$	£	4.178	0	(26)	0,00
	08.2024	£	\$	129	0	0	0,00
	07.2024			65.992	76	0	0,00
MBC	07.2024	\$	£	2.108	0	(6)	0,00
	08.2024			82.996	0	(71)	0,00
RBC	07.2024	£	\$	65.469	262	0	0,01
	08.2024	\$	£	83.035	0	(261)	(0,01)
RYL	07.2024			32	0	0	0,00
UAG	07.2024			1.291	0	(7)	0,00
				\$	\$	\$	
				370	(2.130)	(1.760)	(0,04)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2024	\$	NOK	2.192.680	\$	(2.488)	(0,06)
CBK	07.2024			224.591	0	(2.366)	(0,06)
MBC	07.2024	NOK	\$	1.742.882	0	(76)	0,00
	07.2024	\$	NOK	3.628	0	(47)	0,00
MYI	08.2024			163.613	77	0	0,00
	07.2024	NOK	\$	1.224.129	0	(150)	0,00
	07.2024	\$	NOK	174.413	0	(1.755)	(0,05)
RYL	08.2024			114.819	150	0	0,00
	07.2024	NOK	\$	686	1	0	0,00
	07.2024	\$	NOK	7.344	0	(72)	0,00
				\$	\$	\$	
				228	(6.954)	(6.726)	(0,17)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD	\$	8.266	\$	0	0,00
	07.2024	\$	NZD	14.694	0	(102)	(0,01)
	08.2024			5.062	0	(25)	0,00
BOA	07.2024			18.301	0	(52)	0,00
MBC	07.2024			9.835	0	(44)	0,00
RYL	07.2024			1	0	0	0,00
SCX	07.2024			182	0	(2)	0,00
TOR	07.2024	NZD	\$	8.035	25	0	0,00
	08.2024	\$	NZD	4.921	0	(25)	0,00
				\$	\$	\$	
				50	(250)	(200)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$	SEK	42	\$	(1)	0,00
BRC	07.2024	SEK	\$	188.693	0	(14)	0,00
	08.2024	\$	SEK	17.804	14	0	0,00
CBK	07.2024	SEK	\$	1.751	1	0	0,00
	07.2024	\$	SEK	15.826	40	0	0,00
GLM	07.2024			6	0	0	0,00
MBC	07.2024	SEK	\$	646	1	0	0,00
	07.2024	\$	SEK	15.312	0	(127)	(0,01)
	08.2024			225	0	0	0,00
MYI	07.2024	SEK	\$	188.580	47	0	0,00
	08.2024	\$	SEK	17.854	0	(47)	0,00
RYL	07.2024	SEK	\$	34	0	0	0,00
	07.2024	\$	SEK	15.455	0	(113)	0,00
SCX	07.2024	SEK	\$	6.463	5	0	0,00
	07.2024	\$	SEK	5.912	0	(66)	0,00
UAG	07.2024			67	0	(1)	0,00
				\$	\$	\$	
				108	(369)	(261)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 44.715 1,15

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2039	\$ 44.600	\$ (39.199)	(1,01)
2,000 % fällig am 01.07.2054	18.800	(14.707)	(0,38)
2,000 % fällig am 01.08.2054	259.750	(203.386)	(5,22)
2,500 % fällig am 01.08.2054	24.500	(20.030)	(0,51)
3,000 % fällig am 01.08.2054	96.000	(81.750)	(2,10)
3,500 % fällig am 01.07.2054 (d)	7.000	(6.196)	(0,16)
4,000 % fällig am 01.08.2054	48.400	(44.314)	(1,14)
5,500 % fällig am 01.08.2054	63.100	(62.230)	(1,60)
6,500 % fällig am 01.07.2054	53.718	(54.679)	(1,40)
6,500 % fällig am 01.08.2054	86.282	(87.772)	(2,26)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (614.263)</b>	<b>(15,78)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 3.848.239</b>	<b>98,85</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ 44.585</b>	<b>1,15</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 3.892.824</b>	<b>100,00</b>

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (d) Zum 30. Juni 2024 leerverkauftes Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (e) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 776 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 72.748 USD (31. Dezember 2023: 84.363 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 23.130 USD (31. Dezember 2023: 23.400 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 4.285.844	\$ 109	\$ 4.285.953
Pensionsgeschäfte	0	144.076	0	144.076
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(345)	32.818	0	32.473
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(614.263)	0	(614.263)
<b>Summen</b>	<b>\$ (345)</b>	<b>\$ 3.848.475</b>	<b>\$ 109</b>	<b>\$ 3.848.239</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.995.856	\$ 79	\$ 3.995.935
Pensionsgeschäfte	0	165.958	0	165.958
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(10.719)	85.024	0	74.305
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(277.758)	0	(277.758)
<b>Summen</b>	<b>\$ (10.719)</b>	<b>\$ 3.969.080</b>	<b>\$ 79</b>	<b>\$ 3.958.440</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,500 %	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (273)	\$ (293)	(0,01)
MYI	0,250	18.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(455)	(488)	(0,01)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (781)</b>	<b>(0,02)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (973)	\$ 0	\$ (973)	\$ 4.215	\$ (4.700)	\$ (485)
BOA	7.660	(8.480)	(820)	7.328	(7.150)	178
BPS	7.401	2.320	9.721	(6.163)	5.020	(1.143)
BRC	3.686	(580)	3.106	(16.941)	17.930	989
CBK	7.773	1.850	9.623	5.364	(5.430)	(66)
FAR	(14.581)	15.350	769	(34)	0	(34)
GLM	(1.264)	1.340	76	11.917	(11.610)	307
GST	6.391	(130)	6.261	12	140	152
JPM	15.445	(7.930)	7.515	1.887	(1.950)	(63)
MBC	12.512	(11.910)	602	7.534	(7.750)	(216)
MYC	(911)	310	(601)	(300)	310	10
MYI	(1.737)	1.960	223	6.573	(7.840)	(1.267)
RBC	49	0	49	1	0	1
RYL	(105)	0	(105)	498	(270)	228
SCX	353	(380)	(27)	(84)	(230)	(314)
SSB	(58)	0	(58)	499	(430)	69
TOR	1.696	(1.960)	(264)	(38)	0	(38)
UAG	1.378	(1.380)	(2)	23.903	(24.320)	(417)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	59,80	69,21
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	48,40	43,00
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,90	k. A.
Pensionsgeschäfte	3,70	4,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	(0,38)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,29)	1,17
Freiverkehrsfinanzderivate	1,15	1,30
Leerverkaufte Wertpapiere	(15,78)	(7,80)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,02)	k. A.

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	26,39	19,62
Kommunalanleihen und Wechsel	0,09	0,10
US-Regierungsbehörden	45,10	35,91
US-Schatzobligationen	8,62	6,43
Non-Agency-MBS	3,29	3,21
Forderungsbisicherte Wertpapiere	5,80	7,96
Staatsemissionen	20,01	18,36
Kurzfristige Instrumente	0,80	20,62
Pensionsgeschäfte	3,70	4,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,03)	(0,38)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,29)	1,17
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,03	k. A.
Zinsswapoptionen	0,09	0,03
Optionen auf Wertpapiere	0,03	0,03
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,10)	(0,09)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,02)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,00	0,00

<b>Anlagen zum Marktwert</b>	<b>30. Jun. 2024 (%)</b>	<b>31. Dez. 2023 (%)</b>
Cross-Currency Swaps	0,88	0,00
Zinsswaps	0,01	0,01
Devisenterminkontrakte	0,80	(0,75)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,57)	2,10
Leerverkaufte Wertpapiere	(15,78)	(7,80)
Sonstige Aktiva und Passiva	1,15	(11,16)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>AUSTRALIEN</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Bank of Queensland Ltd. 3,300 % fällig am 30.07.2029	€ 2.200	\$ 2.362	0,27	Venture CLO Ltd. 6,470 % fällig am 15.04.2027	\$ 2	\$ 1	0,00	2,000 % fällig am 01.10.2047 DKK	0	\$ 0	0,00
National Australia Bank Ltd. 3,146 % fällig am 05.02.2031	4.900	5.237	0,59	6,636 % fällig am 20.07.2030	1.892	1.895	0,22	2,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00
Westpac Banking Corp. 3,131 % fällig am 15.04.2031	2.700	2.877	0,32	Voya CLO Ltd. 6,800 % fällig am 15.10.2030	906	907	0,10	2,500 % fällig am 01.04.2036	0	0	0,00
		10.476	1,18			9.153	1,04	2,500 % fällig am 01.04.2047	0	0	0,00
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								<b>FINNLAND</b>			
Australia Government International Bond 1,000 % fällig am 21.12.2030 AUD	1.100	605	0,07					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
1,750 % fällig am 21.06.2051	1.300	481	0,05					SP-Kiinnitysluottopankki Oyj 3,250 % fällig am 02.05.2031			
2,500 % fällig am 21.05.2030	800	489	0,06					€ 800 860 0,10			
		1.575	0,18					<b>FRANKREICH</b>			
Summe Australien		12.051	1,36					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>BELGIEN</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Belfius Bank S.A. 2,875 % fällig am 12.02.2031	€ 1.800	1.895	0,22					BNP Paribas S.A. 4,095 % fällig am 13.02.2034			
ING Belgium S.A. 3,000 % fällig am 15.02.2031	1.500	1.595	0,18					1.900 2.051 0,23			
KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	\$ 800	806	0,09					5.497 % fällig am 20.05.2030			
		4.296	0,49					\$ 2.000 1.993 0,23			
Summe Belgien		4.296	0,49					Caisse de Refinancement de l'Habitat S.A. 2,875 % fällig am 25.03.2031			
								€ 2.300 2.419 0,27			
								Cie de Financement Foncier S.A. 3,000 % fällig am 24.04.2032			
								1.700 1.796 0,20			
								3.125 % fällig am 24.04.2027			
								3.000 3.210 0,36			
								3.125 % fällig am 06.06.2030			
								800 854 0,10			
								Credit Agricole Home Loan SFH S.A. 3,000 % fällig am 01.12.2030			
								1.200 1.272 0,15			
								Societe Generale S.A. 3,337 % fällig am 21.01.2033			
								\$ 2.100 1.742 0,20			
								15.337 1,74			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Agence Francaise de Developpement 1,125 % fällig am 02.03.2037			
								€ 2.900 2.316 0,26			
								France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.05.2072			
								900 338 0,04			
								0,750 % fällig am 25.05.2052			
								8.100 4.343 0,49			
								2,000 % fällig am 25.05.2048			
								6.700 5.319 0,60			
								3,000 % fällig am 25.06.2049			
								4.200 4.037 0,46			
								3,250 % fällig am 25.05.2045			
								200 203 0,02			
								16.556 1,87			
								Summe Frankreich			
								31.893 3,61			
								<b>DEUTSCHLAND</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Deutsche Bank AG 0,050 % fällig am 20.11.2024			
								4.900 5.179 0,58			
								1,375 % fällig am 17.02.2032			
								1.500 1.341 0,15			
								1,625 % fällig am 20.01.2027			
								600 609 0,07			
								1,750 % fällig am 19.11.2030			
								1.000 943 0,11			
								8.072 0,91			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Bundesrepublik Deutschland 2,300 % fällig am 15.02.2033			
								900 954 0,11			
								Summe Deutschland			
								9.026 1,02			
								<b>UNGARN</b>			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Hungary Government International Bond 4,000 % fällig am 25.07.2029			
								1.000 1.063 0,12			
								6,250 % fällig am 22.09.2032			
								\$ 1.000 1.033 0,12			
								Magyar Export-Import Bank 6,000 % fällig am 16.05.2029			
								€ 700 790 0,09			
								Summe Ungarn			
								2.886 0,33			
								<b>IRLAND</b>			
								<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
								Accunia European CLO DAC 4,856 % fällig am 15.07.2030			
								287 307 0,03			
								Armada Euro CLO DAC 4,626 % fällig am 15.07.2031			
								705 755 0,09			
								Aurium CLO DAC 4,653 % fällig am 16.01.2031			
								2.093 2.243 0,25			
								Black Diamond CLO DAC 4,808 % fällig am 15.05.2032			
								2.104 2.257 0,26			
								Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.01.2025			
								3.700 525 0,06			
								1,000 % fällig am 01.10.2050			
								0 0 0,00			







## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
4,168 % fällig am 25.09.2036	\$ 127	\$ 107	0,01	3,000 % fällig am 01.04.2043 - 01.06.2051	\$ 1.781	\$ 1.520	0,17	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
4,171 % fällig am 25.02.2037	594	525	0,06	3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.07.2050	1.343	1.221	0,14	<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
4,343 % fällig am 25.06.2037	93	77	0,01	4,000 % fällig am 01.06.2050	638	591	0,07	Intercontinental Exchange, Inc.			
4,448 % fällig am 27.02.2034	6	5	0,00	4,500 % fällig am 01.06.2053	0	0	0,00	5,500 % fällig am 03.07.2024	\$ 1.050	\$ 1.049	0,12
6,031 % fällig am 25.03.2034	1	1	0,00	5,500 % fällig am 01.06.2053 - 01.10.2053	20.556	20.295	2,29	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.			
6,080 % fällig am 25.01.2045	12	12	0,00	6,500 % fällig am 01.10.2053 - 01.04.2054	109.859	111.893	12,65	5,570 % fällig am 08.07.2024	2.350	2.347	0,26
6,153 % fällig am 25.02.2046	176	153	0,02	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				Parker-Hannifin Corp.			
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				4,000 % fällig am 01.08.2054	2.100	1.923	0,22	5,520 % fällig am 27.08.2024	500	495	0,06
6,093 % fällig am 25.07.2046	74	44	0,00	4,500 % fällig am 01.07.2054	55.500	52.328	5,92	Penske Truck Leasing Co. LP			
		17.484	1,98	5,000 % fällig am 01.07.2054 - 01.09.2054	71.500	69.111	7,82	5,500 % fällig am 09.07.2024	1.750	1.747	0,20
				6,000 % fällig am 01.08.2054	49.800	49.923	5,65				
				6,500 % fällig am 01.07.2054	6.700	6.820	0,77	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				5,000 % fällig am 01.07.2054 - 01.09.2054	347.906	39.34		0,004 % fällig am 17.09.2024 (b)(c)	¥ 2.250.000	13.987	1,58
Fannie Mae				6,000 % fällig am 01.07.2054				0,018 % fällig am 05.08.2024 (b)(c)	3.030.000	18.836	2,13
2,944 % fällig am 25.07.2039	315	278	0,03	<b>US-SCHATZobligationen</b>				0,136 % fällig am 20.06.2025 (b)(c)	59.000	366	0,04
3,000 % fällig am 01.03.2060	695	588	0,07	U.S. Treasury Bonds				0,140 % fällig am 20.06.2025 (b)(c)	11.000	68	0,01
3,500 % fällig am 01.01.2059	1.529	1.344	0,15	1,625 % fällig am 15.11.2050	400	219	0,02	0,155 % fällig am 21.04.2025 (b)(c)	397.000	2.466	0,28
5,558 % fällig am 25.03.2034	2	2	0,00	4,000 % fällig am 15.11.2052	200	182	0,02	0,166 % fällig am 21.04.2025 (b)(c)	373.000	2.317	0,26
5,588 % fällig am 25.08.2034	1	1	0,00	4,250 % fällig am 15.02.2054	2.600	2.476	0,28	0,188 % fällig am 20.05.2025 (b)(c)	40.000	248	0,03
5,608 % fällig am 01.12.2034	7	7	0,00	4,625 % fällig am 15.05.2054	300	304	0,03	0,203 % fällig am 20.05.2025 (b)(c)	90.000	559	0,06
5,850 % fällig am 25.06.2036	15	15	0,00	4,750 % fällig am 15.11.2043	5.200	5.271	0,60				
5,950 % fällig am 25.10.2040	34	33	0,00	4,750 % fällig am 15.11.2053	3.400	3.516	0,40	Summe kurzfristige Instrumente			44.485
6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044	72	73	0,01	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 976.516	110,43	
6,165 % fällig am 25.03.2036	3	3	0,00	0,125 % fällig am 15.04.2025	5.765	5.609	0,64	<b>AKTIEN</b>			
6,314 % fällig am 01.09.2044	36	36	0,00	0,125 % fällig am 15.07.2031	3.041	2.672	0,30	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
6,413 % fällig am 01.11.2034	34	35	0,00	0,125 % fällig am 15.01.2032	1.244	1.078	0,12	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Freddie Mac				0,250 % fällig am 15.01.2025	8.604	8.426	0,95	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	3.652.831	36.403	4,11
0,553 % fällig am 15.01.2038 (a)	227	13	0,00	0,500 % fällig am 15.01.2028	6.736	6.349	0,72	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (e)	402.852	5.548	0,63
5,793 % fällig am 15.01.2038	227	226	0,03	0,625 % fällig am 15.07.2032	432	387	0,04	Summe Investmentfonds	\$ 41.951	4,74	
6,021 % fällig am 01.09.2035	1	1	0,00	1,125 % fällig am 15.01.2033	5.578	5.163	0,58				
6,048 % fällig am 15.12.2037 - 15.07.2040	98	98	0,01	1,750 % fällig am 15.01.2028	599	589	0,07				
6,353 % fällig am 25.10.2044 - 25.02.2045	151	139	0,02	2,375 % fällig am 15.01.2025	1.497	1.484	0,17				
6,450 % fällig am 25.05.2043	17	18	0,00	2,375 % fällig am 15.01.2027	777	777	0,09				
Ginnie Mae				2,500 % fällig am 15.01.2029	5.257	5.350	0,61				
3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.12.2052	22.008	19.188	2,17	3,875 % fällig am 15.04.2029	1.716	1.854	0,21				
5,983 % fällig am 20.05.2074	987	985	0,11	U.S. Treasury Notes							
6,263 % fällig am 20.01.2074	903	909	0,10	3,500 % fällig am 15.02.2033	600	562	0,06				
Ginnie Mae, TBA				4,000 % fällig am 15.02.2034	5.200	5.049	0,57				
2,500 % fällig am 01.08.2054	4.200	3.534	0,40	4,500 % fällig am 15.11.2033	7.400	7.470	0,85				
3,000 % fällig am 01.08.2054	3.000	2.616	0,30	Summe USA	64.787	7,33					
Uniform Mortgage-Backed Security					495.758	56,06					
2,500 % fällig am 01.02.2051 - 01.01.2052	2.613	2.139	0,24								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 510	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (520)	\$ 510	\$ 510	0,06
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (520)	\$ 510	\$ 510	0,06

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	512	\$ 557	0,06
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2024	103	(117)	(0,01)
3-Month SOFR September Futures	Long	12.2025	256	(225)	(0,03)
Australia Government 3-Year Note September Futures	Long	09.2024	45	(10)	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	72	0	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	101	55	0,01
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	7	(9)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	260	(323)	(0,04)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	215	319	0,04

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	14	\$ 46	0,01
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	20	(12)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	49	(24)	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	12	80	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	47	(29)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	979	(741)	(0,08)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	90	(63)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	121	(42)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	165	(42)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	9	0	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	218	(127)	(0,02)
				\$ (707)	(0,08)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (707)	(0,08)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ (4)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 10-Year Index	(1,000) %	20.06.2033	\$ 6.600	\$ (153)	(0,02)
CDX.IG-41 10-Year Index	(1,000)	20.12.2033	17.500	(266)	(0,03)
CDX.IG-42 10-Year Index	(1,000)	20.06.2034	33.400	57	0,01
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	(1,000)	20.06.2029	€ 27.300	78	0,01
				\$ (284)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 1.000	\$ 7	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	12.300	(6)	0,00
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	130.200	(97)	(0,01)
				\$ (96)	(0,01)

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000 %	17.06.2027	£ 21.900	\$ (424)	(0,05)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,000	17.06.2035	4.700	284	0,03
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	51.800	(953)	(0,11)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	4.200	(154)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	44.500	(526)	(0,06)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	18.09.2029	INR 658.810	(7)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	18.09.2029	125.980	2	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	¥ 970.000	(11)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	10.000	(2)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	610.000	(159)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	851.000	(105)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	540.000	497	0,06
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.12.2051	80.000	(128)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	170.000	(70)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,550	14.09.2028	520.000	(6)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,600	18.09.2029	2.680.000	(50)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	640.000	(485)	(0,06)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850	20.09.2033	140.000	0	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	18.09.2034	2.660.000	(119)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,200	20.09.2053	240.000	5	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,500	18.09.2054	310.000	(5)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	18.09.2029	SGD 52.840	273	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,250	18.09.2029	THB 672.320	225	0,02
Erhalt	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,418	17.04.2029	190.000	1	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	18.09.2029	883.500	(104)	(0,01)
Erhalt	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,750	18.09.2034	93.170	5	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	\$ 26.260	(1.617)	(0,18)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,249 %	31.08.2024	\$ 11.650	\$ 345	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,298	25.08.2024	10.200	316	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,310	16.01.2025	31.500	(860)	(0,10)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,697	04.04.2025	3.400	(59)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,721	10.04.2025	900	(16)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,790	10.04.2025	2.800	(46)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	800	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	1.700	(32)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	1.900	(37)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	27.900	1.352	0,15
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	1.100	(20)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	700	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	800	(14)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	500	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	900	(15)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,150	13.05.2025	56.600	971	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	800	(13)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,200	13.05.2025	4.600	90	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	900	(14)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	20.590	(651)	(0,07)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2025	62.900	343	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	760	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	43.262	(519)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	5.900	(64)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	1.500	(22)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	1.900	(28)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,662	31.05.2028	4.700	93	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,691	31.05.2028	11.000	207	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	20.02.2049	5.000	140	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	3.000	(40)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	1.400	(19)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	14.800	131	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2026	29.200	(40)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	10.700	(223)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	14.600	293	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	58.600	(121)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	3.400	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,857	31.03.2030	3.600	(50)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	22.02.2029	1.200	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,951	31.03.2030	8.500	(68)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.06.2026	60.100	229	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.03.2054	3.200	244	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,159	31.03.2025	35.100	470	0,05
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,228	30.08.2025	11.700	77	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	119.651	1.447	0,16
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	04.10.2025	2.900	5	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,500	17.06.2030	CAD 9.200	85	0,01
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,500	16.06.2051	250	3	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,713	02.10.2029	2.100	2	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,900	18.12.2029	24.500	195	0,02
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	15.03.2028	9.640	1	0,00
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	15.03.2033	4.900	(15)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053	2.300	83	0,01
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,300	01.06.2033	14.700	10	0,00
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,400	01.06.2033	1.400	3	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	18.12.2025	78.200	(97)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	19.03.2026	23.200	(43)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	19.06.2026	54.600	46	0,01
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.06.2032	8.400	55	0,01
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.09.2033	7.000	(97)	(0,01)
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	18.06.2034	3.800	(11)	0,00
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,700	01.09.2033	3.000	(46)	(0,01)
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2033	4.700	(68)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,898	19.06.2026	21.100	45	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,925	19.06.2026	17.400	41	0,00
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 900	(20)	0,00
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	8.500	(172)	(0,02)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	1.900	(35)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	18.09.2029	CNY 885.290	1.126	0,13
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	18.09.2029	KRW 20.519.410	(19)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	18.09.2034	1.780.840	6	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	NZD 4.400	25	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,750	19.06.2029	5.900	0	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	5,000	20.03.2025	5.900	38	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 5.100	420	0,05
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	6.600	(313)	(0,04)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033	29.600	(109)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	1.900	(7)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	16.800	(403)	(0,05)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,335	25.09.2024	59.300	5	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	43.700	131	0,01
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	19.06.2034	9.100	(19)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750 %	20.12.2033	AUD 58.000	\$ 753	0,08	
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 24.300	(109)	(0,01)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 450	126	0,01	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	1.000	339	0,04	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	900	(11)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	2.400	(169)	(0,02)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	1.800	(120)	(0,01)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	1.400	(97)	(0,01)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	2.200	(132)	(0,02)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	1.300	(78)	(0,01)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	8.950	(693)	(0,08)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	1.260	(193)	(0,02)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	22.100	1.080	0,12	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,670	03.04.2034	300	6	0,00	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	101.440	(1.373)	(0,16)	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	105.200	(2.421)	(0,27)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2039	5.400	(78)	(0,01)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,801	25.05.2033	3.400	(5)	0,00	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,833	15.08.2033	4.600	(18)	0,00	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,841	25.05.2033	11.500	(56)	(0,01)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,849	15.08.2033	6.500	(34)	0,00	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,857	15.08.2033	16.900	(99)	(0,01)	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026	81.300	(559)	(0,06)	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	30.530	(105)	(0,01)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033	13.460	(43)	(0,01)	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN 86.100	(74)	(0,01)	
						\$ (3.249)	(0,37)
						\$ (3.633)	(0,41)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**OPTIONSKAUF****DEVISENOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BPS	Call - OTC USD versus CNH	7,275	06.12.2024	100	\$ 12	\$ 25	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	06.12.2024	170	16	24	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	14.01.2025	180	18	30	0,01	
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	14.01.2025	140	11	18	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	23.01.2025	120	11	15	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	190	20	29	0,00	
CBK	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.01.2025	120	13	22	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,450	14.02.2025	120	11	14	0,00	
MBC	Call - OTC USD versus CNH	7,350	06.12.2024	200	19	37	0,01	
	Call - OTC USD versus CNH	7,375	14.02.2025	230	23	31	0,01	
SCX	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	160	16	24	0,00	
							\$ 170	\$ 269

**ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750 %	15.07.2024	14.100	\$ 28	\$ 34	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,930	23.06.2025	3.400	122	150	0,02
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,005	25.09.2025	700	26	32	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750	10.07.2024	66.800	182	169	0,02
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,960	25.06.2025	4.600	159	196	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,005	25.09.2025	1.000	42	46	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,065	24.06.2025	3.100	93	114	0,01
							\$ 652	\$ 741	0,08

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	1.600	\$ 121	\$ 770	0,09

### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250 %	15.07.2024	14.100	\$ (14)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	23.06.2025	13.100	(124)	(144)	(0,02)
BPS	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	1.600	(121)	(638)	(0,07)
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	25.09.2025	2.700	(26)	(31)	(0,01)
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	3.300	(13)	(9)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	3.300	(13)	(16)	0,00
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250	10.07.2024	66.800	(100)	(2)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,280	25.06.2025	3.500	(35)	(37)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,300	25.06.2025	14.200	(125)	(148)	(0,02)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,330	25.09.2025	3.900	(43)	(48)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,400	24.06.2025	11.900	(93)	(109)	(0,01)
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,586	15.07.2024	2.000	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,986	15.07.2024	2.000	(7)	(11)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	1.600	(7)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	4.000	(14)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	4.000	(15)	(26)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	1.600	(7)	(10)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	8.700	(61)	(2)	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	2.900	(9)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	2.900	(9)	(14)	0,00
							\$ (843)	\$ (1.260)	(0,15)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
GST	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.06.2029	\$ 1.800	\$ (52)	\$ 1	\$ (51)	(0,01)
MYC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2029	1.700	(50)	1	(49)	0,00
					\$ (102)	\$ 2	\$ (100)	(0,01)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - Schutzverkauf<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 1.500	\$ (37)	\$ 49	\$ 12	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.000	(24)	32	8	0,00
					\$ (61)	\$ 81	\$ 20	0,00

(1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximale mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 5.900	\$ 4.445	\$ 29	\$ (550)	\$ (521)	(0,06)

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,591 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026	\$ 5.713	¥ 844.400	\$ (64)	\$ 533	\$ 469	0,05
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,605 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	19.03.2026	38.811	5.687.000	181	3.308	3.489	0,39
BRC	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,590 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026	4.808	673.100	255	373	628	0,07
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,600 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	21.01.2026	12.748	1.775.800	663	1.058	1.721	0,19
	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,586 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	03.02.2026	5.658	834.600	(51)	526	475	0,05
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	AUD 7.100	\$ 4.899	(2)	(136)	(138)	(0,01)
	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	7.000	4.830	(14)	(122)	(136)	(0,01)
GST	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,610 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	21.01.2026	\$ 10.831	¥ 1.508.700	668	795	1.463	0,17
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-BBR-BBSW zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	AUD 2.000	\$ 1.437	9	(114)	(105)	(0,01)
						\$ 1.674	\$ 5.671	\$ 7.345	0,83

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750 %	18.09.2029	MYR 2.690	\$ (2)	\$ (1)	\$ (3)	0,00
CBK	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	1.880	2	1	3	0,00
	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2034	2.560	5	0	5	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2029	33.850	45	(9)	36	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	20.09.2033	11.320	72	(56)	16	0,00
JPM	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	1.890	2	1	3	0,00
	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2034	30	0	0	0	0,00
SCX	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2034	2.260	5	0	5	0,00
						\$ 129	\$ (64)	\$ 65	0,01

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,144 %	\$ 15.480	20.12.2024	\$ 198	\$ (79)	\$ 119	0,01
JPM	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,144	10.320	20.09.2024	130	(163)	(33)	0,00
							\$ 328	\$ (242)	\$ 86	0,01

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD	\$ 594	\$ 363	\$ 2	\$ 2	0,00
	08.2024	\$	363	NZD 594	0	(2)	0,00
	10.2024		5.569	CNH 39.856	0	(63)	(0,01)
BOA	07.2024	€	1.761	\$ 1.895	8	0	0,00
	07.2024	KRW	14.059.434	10.277	66	0	0,01
	07.2024	\$	71	HUF 26.190	0	0	0,00
	07.2024		163	MYR 765	0	0	0,00
	07.2024		515	PLN 2.054	0	(4)	0,00
	02.2025	CNH	2.143	\$ 300	1	0	0,00
	04.2025	DKK	14.300	2.108	20	0	0,00
BPS	07.2024	AUD	715	473	0	(4)	0,00
	07.2024	BRL	3.497	695	66	0	0,01
	07.2024	CAD	390	286	1	0	0,00
	07.2024	CNH	652	90	1	0	0,00
	07.2024	€	7.517	8.109	52	0	0,01
	07.2024	£	42.260	53.983	562	0	0,06
	07.2024	KRW	13.996.093	10.197	32	0	0,00
	07.2024	\$	7.452	AUD 11.184	17	0	0,00
	07.2024		802	CNH 5.814	0	(5)	0,00
	07.2024		1.099	CNY 7.818	0	(3)	0,00
	07.2024		350	IDR 5.735.237	1	0	0,00
	07.2024		100	ILS 372	0	(2)	0,00
	07.2024		2.504	¥ 391.200	0	(73)	(0,01)
	07.2024		424	KRW 588.349	3	0	0,00
	07.2024		1.024	NZD 1.667	0	(8)	0,00
	07.2024		5.025	PLN 20.279	32	(13)	0,00
	07.2024		536	SEK 5.645	0	(3)	0,00
	07.2024		8.929	SGD 12.110	7	0	0,00
	08.2024	AUD	11.184	\$ 7.459	0	(17)	0,00
	08.2024	SGD	12.093	8.929	0	(7)	0,00
	09.2024	CNH	121.390	16.916	193	0	0,02
	09.2024	COP	2.354.236	588	26	0	0,00
	09.2024	INR	151.257	1.809	0	(1)	0,00
	09.2024	TWD	123.316	3.832	23	0	0,00
	09.2024	\$	7.668	CNH 54.865	0	(109)	(0,01)
	09.2024		753	INR 63.007	1	0	0,00
	09.2024		267	TWD 8.593	0	(2)	0,00
	10.2024	CNH	5.197	\$ 724	6	0	0,00
	10.2024	\$	6.794	CNH 48.649	0	(74)	(0,01)
	12.2024		640	4.590	0	(4)	0,00
	01.2025	CNH	3.086	\$ 432	3	0	0,00
	05.2029	KWD	630	2.167	62	0	0,01
BRC	07.2024	DKK	11.432	1.664	21	0	0,00
	07.2024	MXN	7.423	402	0	(4)	0,00
	07.2024	NOK	4.864	462	6	0	0,00
	07.2024	SGD	1.446	1.070	4	0	0,00
	07.2024	THB	318	9	0	0	0,00
	07.2024	\$	2.680	CHF 2.389	0	(21)	0,00
	07.2024		2.288	CNH 16.558	0	(19)	0,00
	07.2024		602	PLN 2.403	0	(4)	0,00
	09.2024	CNH	42.081	\$ 5.840	42	0	0,00
	09.2024	¥	2.250.000	14.549	398	0	0,04
	09.2024	MXN	5.937	318	0	(3)	0,00
	09.2024	\$	119	CLP 109.733	0	(3)	0,00
	09.2024		1.711	MXN 32.570	49	0	0,01
	10.2024	CNH	24	\$ 3	0	0	0,00
	10.2024	\$	623	CNH 4.499	0	(2)	0,00
	10.2024		3.418	¥ 514.997	0	(172)	(0,02)
	02.2025		300	CNH 2.142	0	(2)	0,00
	04.2025	¥	316.000	\$ 2.158	110	0	0,01
	05.2025		130.000	889	43	0	0,00
CBK	07.2024	CHF	1.357	1.492	0	(19)	0,00
	07.2024	CNH	29.918	4.127	27	0	0,00
	07.2024	CNY	281	39	1	0	0,00
	07.2024	COP	2.501.499	616	14	0	0,00
	07.2024	€	3.170	3.453	56	0	0,01
	07.2024	SEK	95.280	8.974	0	(23)	0,00
	07.2024	\$	3.010	BRL 16.401	0	(57)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 823	CNH 5.958	\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	0,00
	07.2024	9.486	CNY 67.531	0	(31)	(31)	0,00
	07.2024	1.093	DKK 7.595	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	3.031	£ 2.370	0	(35)	(35)	0,00
	07.2024	619	KRW 845.014	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	1.627	PLN 6.497	4	(15)	(11)	0,00
	08.2024	BRL 16.456	\$ 3.010	58	0	58	0,01
	08.2024	PEN 1.625	430	6	0	6	0,00
	09.2024	CNH 18.125	2.517	20	0	20	0,00
	09.2024	COP 1.830.578	456	20	0	20	0,00
	09.2024	INR 8.738	105	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 44.399	1.377	6	0	6	0,00
	09.2024	\$ 218	CLP 198.648	0	(7)	(7)	0,00
	09.2024	4.125	INR 344.871	4	(2)	2	0,00
	09.2024	1.373	MXN 25.851	24	0	24	0,00
	10.2024	629	¥ 90.000	0	(62)	(62)	(0,01)
	01.2025	432	CNH 3.084	0	(3)	(3)	0,00
	01.2026	¥ 90.000	\$ 663	62	0	62	0,01
DUB	07.2024	KRW 7.601.542	5.525	4	0	4	0,00
	07.2024	MYR 46.406	9.843	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	\$ 635	CLP 586.987	0	(13)	(13)	0,00
	07.2024	1.098	PLN 4.315	0	(25)	(25)	0,00
	08.2024	BRL 1.963	\$ 381	29	0	29	0,00
	09.2024	\$ 276	CLP 253.760	0	(7)	(7)	0,00
	10.2024	2.557	¥ 385.003	0	(130)	(130)	(0,01)
FAR	04.2025	¥ 454.000	\$ 3.101	158	0	158	0,02
	07.2024	AUD 10.469	6.975	0	(17)	(17)	0,00
	07.2024	€ 175.821	191.496	3.060	0	3.060	0,35
	07.2024	¥ 5.477.896	35.078	1.025	0	1.025	0,12
	07.2024	NZD 1.834	1.123	5	0	5	0,00
GLM	08.2024	\$ 696	NZD 1.141	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	CNY 12	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 3.849	3	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 7.299	393	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	\$ 1.167	CNY 8.308	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	50	KRW 68.690	0	0	0	0,00
	07.2024	47	MYR 220	0	0	0	0,00
	07.2024	698	PLN 2.757	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	2.007	ZAR 36.728	1	0	1	0,00
	08.2024	3.616	BRL 18.550	0	(288)	(288)	(0,03)
	10.2024	2.289	¥ 330.000	0	(209)	(209)	(0,02)
	06.2025	¥ 70.000	\$ 467	10	0	10	0,00
	01.2026	260.000	1.932	196	0	196	0,02
IND	07.2024	CNY 585	82	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 82	CNY 585	0	0	0	0,00
	07.2024	2.129	¥ 333.500	0	(55)	(55)	(0,01)
JPM	07.2024	BRL 1.004	200	19	0	19	0,00
	07.2024	CAD 2.938	2.148	1	0	1	0,00
	07.2024	CHF 431	477	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	CNY 1.578	221	2	0	2	0,00
	07.2024	€ 3.019	3.230	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	KRW 9.385.171	6.804	0	(13)	(13)	0,00
	07.2024	SGD 10.665	7.920	50	0	50	0,01
	07.2024	\$ 7.505	CHF 6.708	0	(40)	(40)	0,00
	07.2024	343	CLP 313.693	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	1.438	DKK 10.024	2	0	2	0,00
	07.2024	2.370	IDR 38.444.454	0	(21)	(21)	0,00
	07.2024	250	ILS 923	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	437	PLN 1.708	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	2.398	TRY 81.587	68	0	68	0,01
	07.2024	3.779	ZAR 69.570	26	0	26	0,00
	07.2024	ZAR 8.428	\$ 463	2	0	2	0,00
	08.2024	CHF 4.959	5.547	7	0	7	0,00
	08.2024	DKK 10.007	1.438	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	\$ 221	CNY 1.579	0	0	0	0,00
	08.2024	2.162	TRY 75.905	19	0	19	0,00
	09.2024	TWD 67.035	\$ 2.082	12	0	12	0,00
	09.2024	\$ 561	INR 47.040	1	0	1	0,00
	10.2024	CNH 138.535	\$ 19.361	225	0	225	0,03
	10.2024	¥ 330.000	2.646	566	0	566	0,06
	10.2024	\$ 2.371	CNH 16.973	0	(27)	(27)	0,00
	12.2024	CNH 4.592	\$ 640	3	0	3	0,00
MBC	07.2024	CAD 44.016	32.327	159	0	159	0,02
	07.2024	€ 5.066	5.500	70	0	70	0,01
	07.2024	IDR 40.321.527	2.446	0	(18)	(18)	0,00
	07.2024	¥ 114.300	731	20	0	20	0,00
	07.2024	\$ 34.601	CAD 47.374	20	0	20	0,00
	07.2024	4.523	CHF 4.030	0	(39)	(39)	0,00
	07.2024	664	DKK 4.610	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	1.153	€ 1.074	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	3.166	£ 2.485	0	(25)	(25)	0,00
	07.2024	355	NOK 3.783	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
	07.2024	\$	4.160	SEK	43.290	\$	0	\$	(72)	\$	(72)	(0,01)	
	08.2024	CAD	47.342	\$	34.601		0		(22)		(22)	0,00	
	08.2024	NOK	3.780		355		0		0		0	0,00	
	09.2024	CNH	13.505		1.876		15		0		15	0,00	
	09.2024	\$	315	TWD	10.140		0		(2)		(2)	0,00	
	10.2024	¥	730.000	\$	5.853		1.252		0		1.252	0,14	
	12.2024	CNH	5.475		767		8		0		8	0,00	
	12.2024	\$	767	CNH	5.473		0		(8)		(8)	0,00	
	01.2025	DKK	3.700	\$	543		5		0		5	0,00	
MYI	07.2024	BRL	11.895		2.303		161		0		161	0,02	
	07.2024	CNH	6.865		950		8		0		8	0,00	
	07.2024	€	9.058		9.712		5		0		5	0,00	
	07.2024	\$	950	CNY	6.746		0		(4)		(4)	0,00	
	07.2024		986	DKK	6.880		3		0		3	0,00	
	07.2024		101	NOK	1.080		0		0		0	0,00	
	07.2024		997	NZD	1.625		0		(6)		(6)	0,00	
	07.2024		4.393	SEK	46.403		0		(12)		(12)	0,00	
	08.2024	DKK	6.868	\$	986		0		(3)		(3)	0,00	
	08.2024	¥	3.030.000		19.674		740		0		740	0,08	
	08.2024	NOK	1.080		101		0		0		0	0,00	
	08.2024	SEK	46.331		4.393		12		0		12	0,00	
	09.2024	TWD	26.667		831		8		0		8	0,00	
	09.2024	\$	376	INR	31.399		0		0		0	0,00	
	10.2024	¥	260.000	\$	2.126		487		0		487	0,05	
RBC	07.2024	\$	47.433	£	37.405		0		(150)		(150)	(0,02)	
	08.2024	£	37.405	\$	47.441		149		0		149	0,02	
SCX	07.2024	CNY	30		4		0		0		0	0,00	
	07.2024	€	2.602		2.795		7		0		7	0,00	
	07.2024	IDR	164.120		10		0		0		0	0,00	
	07.2024	KRW	7.123.684		5.224		50		0		50	0,01	
	07.2024	\$	327	CNY	2.329		0		(5)		(5)	0,00	
	07.2024		221.715	€	206.940		73		0		73	0,01	
	07.2024	ZAR	772	\$	42		0		0		0	0,00	
	08.2024	€	206.940		222.041		0		(70)		(70)	(0,01)	
	08.2024	PEN	1.886		499		6		0		6	0,00	
	09.2024	CNH	82.593		11.511		132		0		132	0,01	
	09.2024	TWD	38.762		1.202		5		0		5	0,00	
	09.2024	\$	2.781	INR	232.796		4		0		4	0,00	
	09.2024		349	TWD	11.222		0		(3)		(3)	0,00	
SSB	07.2024	COP	1.383.424	\$	349		16		0		16	0,00	
	09.2024		872.427		218		10		0		10	0,00	
	09.2024	\$	654	CLP	603.823		0		(15)		(15)	0,00	
TOR	07.2024	CHF	50	\$	56		0		0		0	0,00	
	07.2024	NZD	864		529		3		0		3	0,00	
	07.2024	\$	30.443	¥	4.867.800		0		(182)		(182)	(0,02)	
	08.2024	¥	4.844.974	\$	30.443		181		0		181	0,02	
	08.2024	\$	529	NZD	864		0		(3)		(3)	0,00	
	10.2024		546	CNH	3.923		0		(4)		(4)	0,00	
UAG	07.2024	CHF	11.291	\$	12.494		0		(70)		(70)	(0,01)	
	07.2024	DKK	17.697		2.570		27		0		27	0,00	
	07.2024	ILS	9.142		2.467		39		0		39	0,00	
							\$	11.328	\$	(2.512)	\$	8.816	1,00

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
BOA	07.2024	\$	7.752	€	7.140	\$	0	\$	(100)	\$	(100)	(0,01)	
BPS	07.2024	€	6.372	\$	6.816		1		(14)		(13)	0,00	
	07.2024	\$	6.413	€	5.924		0		(64)		(64)	(0,01)	
	08.2024		6.765		6.316		13		0		13	0,00	
CBK	07.2024	€	24	\$	27		0		0		0	0,00	
FAR	07.2024	\$	7.838	€	7.197		0		(126)		(126)	(0,01)	
MBC	07.2024	€	7.340	\$	7.853		2		(16)		(14)	0,00	
	08.2024	\$	6.911	€	6.454		17		0		17	0,00	
RYL	07.2024	€	99	\$	106		0		0		0	0,00	
SCX	07.2024		6.452		6.913		0		(2)		(2)	0,00	
	08.2024	\$	6.917	€	6.446		2		0		2	0,00	
SSB	07.2024		30		27		0		(1)		(1)	0,00	
							\$	35	\$	(323)	\$	(288)	(0,03)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Class E USD (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD	46	\$	28	\$	0	\$	0,00
	08.2024	\$	28	NZD	46	0	0	0	0,00
BOA	07.2024	CLP	38.129	\$	41	0	0	0	0,00
	07.2024	ILS	395		105	0	0	0	0,00
	07.2024	TWD	464		14	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	2.797	€	2.577	0	(36)	(36)	(0,01)
BPS	07.2024		82	MXN	1.380	0	(7)	(7)	0,00
	08.2024		41	CLP	38.129	0	0	0	0,00
	08.2024		105	ILS	394	0	0	0	0,00
	07.2024	AUD	1.485	\$	990	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	CNY	229		32	0	0	0	0,00
	07.2024	£	34		44	0	0	0	0,00
	07.2024	¥	22.030		141	4	0	4	0,00
	07.2024	SGD	228		168	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	1	CAD	2	0	0	0	0,00
	07.2024		123	CNY	885	0	0	0	0,00
BRC	07.2024		2.889	£	2.261	0	(30)	(30)	0,00
	08.2024		991	AUD	1.485	2	0	2	0,00
	08.2024		168	SGD	228	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW	1.140.129	\$	819	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	MXN	4.139		227	1	0	1	0,00
	07.2024	\$	55	DKK	380	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024		341	IDR	5.540.761	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024		78	NOK	816	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024		294	THB	10.789	0	0	0	0,00
	08.2024		819	KRW	1.138.163	8	0	8	0,00
CBK	08.2024		226	MXN	4.139	0	0	0	0,00
	07.2024	€	43	\$	46	0	0	0	0,00
	07.2024	¥	6.087		38	0	0	0	0,00
	07.2024	PEN	278		73	0	0	0	0,00
	07.2024	PLN	683		169	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$	419	CAD	571	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024		33	CHF	30	0	0	0	0,00
	07.2024		106	ILS	395	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024		82	MXN	1.380	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024		74	PEN	278	0	(2)	(2)	0,00
DUB FAR	07.2024		285	SEK	3.024	1	0	1	0,00
	08.2024	CNY	385	\$	54	0	0	0	0,00
	08.2024	\$	73	PEN	278	0	0	0	0,00
	08.2024		169	PLN	683	1	0	1	0,00
	07.2024		828	KRW	1.137.508	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	CNY	629	\$	88	1	0	1	0,00
	07.2024	NZD	88		54	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	990	AUD	1.485	2	0	2	0,00
	07.2024		13.341	€	12.249	0	(214)	(214)	(0,03)
	07.2024		7.027	¥	1.097.383	0	(205)	(205)	(0,02)
GLM	07.2024		124	NZD	202	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024		54		88	0	0	0	0,00
	07.2024	€	70	\$	76	1	0	1	0,00
	07.2024	MYR	1.304		277	1	0	1	0,00
	07.2024	\$	278	MYR	1.304	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024		277		1.304	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	CAD	2.636	\$	1.925	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	€	8.746		9.352	0	(21)	(21)	0,00
	07.2024	¥	269.382		1.678	3	0	3	0,00
	07.2024	NOK	636		60	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	SEK	8		1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	1.514	CAD	2.061	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024		65	HUF	23.239	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024		174	PLN	683	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024		1.925	CAD	2.634	1	0	1	0,00
	08.2024		9.339	€	8.721	22	0	22	0,00
	08.2024		1.678	¥	268.121	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024		59	NOK	632	0	0	0	0,00
	07.2024	CZK	3.011	\$	129	0	0	0	0,00
	07.2024	DKK	394		56	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	IDR	5.545.587		338	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	NOK	181		17	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK	3.020		286	1	0	1	0,00
	07.2024	\$	131	CZK	3.004	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024		129		3.009	0	0	0	0,00
	08.2024		56	DKK	393	0	0	0	0,00
	08.2024		338	IDR	5.549.232	2	0	2	0,00
	08.2024		17	NOK	180	0	0	0	0,00
	08.2024		286	SEK	3.015	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	£	2.227	\$	2.824	9	0	9	0,00
RBC	08.2024	\$	2.825	£	2.227	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024		0	DKK	1	0	0	0	0,00
RYL SCX	07.2024	€	5.829	\$	6.245	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	\$	2	CHF	1	0	0	0	0,00
	07.2024		6.591	CNY	46.873	0	(90)	(90)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens		
	07.2024	\$ 170	SGD 228	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00		
SSB	08.2024	6.254	€ 5.829	2	0	2	0,00		
	07.2024	€ 138	\$ 149	2	0	2	0,00		
	07.2024	¥ 5.177	33	1	0	1	0,00		
TOR	07.2024	\$ 78	CNY 557	0	(1)	(1)	0,00		
	07.2024	82	MXN 1.380	0	(7)	(7)	0,00		
	07.2024	HUF 23.242	\$ 63	0	0	0	0,00		
	07.2024	NZD 67	41	0	0	0	0,00		
	07.2024	\$ 42	CLP 38.129	0	(2)	(2)	0,00		
UAG	08.2024	63	HUF 23.269	1	0	1	0,00		
	08.2024	41	NZD 67	0	0	0	0,00		
	07.2024	CHF 347	\$ 386	1	0	1	0,00		
	07.2024	THB 10.789	293	0	(1)	(1)	0,00		
	07.2024	\$ 349	CHF 316	2	0	2	0,00		
	07.2024	85	DKK 588	0	(1)	(1)	0,00		
	08.2024	€ 31	\$ 33	0	0	0	0,00		
	08.2024	\$ 386	CHF 345	0	(1)	(1)	0,00		
08.2024	293	THB 10.789	1	0	1	0,00			
						\$ 70	\$ (683)	\$ (613)	(0,07)
Summe Freiverkehrsfina n z d e r i v a t e						\$ 15.851	1,79		

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMOGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHORDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fallig am 01.07.2039	\$ 15.400	\$ (13.535)	(1,53)
2,000 % fallig am 01.08.2054	91.250	(71.449)	(8,08)
2,500 % fallig am 01.08.2054	7.500	(6.132)	(0,69)
3,000 % fallig am 01.08.2054	23.200	(19.756)	(2,24)
3,500 % fallig am 01.08.2054	6.000	(5.312)	(0,60)
5,500 % fallig am 01.08.2054	28.900	(28.502)	(3,22)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (144.686)	(16,36)
Summe Anlagen		\$ 885.802	100,17
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.506)	(0,17)
Nettovermogen		\$ 884.296	100,00

### ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Hoh e von 25.066 USD (31. Dezember 2023: 28.089 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfand et.

Barmittel in Hoh e von 330 USD (31. Dezember 2023: 10.080 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit fur Finanzderivate verpfand et.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 976.427	\$ 89	\$ 976.516
Investmentfonds	41.951	0	0	41.951
Pensionsgeschafte	0	510	0	510
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(5)	11.516	0	11.511
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(144.686)	0	(144.686)
Summen	\$ 41.946	\$ 843.767	\$ 89	\$ 885.802

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen		Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren		Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren		Marktwert
	(Stufe 1)		(Stufe 2)		(Stufe 3)		
Übertragbare Wertpapiere	\$	0	\$	962.859	\$	93	\$ 962.952
Investmentfonds		10.172		0		0	10.172
Pensionsgeschäfte		0		1.005		0	1.005
Finanzderivate <sup>(3)</sup>		(1.720)		1.285		0	(435)
Leerverkaufte Wertpapiere		0		(97.971)		0	(97.971)
<b>Summen</b>	<b>\$</b>	<b>8.452</b>	<b>\$</b>	<b>867.178</b>	<b>\$</b>	<b>93</b>	<b>\$ 875.723</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (584)	\$ 0	\$ (584)	\$ (349)	\$ 300	\$ (49)
BOA	(13)	0	(13)	(1.743)	1.570	(173)
BPS	4.991	(1.210)	3.781	(1.750)	1.990	240
BRC	1.109	(400)	709	524	(450)	74
CBK	2.108	(210)	1.898	60	0	60
DUB	193	(190)	3	(217)	0	(217)
FAR	3.517	(3.720)	(203)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(490)	290	(200)	(324)	0	(324)
GST	1.464	(280)	1.184	(23)	0	(23)
IND	(53)	0	(53)	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	833	(830)	3	(399)	260	(139)
MBC	1.420	(1.350)	70	(612)	620	8
MYC	(154)	10	(144)	(170)	10	(160)
MYI	1.397	(1.340)	57	(1.858)	1.890	32
RBC	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	137	(260)	(123)	(472)	340	(132)
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
SSB	5	0	5	10	0	10
TOR	(6)	0	(6)	(1.338)	1.280	(58)
UAG	(3)	30	27	(1.017)	1.820	803
ULO	(19)	0	(19)	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	52,35	74,23
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	55,04	46,09
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,04	0,02
Investmentfonds	4,74	1,27
Pensionsgeschäfte	0,06	0,13
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,08)	(0,66)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,41)	1,82
Freiverkehrsfinanzderivate	1,79	(1,21)
Leerverkaufte Wertpapiere	(16,36)	(12,24)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	1,36	1,88
Belgien	0,49	0,10
Kanada	5,32	1,84
Cayman-Inseln	2,44	2,75
Chile	0,09	k. A.
China	0,99	3,95
Dänemark	0,93	2,21
Finnland	0,10	k. A.
Frankreich	3,61	2,73
Deutschland	1,02	1,84
Ungarn	0,33	0,27
Irland	4,32	5,71
Israel	1,37	1,33

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Italien	0,57	0,90
Japan	4,08	6,77
Luxemburg	0,31	0,70
Malaysia	1,20	1,37
Mexiko	0,04	0,04
Multinational	0,08	0,09
Niederlande	1,00	0,49
Neuseeland	0,03	0,08
Norwegen	0,38	0,20
Peru	0,07	0,08
Polen	0,44	0,30
Portugal	0,04	0,04
Katar	0,04	0,04
Rumänien	0,94	0,83
Saudi-Arabien	0,65	0,57
Serbien	0,14	0,16
Singapur	1,74	0,24
Slowenien	k. A.	0,22
Südkorea	3,79	4,86
Spanien	1,74	1,05
Supranational	0,78	0,11
Schweden	0,08	0,09
Schweiz	1,38	1,13
Thailand	k. A.	0,47
Vereinigte Arabische Emirate	0,06	0,07
Großbritannien	7,39	6,80
USA	56,06	46,45
Kurzfristige Instrumente	5,03	21,58
Investmentfonds	4,74	1,27
Pensionsgeschäfte	0,06	0,13
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,08)	(0,66)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,03)	(0,14)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,01)	0,11
Zinsswaps	(0,37)	1,85
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,03	k. A.
Zinsswapoptionen	0,08	0,06
Optionen auf Wertpapiere	0,09	0,08
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	(0,02)
Zinsswapoptionen	(0,15)	(0,19)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,01)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,83	0,01
Zinsswaps	0,01	0,01
Total Return Swaps auf Indizes	0,01	(0,20)
Devisenterminkontrakte	1,00	(1,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,10)	0,11
Leerverkaufte Wertpapiere	(16,36)	(12,24)
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,17)	(9,45)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>AUSTRALIEN</b>				<b>AUSTRALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Perenti Finance Pty. Ltd. 7,500 % fällig am 26.04.2029	\$ 3.925	\$ 4.004	0,13	Bausch & Lomb Corp. 8,375 % fällig am 01.10.2028	\$ 9.000	\$ 9.225	0,31	<b>DÄNEMARK</b>			
				Bausch Health Cos., Inc. 6,125 % fällig am 01.02.2027	500	417	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				11,000 % fällig am 30.09.2028	500	446	0,01	Orsted A/S 5,125 % fällig am 14.03.2024	€ 1.100	\$ 1.190	0,04
								<b>FRANKREICH</b>			
<b>ÖSTERREICH</b>				<b>ÖSTERREICH</b>				<b>FRANKREICH</b>			
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
ams-OSRAM AG 2,125 % fällig am 03.11.2027	€ 7.000	5.945	0,20	Bombardier, Inc. 7,000 % fällig am 01.06.2032	1.000	1.015	0,03	Accor S.A. 7,250 % fällig am 11.01.2029 (d)	700	815	0,03
				7,250 % fällig am 01.07.2031	3.600	3.701	0,12	Altice France S.A. 3,375 % fällig am 15.01.2028	7.000	5.268	0,18
				7,500 % fällig am 01.02.2029 (g)	750	778	0,03	4,125 % fällig am 15.01.2029	3.000	2.145	0,07
				7,875 % fällig am 15.04.2027	1.482	1.487	0,05	4,250 % fällig am 15.10.2029	1.700	1.215	0,04
				8,750 % fällig am 15.11.2030	2.350	2.543	0,08	5,125 % fällig am 15.07.2029	\$ 3.700	2.439	0,08
				Garda World Security Corp. 4,625 % fällig am 15.02.2027	6.175	5.908	0,20	5,500 % fällig am 15.01.2028	15.000	10.290	0,34
				7,750 % fällig am 15.02.2028	1.200	1.224	0,04	<b>CAB SELAS</b>			
				GFL Environmental, Inc. 3,500 % fällig am 01.09.2028	5.000	4.614	0,15	3,375 % fällig am 01.02.2028	€ 3.300	3.166	0,11
				4,000 % fällig am 01.08.2028	3.000	2.791	0,09	<b>Cerba Healthcare SACA</b>			
				6,750 % fällig am 15.01.2031	1.050	1.073	0,04	3,500 % fällig am 31.05.2028	3.250	2.888	0,10
Summe Österreich		16.455	0,55	goeasy Ltd. 7,625 % fällig am 01.07.2029	4.400	4.492	0,15	<b>CMA CGM S.A.</b>			
				9,250 % fällig am 01.12.2028	2.453	2.606	0,09	5,500 % fällig am 15.07.2029 (a)	1.700	1.828	0,06
				Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc. 6,000 % fällig am 15.09.2028	4.800	4.653	0,16	Electricite de France S.A. 9,125 % fällig am 15.03.2033 (d)	\$ 16.125	17.578	0,58
				<b>Northriver Midstream Finance LP</b>				<b>ELO SACA</b>			
				5,625 % fällig am 15.02.2026	2.600	2.603	0,09	5,875 % fällig am 17.04.2028	€ 4.200	4.436	0,15
				6,750 % fällig am 15.07.2032 (a)	1.850	1.854	0,06	<b>Eramet S.A.</b>			
				Parkland Corp. 4,500 % fällig am 01.10.2029	3.524	3.228	0,11	6,500 % fällig am 30.11.2029	2.900	3.127	0,10
				4,625 % fällig am 01.05.2030	4.522	4.128	0,14	7,000 % fällig am 22.05.2028	6.300	6.946	0,23
				<b>Strathcona Resources Ltd.</b>				<b>Eutelsat S.A.</b>			
				6,875 % fällig am 01.08.2026	5.250	5.199	0,17	1,500 % fällig am 13.10.2028	2.400	2.083	0,07
				<b>Taseko Mines Ltd.</b>				9,750 % fällig am 13.04.2029	2.600	2.915	0,10
				8,250 % fällig am 01.05.2030	800	819	0,03	<b>iliad S.A.</b>			
						94.137	3,13	5,375 % fällig am 02.05.2031	3.300	3.567	0,12
								<b>Picard Groupe S.A.S.</b>			
				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				6,375 % fällig am 01.07.2029 (a)	1.000	1.072	0,04
				<b>B.C. Unlimited Liability Co.</b>				<b>RCI Banque S.A.</b>			
				7,094 % fällig am 20.09.2030	1.610	1.608	0,05	5,500 % fällig am 09.10.2034 (a)	400	428	0,01
				<b>NorthRiver Midstream Finance LP</b>				<b>Vallourec SACA</b>			
				7,802 % fällig am 16.08.2030	497	498	0,02	7,500 % fällig am 15.04.2032	\$ 1.301	1.349	0,04
						2.106	0,07	Summe Frankreich		73.555	2,45
				Summe Kanada		96.243	3,20	<b>DEUTSCHLAND</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>Bayer AG</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,000 % fällig am 25.09.2083	€ 20.900	23.161	0,77
				<b>Diamond Foreign Asset Co.</b>				<b>Cheplapharm Arzneimittel GmbH</b>			
				8,500 % fällig am 01.10.2030	1.125	1.182	0,04	3,500 % fällig am 11.02.2027	4.350	4.468	0,15
				<b>Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd.</b>				4,375 % fällig am 15.01.2028	2.750	2.804	0,09
				5,750 % fällig am 20.01.2026	1.875	1.786	0,06	7,500 % fällig am 15.05.2030	3.850	4.323	0,14
				<b>Seagate HDD Cayman</b>				<b>Mahle GmbH</b>			
				4,750 % fällig am 01.01.2025	5.875	5.837	0,19	6,500 % fällig am 02.05.2031	2.500	2.733	0,09
				<b>Spirit Loyalty Cayman Ltd.</b>				<b>Nidda Healthcare Holding GmbH</b>			
				8,000 % fällig am 20.09.2025	12.700	9.281	0,31	7,500 % fällig am 21.08.2026	22.250	24.532	0,82
				<b>Transocean, Inc.</b>				<b>Schaeffler AG</b>			
				8,750 % fällig am 15.02.2030	2.025	2.127	0,07	4,750 % fällig am 14.08.2029	1.000	1.081	0,03
				<b>Wynn Macau Ltd.</b>				<b>Techem Verwaltungsgesellschaft mbH</b>			
				5,500 % fällig am 01.10.2027	800	763	0,03	5,375 % fällig am 15.07.2029	3.300	3.573	0,12
						20.976	0,70	<b>TK Elevator Holdco GmbH</b>			
								6,625 % fällig am 15.07.2028	7.200	7.457	0,25
				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>WEPA Hygieneprodukte GmbH</b>			
				<b>American Airlines, Inc.</b>				2,875 % fällig am 15.12.2027	6.000	6.029	0,20
				10,336 % fällig am 20.04.2028	680	704	0,02	<b>ZF Finance GmbH</b>			
				Summe Cayman Inseln		21.680	0,72	3,750 % fällig am 21.09.2028	4.000	4.159	0,14
								Summe Deutschland		84.320	2,80
				<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>				<b>GIBRALTAR</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
				<b>EP Infrastructure A/S</b>				<b>GVC Holdings (Gibraltar) Ltd.</b>			
				1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 9.050	7.838	0,26	8,014 % fällig am 31.10.2029	\$ 590	591	0,02
				<b>EPH Financing International A/S</b>				<b>IRLAND</b>			
				5,875 % fällig am 30.11.2029	500	537	0,02	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				Summe Tschechische Republik		8.375	0,28	<b>Jazz Securities DAC</b>			
								4,375 % fällig am 15.01.2029	600	557	0,02











BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Scientific Games Holdings LP 8,306 % fällig am 04.04.2029	\$ 248	\$ 248	0,01	United Airlines, Inc. 8,094 % fällig am 22.02.2031	\$ 2.993	\$ 3.004	0,10	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Sotera Health Holdings LLC 8,594 % fällig am 30.05.2031	10.625	10.621	0,35	USI, Inc. 8,095 % fällig am 22.11.2029	353	354	0,01	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Tempo Acquisition LLC 7,594 % fällig am 31.08.2028	927	930	0,03	8,335 % fällig am 22.11.2029	0	0	0,00	<b>PIMCO Funds: Global</b>			
TGP Holdings LLC 8,694 % fällig am 29.06.2028	2.075	1.973	0,07	Vertiv Group Corp. 7,331 % fällig am 02.03.2027	928	932	0,03	Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (e)	1.219.084	\$ 12.349	0,41
TransDigm, Inc. TBD % fällig am 24.08.2028	1.521	1.526	0,05	7,944 % fällig am 02.03.2027	0	0	0,00	<b>PIMCO Funds: Global</b>			
TBD % fällig am 22.03.2030	3.226	3.235	0,11	WMG Acquisition Corp. 7,344 % fällig am 24.01.2031	1.000	1.003	0,03	Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (e)	4.496.448	55.853	1,86
8,595 % fällig am 28.02.2031	1.550	1.555	0,05					<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)</b>	11.500.238	114.606	3,81
TransUnion LLC											
TBD % fällig am 16.11.2026	2.788	2.789	0,09	<b>US-SCHATZOBLIGATIONEN</b>							
TBD % fällig am 24.06.2031	2.637	2.636	0,09	U.S. Treasury Notes							
Trident TPI Holdings, Inc. 9,302 % fällig am 15.09.2028	683	685	0,02	3,500 % fällig am 15.09.2025	30.000	29.464	0,98				
Triton Water Holdings, Inc. 9,345 % fällig am 31.03.2028	773	776	0,03	4,250 % fällig am 15.10.2025	58.000	57.463	1,91				
Truist Insurance Holdings LLC 8,585 % fällig am 06.05.2031	1.900	1.906	0,06	5,000 % fällig am 31.10.2025	59.100	59.114	1,97				
U.S. Foods, Inc. 7,344 % fällig am 22.11.2028	811	816	0,03								
				Summe USA		146.041	4,86				
				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.881.155	95,85					
						113.501	3,78				
						1.857.300	61,79	Summe Investmentfonds		\$ 182.808	6,08

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 404	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (412)	\$ 404	\$ 404	0,01
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (412)	\$ 404	\$ 404	0,01

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	743	\$ (713)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	64	(117)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	533	271	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	303	(260)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	235	195	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	156	(134)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	46	94	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	12	5	0,00
				\$ (659)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (659)	(0,02)

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.06.2028	€ 2.100	\$ 156	0,01
Newell Brands, Inc.	1,000	20.06.2028	\$ 2.400	124	0,00
				\$ 280	0,01

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000 %	20.06.2029	\$ 23.800	\$ 27	0,00
iTraxx Crossover 41 5-Year Index	5,000	20.06.2029	€ 9.900	31	0,00
				\$ 58	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750 %	18.09.2029	€ 71.300	\$ (1.123)	(0,04)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (785)</b>	<b>(0,03)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 644.452	\$ 699.681	\$ 8.989	\$ 0	\$ 8.989	0,30
	07.2024	\$ 9.268	€ 8.535	0	(121)	(121)	(0,01)
BPS	07.2024	€ 4.373	\$ 4.675	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	£ 41.590	53.127	554	0	554	0,02
	07.2024	SGD 37	27	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 12.104	€ 11.203	0	(97)	(97)	0,00
	08.2024	27	SGD 37	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	6	CHF 6	0	0	0	0,00
	07.2024	2.002	€ 1.838	0	(32)	(32)	0,00
GLM	07.2024	2.118	€ 1.956	0	(21)	(21)	0,00
JPM	07.2024	CHF 65	\$ 72	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 54	40	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 7.151	€ 6.683	11	0	11	0,00
	08.2024	72	CHF 65	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	683.580	€ 639.146	1.529	(104)	1.425	0,05
	08.2024	€ 624.054	\$ 668.277	0	(1.529)	(1.529)	(0,05)
MYI	07.2024	9.556	10.246	7	(3)	4	0,00
	07.2024	£ 51	64	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 10	7	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 4.571	£ 3.615	1	(3)	(2)	0,00
	07.2024	69	SGD 94	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	52.740	£ 41.590	0	(166)	(166)	(0,01)
	08.2024	£ 41.590	\$ 52.749	166	0	166	0,01
SCX	07.2024	€ 8.349	8.970	22	0	22	0,00
SSB	07.2024	6.309	6.844	82	0	82	0,00
UAG	07.2024	\$ 66	CHF 59	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 3.413	\$ 3.655	0	(8)	(8)	0,00
				<b>\$ 11.361</b>	<b>\$ (2.096)</b>	<b>\$ 9.265</b>	<b>0,31</b>

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 8.927	CHF 8.030	\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,00
BRC	07.2024	CHF 15	\$ 16	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	\$ 997	CHF 908	13	0	13	0,00
JPM	07.2024	CHF 9.736	\$ 10.849	14	0	14	0,00
	08.2024	\$ 10.849	CHF 9.700	0	(14)	(14)	0,00
SCX	07.2024	181	162	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	10.656	9.626	56	0	56	0,00
UAG	07.2024	CHF 9.695	\$ 10.805	16	0	16	0,00
	07.2024	\$ 10.547	CHF 9.531	59	0	59	0,01
	08.2024	10.805	9.659	0	(16)	(16)	0,00
				<b>\$ 167</b>	<b>\$ (30)</b>	<b>\$ 137</b>	<b>0,01</b>

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 437.434	€ 402.899	\$ 0	\$ (5.626)	\$ (5.626)	(0,19)
BPS	07.2024	€ 373.195	\$ 399.172	2	(802)	(800)	(0,03)
	07.2024	\$ 374.145	€ 345.601	0	(3.747)	(3.747)	(0,13)
BRC	08.2024	399.604	373.056	802	0	802	0,03
	07.2024	€ 411	\$ 440	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2024	515	561	9	0	9	0,00
	07.2024	\$ 3.843	€ 3.581	0	(5)	(5)	0,00
FAR	07.2024	421.466	386.966	0	(6.735)	(6.735)	(0,22)
GLM	07.2024	€ 72	\$ 78	1	0	1	0,00
JPM	07.2024	158	169	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	388.031	414.945	12	(939)	(927)	(0,03)
	08.2024	\$ 410.248	€ 383.100	939	0	939	0,03
MYI	07.2024	€ 496	\$ 532	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	273	297	4	0	4	0,00
RYL	07.2024	1.121	1.199	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2024	382.910	410.250	0	(134)	(134)	0,00
	07.2024	\$ 296	€ 275	0	(1)	(1)	0,00
SSB	08.2024	410.853	382.910	129	0	129	0,00
	07.2024	8.526	7.860	0	(102)	(102)	0,00
UAG	08.2024	€ 40	\$ 42	0	0	0	0,00
				\$ 1.898	\$ (18.094)	\$ (16.196)	(0,54)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und E Class GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 88.219	\$ 111.554	\$ 37	\$ 0	\$ 37	0,00
	07.2024	\$ 229.513	£ 180.104	0	(1.844)	(1.844)	(0,06)
	08.2024	111.504	88.165	0	(34)	(34)	0,00
BRC	07.2024	£ 57	\$ 73	1	0	1	0,00
CBK	07.2024	6.239	7.919	32	0	32	0,00
	07.2024	\$ 3.373	£ 2.651	0	(21)	(21)	0,00
DUB	08.2024	£ 1.332	\$ 1.684	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 119.909	£ 93.974	0	(1.117)	(1.117)	(0,04)
MBC	07.2024	£ 92.459	\$ 116.988	110	0	110	0,00
	07.2024	\$ 678	£ 532	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	114.051	90.130	0	(98)	(98)	0,00
RBC	07.2024	£ 90.213	\$ 114.400	361	0	361	0,01
	08.2024	\$ 114.419	£ 90.213	0	(360)	(360)	(0,01)
RYL	07.2024	£ 72	\$ 92	1	0	1	0,00
				\$ 542	\$ (3.480)	\$ (2.938)	(0,10)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 3.848	\$ 2.835	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	07.2024	\$ 4.615	SGD 6.233	1	(16)	(15)	0,00
	08.2024	2.835	3.842	4	0	4	0,00
BPS	07.2024	SGD 3.693	\$ 2.723	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	\$ 3.481	SGD 4.715	3	0	3	0,00
BRC	07.2024	11	14	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	48	64	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	SGD 202	\$ 150	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 52	SGD 70	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	SGD 45	\$ 34	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.570	SGD 2.124	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2024	SGD 8	\$ 6	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2.219	SGD 2.990	0	(13)	(13)	0,00
				\$ 9	\$ (38)	\$ (29)	0,00
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ (9.761)</b>	<b>(0,32)</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>\$ 3.053.162</b>	<b>101,57</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>\$ (47.193)</b>	<b>(1,57)</b>
<b>Nettovermögen</b>						<b>\$ 3.005.969</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.  
 (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.  
 (c) Nullkuponwertpapier.  
 (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (e) Mit dem Fonds verbunden.  
 (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (g) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 30.969 USD (31. Dezember 2023: 21,426 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 316 USD (31. Dezember 2023: 566 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 12.250 USD (31. Dezember 2023: 31.571 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 6,540 USD (31. Dezember 2023: 2.520 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. Als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.876.484	\$ 4.671	\$ 2.881.155
Investmentfonds	182.808	0	0	182.808
Pensionsgeschäfte	0	404	0	404
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(825)	(10.380)	0	(11.205)
<b>Summen</b>	<b>\$ 181.983</b>	<b>\$ 2.866.508</b>	<b>\$ 4.671</b>	<b>\$ 3.053.162</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.863.432	\$ 47	\$ 2.863.479
Investmentfonds	76.320	0	0	76.320
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(3.058)	12.595	0	9.537
<b>Summen</b>	<b>\$ 73.262</b>	<b>\$ 2.876.027</b>	<b>\$ 47</b>	<b>\$ 2.949.336</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	5,000 %	22.11.2023	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (409)	\$ (422)	(0,01)
BRC	0,500	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (2.731)	(2.928)	(0,10)
DEU	5,000	13.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (2.006)	(2.011)	(0,07)
JML	0,750	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (2.684)	(2.878)	(0,10)
	2,750	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.943)	(3.158)	(0,10)
JPS	4,000	10.06.2024	02.08.2024	\$ (398)	(399)	(0,01)
	4,800	10.06.2024	02.08.2024	(1.154)	(1.157)	(0,04)
	5,150	10.06.2024	02.08.2024	(349)	(350)	(0,01)
	5,250	14.06.2024	02.08.2024	(768)	(770)	(0,03)
	5,300	14.06.2024	02.08.2024	(2.963)	(2.971)	(0,10)
MEI	0,500	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (2.003)	(2.147)	(0,07)
MYI	0,250	18.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(4.826)	(5.173)	(0,17)
	2,250	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(1.558)	(1.672)	(0,06)
	2,900	13.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(2.888)	(3.100)	(0,10)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (29.136)</b>	<b>(0,97)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 3.236	\$ (3.490)	\$ (254)	\$ 68	\$ 0	\$ 68
BPS	(5.140)	5.240	100	(704)	2.520	1.816
BRC	k. A.	k. A.	k. A.	1.854	(3.880)	(2.026)
CBK	(4)	0	(4)	108	0	108
DUB	(1.117)	1.270	153	15	0	15
FAR	(6.735)	(3.160)	(9.895)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(19)	20	1	431	(420)	11
JLN	k. A.	k. A.	k. A.	37	0	37
JPM	11	0	11	0	(40)	(40)
MBC	(89)	0	(89)	3.675	(5.510)	(1.835)
MYI	2	10	12	398	(400)	(2)
RBC	5	0	5	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	3	0	3	876	(1.240)	(364)
SSB	(20)	0	(20)	725	(630)	95
TOR	56	0	56	21	0	21
UAG	51	0	51	417	(370)	47

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	36,96	47,81
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	57,53	47,88
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,36	0,39
Investmentfonds	6,08	2,56
Pensionsgeschäfte	0,01	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	(0,12)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	0,17
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,32)	0,27
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,97)	(0,67)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	0,13	k. A.
Österreich	0,55	0,23
Belgien	0,54	0,27
Bermuda	1,16	0,86
Kanada	3,20	3,03
Cayman-Inseln	0,72	0,42
Tschechische Republik	0,28	0,56
Dänemark	0,04	k. A.
Frankreich	2,45	3,40
Deutschland	2,80	3,44
Gibraltar	0,02	0,02
Irland	0,08	k. A.
Italien	4,64	6,13
Japan	0,69	k. A.
Jersey, Kanalinseln	0,62	0,36
Liberia	1,26	1,04
Luxemburg	3,68	3,42
Multinational	0,88	1,43
Niederlande	3,89	4,61
Norwegen	0,07	0,08
Panama	0,81	0,81
Singapur	0,02	k. A.
Spanien	0,32	1,54
Schweden	0,99	1,12
Schweiz	0,01	0,01
Großbritannien	4,21	4,73
USA	61,79	58,57
Investmentfonds	6,08	2,56
Pensionsgeschäfte	0,01	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,02)	(0,12)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,04
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,05
Zinsswaps	(0,04)	0,08
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,31	(0,11)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,63)	0,38
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,57)	1,04
Nettovermögen	100,00	100,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond ESG Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS					
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>																
<b>ÖSTERREICH</b>																
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>																
ams-OSRAM AG 12,250 % fällig am 30.03.2029	\$	50	52	0,53	Mundys SpA 4,750 % fällig am 24.01.2029	€	100	108	1,10	Amer Sports Co. 6,750 % fällig am 16.02.2031	\$	75	75	0,77		
<b>BERMUDA</b>																
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>																
NCL Corp. Ltd. 5,875 % fällig am 15.02.2027		75	74	0,76	Nexti SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029		100	97	0,99	AmWINS Group, Inc. 6,375 % fällig am 15.02.2029		75	75	0,77		
<b>KANADA</b>																
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>																
B.C. Unlimited Liability Co. 3,875 % fällig am 15.01.2028		125	117	1,19	UniCredit SpA 7,296 % fällig am 02.04.2034	\$	100	102	1,04	Avantor Funding, Inc. 4,625 % fällig am 15.07.2028		75	71	0,73		
Bausch & Lomb Corp. 8,375 % fällig am 01.10.2028		75	77	0,79	Summe Italien			415	4,24	Block, Inc. 6,500 % fällig am 15.05.2032		125	127	1,30		
Brookfield Property Finance ULC 7,125 % fällig am 13.02.2028	CAD	75	56	0,57	<b>LIBERIA</b>				Boost Newco Borrower LLC 7,500 % fällig am 15.01.2031		50	52	0,53			
GFL Environmental, Inc. 6,750 % fällig am 15.01.2031	\$	75	77	0,79	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Brandywine Operating Partnership LP 8,875 % fällig am 12.04.2029		75	78	0,80			
goeasly Ltd. 9,250 % fällig am 01.12.2028		75	80	0,82	Royal Caribbean Cruises Ltd. 5,500 % fällig am 31.08.2026		75	74	0,76	Builders FirstSource, Inc. 4,250 % fällig am 01.02.2032		75	66	0,67		
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc. 6,000 % fällig am 15.09.2028		75	73	0,74	<b>LUXEMBURG</b>				Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % fällig am 01.07.2031		75	79	0,81			
Summe Kanada			480	4,90	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Cable One, Inc. 4,000 % fällig am 15.11.2030		75	56	0,57			
<b>CAYMAN INSELN</b>																
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>																
Seagate HDD Cayman 4,750 % fällig am 01.01.2025		75	74	0,76	Camelot Finance S.A. 4,500 % fällig am 01.11.2026		75	73	0,75	Cargo Aircraft Management, Inc. 4,750 % fällig am 01.02.2028		75	70	0,72		
Spirit Loyalty Cayman Ltd. 8,000 % fällig am 20.09.2025		75	55	0,56	Loarre Investments SARL 6,500 % fällig am 15.05.2029	€	100	108	1,10	CCO Holdings LLC 4,250 % fällig am 01.02.2031		200	163	1,67		
Summe Cayman Inseln			129	1,32	Summe Luxemburg			181	1,85	Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.01.2032		75	64	0,65		
<b>DÄNEMARK</b>																
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>																
TDC Net A/S 6,500 % fällig am 01.06.2031	€	100	114	1,17	<b>MULTINATIONAL</b>				Coty, Inc. 4,500 % fällig am 15.05.2027	€	100	108	1,10			
<b>FRANKREICH</b>																
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>																
CAB SELAS 3,375 % fällig am 01.02.2028		100	96	0,98	American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	\$	83	82	0,84	Credit Acceptance Corp. 9,250 % fällig am 15.12.2028	\$	75	79	0,81		
Cerba Healthcare SACA 3,500 % fällig am 31.05.2028		100	89	0,91	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2,000 % fällig am 01.09.2028	€	100	94	0,96	Cushman & Wakefield U.S. Borrower LLC 8,875 % fällig am 01.09.2031		75	79	0,81		
Eramet S.A. 6,500 % fällig am 30.11.2029		100	108	1,11	Summe multinational			176	1,80	DaVita, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031		75	64	0,65		
Forvia SE 2,375 % fällig am 15.06.2029		125	120	1,23	<b>NIEDERLANDE</b>				Directv Financing LLC 5,875 % fällig am 15.08.2027		75	71	0,73			
Summe Frankreich			413	4,23	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Embecta Corp. 5,000 % fällig am 15.02.2030		75	62	0,63			
<b>DEUTSCHLAND</b>																
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>																
Bayer AG 7,000 % fällig am 25.09.2083		100	111	1,14	Axalta Coating Systems Dutch Holding BV 7,250 % fällig am 15.02.2031	\$	75	78	0,80	First Student Bidco, Inc. 4,000 % fällig am 31.07.2029		75	68	0,69		
Nidda Healthcare Holding GmbH 7,500 % fällig am 21.08.2026		100	110	1,13	Telefonica Europe BV 5,752 % fällig am 15.01.2032 (a)	€	100	110	1,12	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 7,000 % fällig am 01.05.2031		75	77	0,79		
Schaeffler AG 4,750 % fällig am 14.08.2029		100	108	1,10	Summe Niederlande			188	1,92	Freedom Mortgage Holdings LLC 9,125 % fällig am 15.05.2031		25	24	0,24		
Summe Deutschland			329	3,37	<b>PORTUGAL</b>				9,250 % fällig am 01.02.2029		25	25	0,26			
<b>IRLAND</b>																
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>																
Jazz Securities DAC 4,375 % fällig am 15.01.2029	\$	75	70	0,71	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Frontier Communications Holdings LLC 6,000 % fällig am 15.01.2030		75	65	0,66			
<b>ITALIEN</b>																
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>																
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 4,750 % fällig am 15.03.2029	€	100	108	1,11	<b>SPANIEN</b>				Gap, Inc. 3,625 % fällig am 01.10.2029		75	65	0,66			
												Graphic Packaging International LLC 3,750 % fällig am 01.02.2030		75	67	0,68
												Hologic, Inc. 3,250 % fällig am 15.02.2029		75	67	0,68
												Howard Hughes Corp. 4,125 % fällig am 01.02.2029		75	67	0,68
												Hudson Pacific Properties LP 5,950 % fällig am 15.02.2028		75	64	0,65
												Imola Merger Corp. 4,750 % fällig am 15.05.2029		75	70	0,72
												IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.03.2029	€	125	122	1,25
												Kinetik Holdings LP 6,625 % fällig am 15.12.2028	\$	75	76	0,78
												Kronos International, Inc. 9,500 % fällig am 15.03.2029	€	100	117	1,20
												LABL, Inc. 5,875 % fällig am 01.11.2028	\$	75	69	0,70
												LFS Topco LLC 5,875 % fällig am 15.10.2026		75	69	0,70
												LifePoint Health, Inc. 11,000 % fällig am 15.10.2030		50	55	0,56
												Live Nation Entertainment, Inc. 3,750 % fällig am 15.01.2028		100	93	0,95
												Medline Borrower LP 3,875 % fällig am 01.04.2029		75	69	0,71
												Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 7,125 % fällig am 01.02.2032		75	76	0,78

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
NESCO Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.04.2029	\$ 75	\$ 70	0,72	Reworld Holding Corp. 4,875 % fällig am 01.12.2029	\$ 75	\$ 69	0,71	Vertiv Group Corp. 4,125 % fällig am 15.11.2028	\$ 75	\$ 70	0,72
Newmark Group, Inc. 7,500 % fällig am 12.01.2029	75	77	0,79	Ritchie Bros Holdings, Inc. 7,750 % fällig am 15.03.2031	75	78	0,80	Victoria's Secret & Co. 4,625 % fällig am 15.07.2029	75	62	0,63
NextEra Energy Operating Partners LP 3,875 % fällig am 15.10.2026	75	71	0,73	Rocket Mortgage LLC 3,625 % fällig am 01.03.2029	75	68	0,69	Vornado Realty LP 2,150 % fällig am 01.06.2026	75	69	0,71
OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027	75	70	0,72	Sabre GBL, Inc. 8,625 % fällig am 01.06.2027	75	69	0,71	WMG Acquisition Corp. 3,750 % fällig am 01.12.2029	100	91	0,93
Open Text Holdings, Inc. 4,125 % fällig am 15.02.2030	75	68	0,69	Service Properties Trust 8,375 % fällig am 15.06.2029	75	74	0,76	XPO, Inc. 7,125 % fällig am 01.06.2031	75	77	0,79
Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % fällig am 01.04.2053	50	52	0,53	Sirius XM Radio, Inc. 5,000 % fällig am 01.08.2027	100	96	0,98	Yum! Brands, Inc. 4,625 % fällig am 31.01.2032	75	69	0,71
Park Intermediate Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.05.2029	75	70	0,72	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	100	102	1,04	ZF North America Capital, Inc. 6,750 % fällig am 23.04.2030	125	127	1,30
PennyMac Financial Services, Inc. 5,750 % fällig am 15.09.2031	100	94	0,96	Tenet Healthcare Corp. 4,625 % fällig am 15.06.2028	\$ 50	48	0,49	ZipRecruiter, Inc. 5,000 % fällig am 15.01.2030	75	65	0,66
PetSmart, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2028	75	70	0,72	TopBuild Corp. 3,625 % fällig am 15.03.2029	75	67	0,68	Summe USA		5.375	54,98
Post Holdings, Inc. 4,625 % fällig am 15.04.2030	75	69	0,71	TriNet Group, Inc. 7,125 % fällig am 15.08.2031	75	76	0,78	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	8.846	90,47
Prime Security Services Borrower LLC 3,375 % fällig am 31.08.2027	75	70	0,72	Uber Technologies, Inc. 4,500 % fällig am 15.08.2029	75	72	0,74				
Raising Cane's Restaurants LLC 9,375 % fällig am 01.05.2029	50	54	0,55	United Rentals North America, Inc. 6,125 % fällig am 15.03.2034	125	125	1,28				

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	2	\$ 2	0,02
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	1	(1)	(0,01)
				\$ 1	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 1	0,01

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 2.545	\$ 2.734	\$ 7	\$ 0	\$ 7	0,07
CBK	07.2024	£ 3	4	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	CAD 81	59	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	\$ 59	CAD 81	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 4	3	0	0	0	0,00
	08.2024	CAD 81	\$ 59	0	0	0	0,00
	08.2024	£ 3	4	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	\$ 2.727	€ 2.545	1	0	1	0,01
	08.2024	€ 2.545	\$ 2.731	0	(1)	(1)	(0,01)
				\$ 8	\$ (1)	\$ 7	0,07

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
GLM	07.2024	\$ 87	€ 81	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
MBC	07.2024	€ 81	\$ 87	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 87	€ 81	0	(1)	(1)	(0,01)
	08.2024	€ 87	81	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	€ 81	\$ 87	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 87	€ 81	0	0	0	0,00
	08.2024	87	81	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
CBK	07.2024	£ 71	\$ 90	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00		
	08.2024	\$ 90	£ 71	0	0	0	0,00		
MBC	07.2024	£ 69	\$ 88	0	0	0	0,00		
	07.2024	\$ 176	£ 138	0	(1)	(1)	(0,01)		
MYI	08.2024	88	69	0	0	0	0,00		
	07.2024	88	69	0	(1)	(1)	(0,01)		
						\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	(0,02)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ 4</b>	<b>0,04</b>		
<b>Summe Anlagen</b>						<b>\$ 8.851</b>	<b>90,52</b>		
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>\$ 927</b>	<b>9,48</b>		
<b>Nettovermögen</b>						<b>\$ 9.778</b>	<b>100,00</b>		

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

Barmittel in Höhe von 12 USD wurden als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
	Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 8.846	
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1	4	0	5
<b>Summen</b>	<b>\$ 1</b>	<b>\$ 8.850</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 8.851</b>

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 7	\$ 0	\$ 7
MBC	(2)	0	(2)
MYI	(1)	0	(1)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

(2) Der Global High Yield Bond ESG Fund wurde am 17. Juni 2024 aufgelegt.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	33,52
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	56,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate	0,04

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

(1) Der Global High Yield Bond ESG Fund wurde am 17. Juni 2024 aufgelegt.





BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGE NS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGE NS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGE NS
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>IRLAND</b>				<b>ITA LIEN</b>			
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	€ 6.800	\$ 6.975	0,08	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Hamburg Commercial Bank AG	100	101	0,00	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				Nexi SpA			
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)	19.590	20.720	0,23	2,800 % fällig am 23.06.2030 \$ 6.600				2,125 % fällig am 30.04.2029 (l) € 10.250 \$ 9.950			
Robert Bosch GmbH	2.000	2.152	0,02	4,450 % fällig am 20.02.2029				Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA			
3,625 % fällig am 02.06.2030	2.200	2.404	0,03					3,500 % fällig am 09.10.2025			
4,000 % fällig am 02.06.2035	300	328	0,00					UniCredit SpA			
4,375 % fällig am 02.06.2043								5,375 % fällig am 16.04.2034			
Sixt SE	10.958	11.628	0,13	Summe Indonesien							
1,750 % fällig am 09.12.2024				17.076				18.396			
Volkswagen Bank GmbH	400	438	0,00					176.334			
4,375 % fällig am 03.05.2028	5.300	5.881	0,06					1.99			
4,625 % fällig am 03.05.2031											
Volkswagen Leasing GmbH	5.000	5.147	0,06								
1,500 % fällig am 19.06.2026	5.300	5.704	0,06								
3,875 % fällig am 11.10.2028											
Vonovia SE	400	362	0,00								
0,500 % fällig am 14.09.2029	1.000	792	0,01								
1,125 % fällig am 14.09.2034											
Vonovia SE	8.900	8.222	0,09								
0,250 % fällig am 01.09.2028											
Summe Deutschland		136.925	1,50								
<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>JAPAN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Delos Aircraft DAC</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Amdocs Ltd.				7,052 % fällig am 31.10.2027 \$ 10.425				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
2,538 % fällig am 15.06.2030	\$ 5.875	5.016	0,06					<b>Asahi Group Holdings Ltd.</b>			
Globalworth Real Estate Investments Ltd.	€ 216	223	0,00					0,541 % fällig am 23.10.2028 € 900			
6,250 % fällig am 31.03.2029	12.568	12.609	0,14					3,464 % fällig am 16.04.2032			
6,250 % fällig am 31.03.2030								Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
Sirius Real Estate Ltd.	8.300	8.352	0,09					0,953 % fällig am 19.07.2025 \$ 9.400			
1,125 % fällig am 22.06.2026	11.000	10.245	0,11					1,538 % fällig am 20.07.2027			
1,750 % fällig am 24.11.2028								2,048 % fällig am 17.07.2030			
Summe Guernsey, Kanalinseln		36.445	0,40					3,195 % fällig am 18.07.2029			
								5,422 % fällig am 22.02.2029			
<b>HONGKONG</b>				<b>ISRAEL</b>				<b>Mizuho Financial Group, Inc.</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				1,979 % fällig am 08.09.2031			
AIA Group Ltd.	\$ 300	294	0,01	Israel Government International Bond				7,100			
4,950 % fällig am 04.04.2033				5,000 % fällig am 30.10.2026 € 8.500				5,811			
Lenovo Group Ltd.	6.400	5.662	0,06	5,375 % fällig am 12.03.2029 \$ 21.700				9,100			
3,421 % fällig am 02.11.2030				5,500 % fällig am 12.03.2034				7.595			
Summe Hongkong		5.956	0,07	1.800				4,822			
								5,94 % fällig am			
<b>UNGARN</b>				<b>ITALIEN</b>				<b>Nippon Life Insurance Co.</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,250 % fällig am 13.09.2053			
Hungarian Development Bank	4.000	4.074	0,04	<b>AMCO - Asset Management Co. SpA</b>				Nissan Motor Co. Ltd.			
6,500 % fällig am 29.06.2028				4,625 % fällig am 06.02.2027 € 4.609				4,345 % fällig am 17.09.2027			
								10,557			
								10,084			
<b>INDIEN</b>				<b>ISRAEL</b>				<b>Nomura Holdings, Inc.</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				1,851 % fällig am 16.07.2025			
Adani Transmission Step-One Ltd.	15.629	12.987	0,14	Israel Government International Bond				11,950			
4,250 % fällig am 21.05.2036				5,000 % fällig am 30.10.2026 € 8.500				11,484			
IRB Infrastructure Developers Ltd.	5.500	5.500	0,06	5,375 % fällig am 12.03.2029 \$ 21.700				5,000			
7,110 % fällig am 11.03.2032				5,500 % fällig am 12.03.2034				4,416			
Summe Indien		18.487	0,20	1.800				1,800			
								5,500			
<b>INDONESIA</b>				<b>ITALIEN</b>				<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,010 % fällig am 10.09.2025 € 1.000			
Indonesia Asahan Aluminium PT	900	891	0,01	<b>AMCO - Asset Management Co. SpA</b>				Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.			
4,750 % fällig am 15.05.2025				4,625 % fällig am 06.02.2027 € 4.609				2,130 % fällig am 08.07.2030 \$ 3.500			
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara	7.800	5.623	0,06					2,696 % fällig am 16.07.2024			
4,000 % fällig am 30.06.2050	1.400	1.351	0,01					2,750 % fällig am 15.01.2030			
4,125 % fällig am 15.05.2027	700	578	0,01					3,040 % fällig am 16.07.2029			
4,875 % fällig am 17.07.2049	2.300	2.272	0,03					5,464 % fällig am 13.01.2026			
6,150 % fällig am 21.05.2048								6,000 % fällig am 13.01.2028			
Summe Indonesien		10.715	0,12					5,520 % fällig am 13.01.2028			
								5,710 % fällig am 13.01.2030			
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				<b>ISRAEL</b>				<b>Santory Holdings Ltd.</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				2,250 % fällig am 16.10.2024			
AA Bond Co. Ltd.	£ 7.682	9.483	0,10	Israel Government International Bond				900			
5,500 % fällig am 31.07.2050				5,000 % fällig am 30.10.2026 € 8.500				891			
G City Europe Ltd.	€ 24.641	25.509	0,28	5,375 % fällig am 12.03.2029 \$ 21.700				165.672			
4,250 % fällig am 11.09.2025				5,500 % fällig am 12.03.2034				1,82			
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	\$ 4.000	3.257	0,04	1.800							
2,625 % fällig am 31.03.2036											
Gatwick Funding Ltd.	£ 300	330	0,00								
2,500 % fällig am 15.04.2032	1.400	1.074	0,01								
2,625 % fällig am 07.10.2048	1.600	1.489	0,02								
3,125 % fällig am 28.09.2041											
Heathrow Funding Ltd.	€ 3.800	3.512	0,04								
1,875 % fällig am 12.07.2032	£ 1.200	1.356	0,01								
2,750 % fällig am 13.10.2031	€ 5.000	5.509	0,06								
4,500 % fällig am 11.07.2035											
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP	£ 8.867	11.610	0,13								
5,844 % fällig am											
05.11.2031 (h)											

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	€ 1.100	\$ 1.124	0,01	3,000 % fällig am 03.12.2026 (g)	MXN 164.433	\$ 8.316	0,09	2,000 % fällig am 20.01.2030	€ 7.200	\$ 6.715	0,07
Summe Jersey, Kanalinseln		64.253	0,70	4,000 % fällig am 30.11.2028 (g)	278.756	14.266	0,16	3,375 % fällig am 14.07.2027	7.311	7.621	0,08
<b>KASACHSTAN</b>				4,000 % fällig am 24.08.2034 (g)	8.128	398	0,01	Prosus NV			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,350 % fällig am 09.02.2035	\$ 10.000	10.080	0,11	1,539 % fällig am 03.08.2028	3.700	3.562	0,04
KazMunayGas National Co. JSC 3,500 % fällig am 14.04.2033	\$ 4.000	3.282	0,04	Summe Mexiko		84.444	0,93	2,031 % fällig am 03.08.2032	25.387	22.187	0,24
<b>LIBERIA</b>								4,027 % fällig am 03.08.2050	\$ 3.800	2.575	0,03
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								4,193 % fällig am 19.01.2032	3.800	3.354	0,04
Royal Caribbean Cruises Ltd.								Sagax Euro MTN NL BV			
3,700 % fällig am 15.03.2028	7.400	6.920	0,08					1,625 % fällig am 24.02.2026	€ 5.900	6.082	0,07
5,500 % fällig am 31.08.2026	3.000	2.969	0,03	<b>MULTINATIONAL</b>				Sandoz Finance BV			
5,500 % fällig am 01.04.2028	7.600	7.508	0,08	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,970 % fällig am 17.04.2027	7.400	8.014	0,09
9,250 % fällig am 15.01.2029	3.700	3.953	0,04	Delta Air Lines, Inc. 4,750 % fällig am 20.10.2028	3.125	3.045	0,03	4,220 % fällig am 17.04.2030	8.600	9.416	0,10
Summe Liberia		21.350	0,23	<b>NIEDERLANDE</b>				Sartorius Finance BV			
<b>LUXEMBURG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,875 % fällig am 14.09.2035	400	447	0,00
Aroundtown S.A.				Achmea Bank NV 3,750 % fällig am 19.10.2026	€ 5.500	5.943	0,07	Siemens Financieringsmaatschappij NV			
3,000 % fällig am 16.10.2029	£ 1.300	1.313	0,01	American Medical Systems Europe BV 0,750 % fällig am 08.03.2025	1.000	1.050	0,01	3,125 % fällig am 22.05.2032	2.500	2.642	0,03
5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 10.900	9.713	0,11	ASR Nederland NV 3,375 % fällig am 02.05.2049	4.300	4.338	0,05	Unilever Finance Netherlands BV			
Becton Dickinson Euro Finance SARL 0,334 % fällig am 13.08.2028	€ 4.347	4.087	0,04	7,000 % fällig am 07.12.2043	2.600	3.154	0,03	3,500 % fällig am 15.02.2037	2.300	2.459	0,03
1,336 % fällig am 13.08.2041	5.180	3.671	0,04	BP Capital Markets BV 4,323 % fällig am 12.05.2035	2.500	2.774	0,03	Volkswagen Financial Services NV			
CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan European Core Fund				Cooperatieve Rabobank UA 4,375 % fällig am 29.06.2027 (h)(j)	19.000	19.383	0,21	0,875 % fällig am 20.02.2025	£ 6.400	7.876	0,09
4,750 % fällig am 27.03.2034	9.600	10.436	0,11	CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	5.196	5.379	0,06	1,875 % fällig am 03.12.2024	1.800	2.243	0,02
CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	4.869	3.686	0,04	1,250 % fällig am 21.06.2029	4.700	4.377	0,05	5,500 % fällig am 07.12.2026	1.000	1.265	0,01
1,750 % fällig am 14.01.2030	10.150	8.251	0,09	Danfoss Finance BV 0,125 % fällig am 28.04.2026	2.000	2.011	0,02	Volkswagen International Finance NV			
Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	20.476	21.108	0,23	Digital Dutch Finco BV 1,000 % fällig am 15.01.2032	2.600	2.233	0,02	7,875 % fällig am 06.09.2032 (h)	€ 2.900	3.518	0,04
Helvetia Europe S.A. 2,750 % fällig am 30.09.2041	4.600	4.336	0,05	1,250 % fällig am 01.02.2031	9.688	8.659	0,10	Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	1.400	1.392	0,02
Logicor Financing SARL 1,625 % fällig am 15.07.2027	24.501	24.241	0,27	Enel Finance International NV 1,875 % fällig am 12.07.2028	\$ 600	528	0,01	Summe Niederlande		334.481	3,66
Nestle Finance International Ltd. 3,250 % fällig am 23.01.2037	3.800	3.954	0,04	2,650 % fällig am 10.09.2024	3.000	2.980	0,03	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
P3 Group SARL 1,625 % fällig am 26.01.2029	5.700	5.428	0,06	3,875 % fällig am 23.01.2035	€ 10.000	10.518	0,12	EMF-NL Prime BV 4,688 % fällig am 17.04.2041	271	284	0,00
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	\$ 61.150	3.669	0,04	5,125 % fällig am 26.06.2029	\$ 17.400	17.133	0,19	Green Lion BV 0,000 % fällig am 23.10.2060 (b)	3.600	3.861	0,04
5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(j)	12.200	732	0,01	Haleon Netherlands Capital BV 1,250 % fällig am 29.03.2026	€ 1.000	1.028	0,01	Summe		4.145	0,04
TMS Issuer SARL 5,780 % fällig am 23.08.2032	7.000	7.142	0,08	Heineken NV 3,812 % fällig am 04.07.2036 (b)	1.700	1.816	0,02	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Luxemburg		111.767	1,22	Holcim Sterling Finance Netherlands BV 2,250 % fällig am 04.04.2034	€ 1.200	1.156	0,01	BNG Bank NV 2,375 % fällig am 16.03.2026	\$ 9.200	8.818	0,10
<b>MEXIKO</b>				IMCD NV 4,875 % fällig am 18.09.2028	€ 4.600	5.071	0,06	Summe Niederlande		334.481	3,66
<b>STAMMAKTIE</b>				Imperial Brands Finance Netherlands BV 5,250 % fällig am 15.02.2031	7.000	7.881	0,09	<b>NORWEGEN</b>			
Desarrolladora Homex S.A.B. de C.V. (d)	427.064	0	0,00	ING Bank NV 2,750 % fällig am 10.01.2032	9.300	9.727	0,11	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
<b>AKTIEN</b>				ING Groep NV 5,550 % fällig am 19.03.2035	\$ 18.400	18.174	0,20	Aker BP ASA 4,000 % fällig am 29.05.2032	€ 11.500	12.266	0,13
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,250 % fällig am 20.05.2033	€ 4.900	6.232	0,07	Sparebanken Vest Boligkreditt A/S 3,375 % fällig am 15.11.2028	2.000	2.166	0,02
Banco Mercantil del Norte S.A. 6,625 % fällig am 24.01.2032 (h)(j)	\$ 9.400	8.261	0,09	8,000 % fällig am 16.05.2030 (h)(j)	\$ 3.000	3.063	0,03	SR-Boligkreditt A/S 3,125 % fällig am 19.02.2032	5.700	6.091	0,07
Petroleos Mexicanos 2,750 % fällig am 21.04.2027	€ 200	190	0,00	JAB Holdings BV 1,000 % fällig am 20.12.2027	€ 5.000	4.914	0,05	Var Energi ASA 5,500 % fällig am 04.05.2029	5.000	5.675	0,06
4,875 % fällig am 21.02.2028	500	489	0,01	2,200 % fällig am 23.11.2030	\$ 7.420	5.982	0,07	8,000 % fällig am 15.11.2032	\$ 9.800	10.988	0,12
10,000 % fällig am 07.02.2033 (l)	\$ 8.000	8.034	0,09	2,250 % fällig am 19.12.2039	€ 4.800	3.869	0,04	Yara International ASA 4,750 % fällig am 01.06.2028	8.147	7.941	0,09
Trust Fibra Uno 4,869 % fällig am 15.01.2030	1.900	1.669	0,02	5,000 % fällig am 17.04.2027	5.000	5.206	0,06	Summe Norwegen		45.127	0,49
7,375 % fällig am 13.02.2034	7.200	7.112	0,07	5,000 % fällig am 12.06.2033	3.300	3.742	0,04	<b>PANAMA</b>			
				JDE Peet's NV 4,125 % fällig am 23.01.2030	8.500	9.213	0,10	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				4,500 % fällig am 23.01.2034	21.200	23.185	0,25	Carnival Corp. 4,000 % fällig am 01.08.2028	9.700	9.116	0,10
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031 (g)	MXN 556.536	25.629	0,28	LeasePlan Corp. NV 2,875 % fällig am 24.10.2024	\$ 1.020	1.011	0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				LKQ Dutch Bond BV 4,125 % fällig am 13.03.2031	€ 2.900	3.106	0,03	Panama Government International Bond 6,400 % fällig am 14.02.2035	5.000	4.749	0,05
				Lseg Netherlands BV 4,231 % fällig am 29.09.2030	7.000	7.749	0,08	7,500 % fällig am 01.03.2031	5.000	5.239	0,06
				Mercedes-Benz International Finance BV 3,000 % fällig am 10.07.2027	1.000	1.062	0,01	Summe Panama		19.104	0,21
				MSD Netherlands Capital BV 3,250 % fällig am 30.05.2032	12.200	12.966	0,14	<b>PERU</b>			
				NE Property BV 1,875 % fällig am 09.10.2026	3.500	3.537	0,04	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 9.800	2.542	0,03















## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>INVESTMENTFONDS</b>							
<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>							
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (i)	11.356.637	\$ 115.043	1,26	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)	7.036.357	\$ 70.121	0,77
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (i)	3.787.451	36.738	0,40	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (i)	329.257	4.535	0,05
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (i)	3.637.652	45.185	0,49			271.622	2,97
				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (i)	2.587.040	258.847	2,84
				<b>Summe Investmentfonds</b>		<b>\$ 530.469</b>	<b>5,81</b>

### PENSIONS-GESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 1.689	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 31.12.2025	\$ (1.723)	\$ 1.689	\$ 1.689	0,02
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (1.723)</b>	<b>\$ 1.689</b>	<b>\$ 1.689</b>	<b>0,02</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	445	\$ 287	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	472	(586)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	3.613	6.639	0,07
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	14	46	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	2.184	1.023	0,01
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	63	91	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	2.387	1.383	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	807	(443)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	2.444	1.795	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	933	(537)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	372	294	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	234	94	0,00
				\$ 10.086	0,11
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ 10.086</b>	<b>0,11</b>

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	\$ 7.900	\$ (1.035)	(0,01)
AES Corp.	5,000	20.06.2026	2.400	(284)	0,00
Airbus SE	1,000	20.06.2029	€ 14.700	14	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2027	\$ 8.000	210	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2024	7.600	(101)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.000	(7)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	54.000	(248)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	1.300	(3)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	29.600	626	0,01
Boeing Co.	1,000	20.06.2025	7.000	130	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	900	18	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	1.000	9	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2029	8.400	(60)	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 6.800	(37)	0,00
Cellnex Telecom S.A.	5,000	20.12.2030	7.400	214	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	\$ 5.000	(456)	(0,01)
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	27.900	450	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	18.750	88	0,00

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2026	\$ 2.000	\$ 17	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	2.050	(186)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	2.435	77	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2028	€ 2.700	20	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2031	9.500	(93)	0,00
Hess Corp.	1,000	20.06.2026	\$ 7.000	166	0,00
Lennar Corp.	5,000	20.12.2026	3.200	(310)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2028	600	23	0,00
Mundys SpA	1,000	20.12.2025	€ 1.800	98	0,00
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 11.300	(108)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 9.000	4	0,00
Southwest Airlines Co.	1,000	20.12.2026	\$ 3.100	41	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	7.800	(25)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	€ 63.700	375	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2024	\$ 14.400	11	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	1.900	(20)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	500	17	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	9.400	192	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	2.300	45	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2026	€ 4.100	(42)	0,00
				\$ (170)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 41 5-Year Index	5,000 %	20.06.2029	€ 10.200	\$ (184)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000 %	18.09.2029	£ 74.200	\$ (894)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.09.2024	¥ 1.829.900	16	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.03.2028	1.155.900	99	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	18.12.2025	\$ 100.300	1.497	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	74.365	913	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	05.06.2034	9.000	(45)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,160	31.05.2025	87.200	(28)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,815	04.01.2027	BRL 224.800	(1.572)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,832	04.01.2027	204.800	(1.418)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,835	04.01.2027	356.000	(2.462)	(0,03)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Year BRL-CDI	9,842	04.01.2027	50.300	(347)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,500	17.06.2030	CAD 244.800	2.248	0,02
Zahlung <sup>(3)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	18.12.2025	173.000	(308)	0,00
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.06.2032	57.900	(462)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	AUD 30.700	540	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	9.800	289	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 88.530	40.274	0,44
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,175	17.03.2033	214.110	(48.361)	(0,53)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	31.200	(371)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	88.900	(6.251)	(0,07)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	5.400	(376)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	62.700	(3.768)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	28.000	(1.672)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	9.300	471	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	47.700	(752)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	05.03.2034	6.200	(47)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	92.200	(2.361)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	04.03.2034	6.300	(42)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	16.04.2029	9.100	(57)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	29.04.2034	5.500	(22)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029	9.100	(47)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029	9.300	(26)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029	7.200	36	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	7.400	455	0,01
					\$ (24.851)	(0,27)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					\$ (25.205)	(0,28)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximale mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.



Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	05.07.2024	4.200	\$ (16)	\$ (4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,990	23.07.2024	4.100	(16)	(27)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	8.100	(32)	(43)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	4.200	(16)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,800	03.07.2024	4.700	(19)	(6)	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,150	03.07.2024	4.700	(19)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	9.100	(15)	(21)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	9.100	(15)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	8.000	(21)	(16)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	8.000	(30)	(22)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	8.100	(34)	(25)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	8.000	(30)	(46)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	8.000	(21)	(35)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	8.100	(34)	(9)	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	17.07.2024	9.200	(16)	(6)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	22.07.2024	9.100	(15)	(8)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	9.100	(14)	(13)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	22.07.2024	9.100	(15)	(20)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,970	17.07.2024	9.200	(16)	(14)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	9.100	(14)	(7)	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	4.100	(13)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	4.100	(13)	(19)	0,00
							\$ (1.546)	\$ (2.454)	(0,03)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	\$ 97,266	08.07.2024	4.500	\$ (9)	\$ (6)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,719	08.07.2024	3.300	(6)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	95,594	06.08.2024	5.800	(13)	(20)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	98,594	06.08.2024	5.800	(11)	(7)	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,969	08.07.2024	5.900	(20)	(2)	0,00
					\$ (59)	\$ (37)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 1.100	\$ (38)	\$ 41	\$ 3	0,00
BRC	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	7.800	170	(88)	82	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	31.400	(1.186)	1.295	109	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	5.700	(5)	49	44	0,00
GST	Equinix, Inc.	5,000	20.06.2027	4.500	629	(116)	513	0,01
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	5.700	(7)	51	44	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.400	33	(11)	22	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.700	(229)	249	20	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	4.400	(99)	110	11	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2024	8.100	112	(76)	36	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	7.600	(1)	59	58	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	15.800	(978)	945	(33)	0,00
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	7.900	0	59	59	0,00
	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	1,000	20.12.2024	16.500	322	(247)	75	0,00
	Pioneer Natural Resources Co.	1,000	20.06.2025	8.400	(408)	483	75	0,00
					\$ (1.685)	\$ 2.803	\$ 1.118	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	iTraxx Japan 41 5-Year Index	1,000 %	20.06.2029	¥ 8.512.000	\$ 1.569	\$ (350)	\$ 1.219	0,01
JPM	iTraxx Japan 41 5-Year Index	1,000	20.06.2029	5.273.000	993	(238)	755	0,01
					\$ 2.562	\$ (588)	\$ 1.974	0,02

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD 167.686	\$ 111.724	\$ 0	\$ (266)	\$ (266)	0,00
	07.2024	NZD 5.100	3.123	16	0	16	0,00
	08.2024	\$ 3.123	NZD 5.100	0	(16)	(16)	0,00
BOA	07.2024	SGD 310	\$ 228	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2.782	€ 2.552	0	(47)	(47)	0,00
	07.2024	17.274	SGD 23.446	26	0	26	0,00
BPS	08.2024	SGD 23.412	\$ 17.274	0	(26)	(26)	0,00
	08.2024	TRY 1.594	46	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 1.734.543	1.877.756	18.760	0	18.760	0,21
BRC	07.2024	£ 315.235	402.650	4.162	0	4.162	0,05
	07.2024	IDR 468.297.758	28.585	0	(37)	(37)	0,00
	07.2024	¥ 180.700	1.157	33	0	33	0,00
CBK	07.2024	KRW 46.777.921	33.944	0	(19)	(19)	0,00
	07.2024	PLN 1.430	353	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	TWD 670.763	20.731	60	0	60	0,00
DUB	07.2024	\$ 192.948	AUD 289.575	445	0	445	0,00
	07.2024	2.356	CAD 3.227	2	0	2	0,00
	07.2024	1.815.910	€ 1.697.747	3.651	0	3.651	0,04
FAR	07.2024	30.685	IDR 501.115.398	4	(62)	(58)	0,00
	07.2024	701	ILS 2.599	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	3.367	INR 281.837	14	0	14	0,00
GLM	07.2024	6.912	NZD 11.251	0	(56)	(56)	0,00
	07.2024	354	PLN 1.430	2	0	2	0,00
	08.2024	AUD 288.053	\$ 192.095	0	(442)	(442)	0,00
JPM	08.2024	€ 1.697.747	1.818.562	0	(3.652)	(3.652)	(0,04)
	10.2024	CNH 167.473	23.288	154	0	154	0,00
	05.2029	KWD 2.365	8.131	234	0	234	0,00
MBC	07.2024	DKK 48.490	7.059	91	0	91	0,00
	07.2024	MXN 52.930	2.865	0	(24)	(24)	0,00
	07.2024	SGD 22.030	16.309	53	0	53	0,00
MBC	07.2024	THB 3.670	100	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.771	CAD 2.417	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	981	NOK 10.320	0	(12)	(12)	0,00
MBC	07.2024	37.680	PLN 150.522	0	(245)	(245)	0,00
	07.2024	17.846	TRY 606.480	554	0	554	0,01
	08.2024	10.956	378.427	54	0	54	0,00
MBC	09.2024	MXN 349.641	\$ 18.666	0	(227)	(227)	0,00
	09.2024	\$ 10.646	MXN 202.693	307	0	307	0,00
	09.2024	6.464	TRY 236.634	242	0	242	0,00
MBC	07.2024	AUD 375	\$ 250	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	£ 1.138	1.455	17	0	17	0,00
	07.2024	\$ 1.305	CAD 1.793	5	0	5	0,00
MBC	07.2024	12	CHF 11	0	0	0	0,00
	07.2024	1.231	€ 1.147	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	1.272	TRY 42.893	6	0	6	0,00
MBC	08.2024	CAD 2.228	\$ 1.630	0	0	0	0,00
	08.2024	PEN 3.521	932	13	0	13	0,00
	09.2024	3.440	923	25	0	25	0,00
MBC	09.2024	\$ 15.821	INR 1.322.707	12	(6)	6	0,00
	10.2024	CNH 405.871	\$ 56.376	312	0	312	0,00
	07.2024	AUD 39.109	25.884	0	(235)	(235)	0,00
MBC	09.2024	PEN 27.364	7.354	211	0	211	0,00
	07.2024	AUD 84.264	56.142	0	(134)	(134)	0,00
	07.2024	NZD 9.801	5.978	5	0	5	0,00
MBC	08.2024	\$ 5.978	NZD 9.801	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	KRW 4.295.769	\$ 3.119	0	0	0	0,00
	07.2024	TWD 154.392	4.773	15	0	15	0,00
MBC	07.2024	\$ 10.634	MXN 197.465	144	0	144	0,00
	08.2024	19.235	BRL 101.741	0	(984)	(984)	(0,01)
	08.2024	3.267	TRY 112.739	20	0	20	0,00
MBC	07.2024	AUD 1.522	\$ 1.014	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	CAD 68.141	49.589	0	(209)	(209)	0,00
	07.2024	ILS 2.585	699	12	0	12	0,00
MBC	07.2024	KRW 4.284.356	3.110	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	SGD 940	698	5	0	5	0,00
	07.2024	TWD 222.366	6.874	21	0	21	0,00
MBC	07.2024	\$ 37.104	CHF 33.297	0	(49)	(49)	0,00
	07.2024	10.511	DKK 73.252	16	0	16	0,00
	07.2024	1.418	INR 118.672	6	0	6	0,00
MBC	07.2024	12.588	TRY 428.108	341	0	341	0,00
	08.2024	CHF 33.174	\$ 37.104	48	0	48	0,00
	08.2024	DKK 73.123	10.511	0	(16)	(16)	0,00
MBC	08.2024	\$ 1.015	AUD 1.522	2	0	2	0,00
	09.2024	2.153	INR 180.417	6	0	6	0,00
	07.2024	CAD 284.824	\$ 209.182	1.031	0	1.031	0,01
MBC	07.2024	DKK 125	18	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 8.027	754	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 122	90	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	\$ 250.827	CAD 343.421	148	0	148	0,00
	07.2024	49.932	€ 46.219	0	(396)	(396)	0,00
	07.2024	20.878	£ 16.375	0	(178)	(178)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 1.772	INR 148.341	\$ 7	\$ 0	\$ 7	0,00
	08.2024	CAD 343.191	\$ 250.827	0	(157)	(157)	0,00
MYI	08.2024	\$ 754	NOK 8.021	0	0	0	0,00
	07.2024	CHF 33.697	\$ 37.653	154	0	154	0,00
	07.2024	€ 379	405	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	£ 49	62	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 2.292	215	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 69	6	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 185	137	0	0	0	0,00
	07.2024	TWD 245.040	7.575	23	0	23	0,00
	07.2024	\$ 1.697	CAD 2.322	0	0	0	0,00
	07.2024	7.203	DKK 50.275	22	0	22	0,00
	07.2024	8.233	€ 7.679	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	7.548	£ 5.967	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	49.244	INR 4.121.731	191	0	191	0,00
	07.2024	6.795	NZD 11.079	0	(44)	(44)	0,00
	07.2024	18	SEK 196	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK 50.186	\$ 7.203	0	(22)	(22)	0,00
	08.2024	\$ 215	NOK 2.291	0	0	0	0,00
	09.2024	1.440	INR 120.427	1	0	1	0,00
RBC	07.2024	380.428	£ 299.998	0	(1.201)	(1.201)	(0,01)
	08.2024	£ 299.998	\$ 380.493	1.196	0	1.196	0,01
RYL	07.2024	€ 12.301	13.159	0	(24)	(24)	0,00
	07.2024	\$ 2.256	AUD 3.381	2	0	2	0,00
SCX	07.2024	€ 8.105	\$ 8.707	21	0	21	0,00
	07.2024	IDR 984.720	60	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 21.523.026	15.628	2	0	2	0,00
	07.2024	TWD 512.676	15.848	49	0	49	0,00
	07.2024	\$ 18	MXN 343	0	0	0	0,00
	07.2024	37.742	ZAR 695.498	299	0	299	0,00
	08.2024	PEN 4.088	\$ 1.081	14	0	14	0,00
	09.2024	\$ 9.768	INR 817.507	14	0	14	0,00
TOR	07.2024	NZD 7.429	\$ 4.550	23	0	23	0,00
	08.2024	\$ 4.550	NZD 7.429	0	(23)	(23)	0,00
UAG	07.2024	DKK 75.059	\$ 10.901	114	0	114	0,00
	07.2024	\$ 151	CHF 136	1	0	1	0,00
	08.2024	CHF 18	\$ 20	0	0	0	0,00
				\$ 33.418	\$ (8.849)	\$ 24.569	0,27

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD 2.791	\$ 1.859	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	07.2024	\$ 3.729	AUD 5.602	12	0	12	0,00
	08.2024	1.861	2.791	5	0	5	0,00
BPS	07.2024	AUD 2.791	\$ 1.860	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	\$ 1.862	AUD 2.791	4	0	4	0,00
BRC	07.2024	1.752	2.647	16	0	16	0,00
CBK	07.2024	AUD 4	\$ 2	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	46	31	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	152	101	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 49	AUD 73	0	0	0	0,00
				\$ 37	\$ (9)	\$ 28	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) ausschüttend, Administrative CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 178.939	CHF 160.958	\$ 181	\$ 0	\$ 181	0,00
BRC	07.2024	CHF 161	\$ 181	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 743	CHF 660	0	(8)	(8)	0,00
CBK	07.2024	CHF 206	\$ 226	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	\$ 18.076	CHF 16.450	231	0	231	0,00
GLM	07.2024	524	470	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2024	CHF 193.301	\$ 215.401	287	0	287	0,00
	07.2024	\$ 69	CHF 62	1	0	1	0,00
	08.2024	215.352	192.544	0	(281)	(281)	0,00
MBC	07.2024	CHF 1.623	\$ 1.819	13	0	13	0,00
	07.2024	\$ 63	CHF 57	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	471	421	0	(1)	(1)	0,00
MYI	07.2024	CHF 238	\$ 265	1	(1)	0	0,00
	07.2024	\$ 145	CHF 130	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2024	CHF 493	\$ 552	4	0	4	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
TOR	07.2024	\$ 3.910	CHF 3.514	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
UAG	07.2024	210.718	190.340	1.100	0	1.100	0,01
	07.2024	CHF 192.041	\$ 214.040	328	0	328	0,01
	07.2024	\$ 208.061	CHF 188.018	1.173	0	1.173	0,01
	08.2024	214.040	191.331	0	(323)	(323)	0,00
				\$ 3.320	\$ (620)	\$ 2.700	0,03

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklasse Institutional CZK (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	07.2024	\$ 2.732	CZK 62.408	\$ 0	\$ (61)	\$ (61)	0,00
BRC	07.2024	CZK 70	\$ 3	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	\$ 2.619	CZK 59.689	0	(65)	(65)	0,00
GLM	07.2024	CZK 56.954	\$ 2.443	6	0	6	0,00
	08.2024	\$ 2.443	CZK 56.920	0	(6)	(6)	0,00
MYI	07.2024	CZK 64.093	\$ 2.747	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 2.732	CZK 62.592	0	(53)	(53)	0,00
	08.2024	2.747	64.065	0	(4)	(4)	0,00
UAG	07.2024	CZK 63.536	\$ 2.727	8	0	8	0,00
	08.2024	\$ 2.727	CZK 63.506	0	(7)	(7)	0,00
				\$ 18	\$ (196)	\$ (178)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschuttend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) ausschuttend, E Class EUR (Currency Exposure) ausschuttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	07.2024	NZD 38	\$ 23	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	\$ 23	NZD 38	0	0	0	0,00
BOA	07.2024	€ 59	\$ 63	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	AUD 3.420	2.279	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	€ 146	158	1	0	1	0,00
	07.2024	¥ 330	2	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 991	CAD 1.353	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	12	€ 11	0	0	0	0,00
	07.2024	9.762	£ 7.642	0	(102)	(102)	0,00
	08.2024	2.281	AUD 3.420	5	0	5	0,00
BRC	07.2024	20	€ 19	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	€ 49	\$ 53	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 54	CHF 49	1	0	1	0,00
	07.2024	23	€ 21	0	0	0	0,00
	07.2024	62	SEK 655	0	0	0	0,00
FAR	07.2024	NZD 72	\$ 44	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2.279	AUD 3.420	5	0	5	0,00
	07.2024	58.517	€ 53.727	0	(935)	(935)	(0,01)
	07.2024	102	NZD 165	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	44	72	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	17	€ 16	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	CHF 566	\$ 631	1	0	1	0,00
	07.2024	€ 129	138	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 631	CHF 564	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2024	CAD 7.627	\$ 5.571	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	€ 110	119	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 2	0	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 4.605	CAD 6.270	0	(23)	(23)	0,00
	07.2024	180	€ 166	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	1.179	¥ 184.404	0	(33)	(33)	0,00
	08.2024	5.571	CAD 7.622	3	0	3	0,00
MYI	07.2024	€ 4	\$ 5	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 654	62	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 62	SEK 653	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	€ 110	\$ 120	2	0	2	0,00
	07.2024	£ 7.642	9.691	31	0	31	0,00
	08.2024	\$ 9.693	£ 7.642	0	(30)	(30)	0,00
RYL	07.2024	65	€ 61	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	CAD 892	\$ 651	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	€ 53.914	57.764	0	(19)	(19)	0,00
	07.2024	\$ 3	CHF 2	0	0	0	0,00
	08.2024	57.825	€ 53.892	18	0	18	0,00
	07.2024	565	521	0	(7)	(7)	0,00
SSB	07.2024	NZD 55	\$ 34	0	0	0	0,00
TOR	08.2024	\$ 34	NZD 55	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	570	CHF 515	3	0	3	0,00
	08.2024	11	€ 11	0	0	0	0,00
				\$ 70	\$ (1.165)	\$ (1.095)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 378	\$ 406	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2024	\$ 720.584	€ 663.705	0	(9.258)	(9.258)	(0,10)
BPS	07.2024	€ 642.099	\$ 687.191	270	(1.249)	(979)	(0,01)
	07.2024	\$ 622.221	€ 574.748	0	(6.235)	(6.235)	(0,07)
BRC	08.2024	€ 622.238	\$ 580.900	1.249	0	1.249	0,01
	07.2024	€ 5.902	\$ 6.315	0	(10)	(10)	0,00
CBK	07.2024	€ 767	\$ 828	6	0	6	0,00
FAR	07.2024	\$ 698.372	€ 641.206	0	(11.160)	(11.160)	(0,12)
GLM	07.2024	€ 2.646	\$ 2.865	29	0	29	0,00
JPM	07.2024	€ 2.423	\$ 2.593	0	(4)	(4)	0,00
MBC	07.2024	€ 616.434	\$ 659.205	31	(1.490)	(1.459)	(0,02)
	08.2024	\$ 651.129	€ 608.041	1.490	0	1.490	0,02
MYI	07.2024	€ 402	\$ 431	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	€ 470	\$ 510	7	0	7	0,00
RYL	07.2024	€ 9.343	\$ 9.995	0	(19)	(19)	0,00
SCX	07.2024	€ 610.206	\$ 653.777	2	(214)	(212)	0,00
SSB	08.2024	\$ 653.849	€ 609.379	206	0	206	0,00
	07.2024	€ 12.380	\$ 11.412	0	(149)	(149)	0,00
UAG	08.2024	€ 481	\$ 449	1	0	1	0,00
				\$ 3.293	\$ (29.788)	\$ (26.495)	(0,29)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, E Class GBP (Hedged) ausschüttend, R Class GBP (Hedged) thesaurierend und W Class GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 262.048	\$ 331.362	\$ 107	\$ 0	\$ 107	0,00
	07.2024	\$ 681.169	£ 534.529	0	(5.472)	(5.472)	(0,06)
BRC	08.2024	\$ 331.416	£ 262.048	0	(101)	(101)	0,00
	07.2024	€ 455	\$ 355	0	(5)	(5)	0,00
CBK	07.2024	£ 15.227	\$ 19.352	103	0	103	0,00
	07.2024	\$ 8.584	£ 6.748	0	(55)	(55)	0,00
DUB	08.2024	£ 316	\$ 400	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 354.298	£ 277.667	0	(3.299)	(3.299)	(0,04)
MBC	07.2024	£ 274.678	\$ 347.527	306	0	306	0,00
	07.2024	\$ 7.629	£ 5.985	0	(63)	(63)	0,00
RBC	08.2024	\$ 345.308	£ 272.882	0	(295)	(295)	0,00
	07.2024	£ 272.500	\$ 345.558	1.091	0	1.091	0,01
RYL	08.2024	\$ 345.617	£ 272.500	0	(1.086)	(1.086)	(0,01)
	07.2024	£ 831	\$ 1.063	13	0	13	0,00
				\$ 1.620	\$ (10.376)	\$ (8.756)	(0,10)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2024	\$ 9.059	NOK 95.300	\$ 0	\$ (108)	\$ (108)	0,00
CBK	07.2024	\$ 9.009	NOK 94.969	0	(90)	(90)	0,00
	07.2024	NOK 76.824	\$ 7.214	2	(3)	(1)	0,00
MBC	07.2024	\$ 195	NOK 2.046	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	\$ 7.037	NOK 74.904	3	0	3	0,00
MYI	07.2024	NOK 95.653	\$ 8.972	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	\$ 8.304	NOK 87.526	0	(84)	(84)	0,00
RYL	08.2024	\$ 8.972	NOK 95.577	12	0	12	0,00
	07.2024	\$ 95	NOK 1.000	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 17	\$ (300)	\$ (283)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SEK 135	\$ 13	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 59.523	SEK 625.189	0	(489)	(489)	(0,01)
BRC	07.2024	SEK 984.220	\$ 92.866	0	(71)	(71)	0,00
	08.2024	\$ 92.866	SEK 982.715	70	0	70	0,00
CBK	07.2024	SEK 546	\$ 52	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 92.109	SEK 977.914	233	0	233	0,01
DUB	07.2024	SEK 879.228	\$ 83.072	50	0	50	0,00
	08.2024	\$ 83.072	SEK 877.878	0	(50)	(50)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2024	SEK 251	\$ 24	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	\$ 2	SEK 22	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	SEK 989.039	\$ 93.638	247	0	247	0,01
	07.2024	\$ 59.522	SEK 625.189	0	(487)	(487)	(0,01)
	08.2024	93.638	987.512	0	(248)	(248)	0,00
RYL	07.2024	SEK 106	\$ 10	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 59.540	SEK 625.410	0	(485)	(485)	(0,01)
SCX	07.2024	9	96	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	SEK 21	\$ 2	0	0	0	0,00
				\$ 600	\$ (1.830)	\$ (1.230)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 37.123	\$ 27.350	\$ 0	\$ (41)	\$ (41)	0,00
	07.2024	\$ 18.141	SGD 24.485	0	(75)	(75)	0,00
	08.2024	27.396	37.130	41	0	41	0,00
BPS	07.2024	SGD 37.318	\$ 27.515	0	(20)	(20)	0,00
	08.2024	\$ 27.515	SGD 37.264	21	0	21	0,00
BRC	07.2024	206	278	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2024	630	850	0	(3)	(3)	0,00
GLM	07.2024	SGD 1.964	\$ 1.453	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 140	SGD 188	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2024	35.088	47.227	0	(240)	(240)	(0,01)
MBC	07.2024	859	1.161	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2024	11	14	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	SGD 1.402	\$ 1.039	5	0	5	0,00
	07.2024	\$ 27.678	SGD 37.295	0	(159)	(159)	0,00
UAG	07.2024	90	121	0	0	0	0,00
				\$ 70	\$ (542)	\$ (472)	(0,01)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						\$ (9.069)	(0,10)
<b>Summe Anlagen</b>						\$ 9.906.544	108,51
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						\$ (777.231)	(8,51)
<b>Nettovermögen</b>						\$ 9.129.313	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (i) Mit dem Fonds verbunden.
- (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (k) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,70 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Morgan Stanley	0,000 %	02.04.2032	11.02.2020	\$ 41.495	\$ 29.754	0,33

(l) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 9.304 USD (31. Dezember 2023: 8.265 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2023: 3.891 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 260 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 140.126 USD (31. Dezember 2023: 177.696 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 28.690 USD (31. Dezember 2023: 8.110 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 9.366.053	\$ 32.521	\$ 9.398.574
Investmentfonds	530.469	0	0	530.469
Pensionsgeschäfte	0	1.689	0	1.689
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	7.594	(31.782)	0	(24.188)
<b>Summen</b>	<b>\$ 538.063</b>	<b>\$ 9.335.960</b>	<b>\$ 32.521</b>	<b>\$ 9.906.544</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 10.078.308	\$ 13.011	\$ 10.091.319
Investmentfonds	787.238	257.980	0	1.045.218
Pensionsgeschäfte	0	177.113	0	177.113
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	26.715	32.277	0	58.992
<b>Summen</b>	<b>\$ 813.953</b>	<b>\$ 10.545.678</b>	<b>\$ 13.011</b>	<b>\$ 11.372.642</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	4,300 %	22.11.2023	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (335)	\$ (344)	0,00
		4,500	15.02.2024	(209)	(213)	0,00
BRC	0,500	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.001)	(1.073)	(0,01)
JML	1,750	15.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(3.889)	(4.200)	(0,05)
		1,750	11.04.2024	(808)	(870)	(0,01)
MEI	0,500	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(1.548)	(1.659)	(0,02)
SCX	5,000	14.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (893)	(895)	(0,01)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (9.254)</b>	<b>(0,10)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (254)	\$ 0	\$ (254)	\$ (833)	940	107
BOA	(9.694)	10.610	916	2.872	(3.410)	(538)
BPS	11.645	(12.740)	(1.095)	(4.216)	6.880	2.664
BRC	2.072	(1.810)	262	5.041	(8.780)	(3.739)
CBK	698	(620)	78	6.148	(8.080)	(1.932)
DBL	k. A.	k. A.	k. A.	196	0	196
DUB	(3.279)	2.990	(289)	995	(770)	225
FAR	(12.316)	12.900	584	365	(390)	(25)
GLM	(1.134)	1.200	66	616	(190)	426
GST	599	(590)	9	490	(470)	20
JLN	k. A.	k. A.	k. A.	(42)	0	(42)
JPM	639	(440)	199	1.401	(1.300)	101
MBC	384	(320)	64	4.179	(7.500)	(3.321)
MYC	(1)	(270)	(271)	60	0	60
MYI	(311)	360	49	9.504	(11.110)	(1.606)
RBC	10	0	10	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(582)	630	48	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(2)	0	(2)	(106)	0	(106)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
SCX	\$ 241	\$ 0	\$ 241	\$ 6.112	(7.970)	(1.858)
SSB	(156)	0	(156)	(225)	290	65
TOR	1.100	(1.600)	(500)	1.077	(1.020)	57
UAG	1.298	(1.333)	(35)	3.459	(4.341)	(882)
ULO	(26)	0	(26)	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	65,19	64,03
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	37,50	30,03
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,26	0,12
Investmentfonds	5,81	9,76
Pensionsgeschäfte	0,02	1,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,11	0,25
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,28)	(0,04)
Freiverkehrfinanzderivate	(0,10)	0,35
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,10)	(0,07)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	3,02	2,35
Österreich	0,19	0,05
Belgien	0,25	0,14
Bermuda	0,62	0,52
Brasilien	0,29	0,19
Kanada	3,48	2,63
Cayman-Inseln	3,11	3,08
Chile	0,01	0,02
China	k. A.	0,17
Kolumbien	0,11	0,08
Tschechische Republik	0,25	0,15
Dänemark	0,45	0,38
Finnland	0,30	0,27
Frankreich	3,83	3,23
Deutschland	1,50	1,55
Guernsey, Kanalinseln	0,40	0,36
Hongkong	0,07	0,12
Ungarn	0,04	k. A.
Indien	0,20	0,21
Indonesien	0,19	0,16
Irland	0,40	0,58
Isle of Man	0,13	k. A.
Israel	0,35	0,09
Italien	1,99	1,53
Japan	1,82	1,84
Jersey, Kanalinseln	0,70	0,51
Kasachstan	0,04	k. A.
Liberia	0,23	0,03
Luxemburg	1,22	0,90
Mauritius	k. A.	0,09
Mexiko	0,93	0,61
Multinational	0,03	0,03
Niederlande	3,66	2,94
Norwegen	0,49	0,26
Panama	0,21	k. A.
Peru	0,14	0,02
Polen	0,16	0,10
Portugal	0,19	0,14
Katar	0,14	0,10
Rumänien	0,57	0,37
Russland	0,00	0,00
Saudi-Arabien	1,05	0,93
Singapur	0,46	0,38
Slowakei	0,02	0,00
Slowenien	k. A.	0,11
Südafrika	k. A.	0,77
Südkorea	0,28	0,2
Spanien	0,77	0,33
Supranational	0,27	0,23
Schweden	0,37	0,16
Schweiz	1,78	1,23
Thailand	0,08	0,07
Türkei	0,03	0,03

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Vereinigte Arabische Emirate	0,06	0,07
Großbritannien	6,31	6,00
USA	59,35	56,91
Jungferninseln (Britisch)	0,35	0,40
Kurzfristige Instrumente	0,06	0,56
Investmentfonds	5,81	9,76
Pensionsgeschäfte	0,02	1,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,11	0,25
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	(0,01)	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,08
Zinsswaps	(0,27)	(0,13)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,02	0,01
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,03)	(0,02)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,02	0,02
Devisenterminkontrakte	0,27	(0,24)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,39)	0,57
Sonstige Aktiva und Passiva	(8,51)	(6,15)
Nettovermögen	100,00	100,00

















## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	146	\$ (25)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	615	313	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	1.276	483	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	562	(544)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	195	(84)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	1.202	1.129	0,05
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	247	(144)	(0,01)
				\$ 330	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 330	0,01

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.12.2027	\$ 1.100	\$ 17	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2026	900	1	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2027	1.000	3	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.500	6	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	700	4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	€ 100	0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	300	1	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2028	\$ 5.400	81	0,01
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	600	2	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2026	3.000	5	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2028	1.700	11	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 1.000	4	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	600	3	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 700	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	2.200	8	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	700	4	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	6.700	50	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	1.700	13	0,00
				\$ 215	0,01

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000 %	20.06.2029	\$ 37.100	\$ (45)	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000 %	18.09.2029	£ 10.000	\$ (39)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	\$ 800	24	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	25.000	422	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,667	31.05.2028	9.700	191	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	26.700	(546)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,000	16.06.2026	CAD 13.800	112	0,01
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,220	03.03.2025	600	1	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,235	04.03.2025	1.100	2	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,275	03.03.2025	600	1	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,276	03.03.2025	300	1	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,290	03.03.2025	200	0	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,500	17.06.2030	500	5	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	181.400	27	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,600	15.12.2050	€ 2.300	3	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	17.300	862	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	69.900	(1.102)	(0,05)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026	10.800	(84)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,475	16.06.2031	\$ 2.600	39	0,00
					\$ (81)	(0,01)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 89	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 2.300	\$ 11	\$ 22	\$ 33	0,00

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEVISETERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD 20.254	\$ 13.495	\$ 0	\$ (32)	\$ (32)	0,00
BOA	07.2024	CHF 18	20	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 618.432	671.386	8.581	0	8.581	0,39
BPS	07.2024	3.832	4.100	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	£ 109.748	140.193	1.460	0	1.460	0,06
	07.2024	\$ 16.286	AUD 24.442	38	0	38	0,00
	07.2024	€ 4.099	€ 3.832	8	0	8	0,00
	08.2024	AUD 24.442	\$ 16.300	0	(37)	(37)	0,00
	08.2024	€ 3.832	4.105	0	(8)	(8)	0,00
CBK	07.2024	AUD 3.078	2.050	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	CHF 387	425	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	€ 15.657	16.786	16	(10)	6	0,00
	07.2024	£ 4.004	5.097	35	0	35	0,00
	07.2024	SEK 69.568	6.552	0	(17)	(17)	0,00
	09.2024	\$ 2.935	INR 245.378	2	(1)	1	0,00
GLM	07.2024	CAD 9.000	\$ 6.561	0	(16)	(16)	0,00
	07.2024	\$ 5.648	MXN 103.233	0	(13)	(13)	0,00
	07.2024	ZAR 20.589	\$ 1.125	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 5.237	BRL 26.866	0	(418)	(418)	(0,02)
JPM	07.2024	£ 5.770	\$ 7.386	92	0	92	0,00
	07.2024	\$ 4.995	CHF 4.482	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	ZAR 39.001	\$ 2.119	0	(15)	(15)	0,00
	08.2024	CHF 4.466	4.995	7	0	7	0,00
	09.2024	\$ 399	INR 33.470	1	0	1	0,00
MBC	07.2024	AUD 1.110	\$ 737	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	CAD 34.911	25.640	126	0	126	0,01
	07.2024	\$ 32.092	CAD 43.939	19	0	19	0,00
	07.2024	€ 678.032	€ 634.089	1.554	0	1.554	0,07
	07.2024	151.220	£ 119.522	0	(132)	(132)	(0,01)
	08.2024	CAD 43.909	\$ 32.092	0	(20)	(20)	0,00
	08.2024	€ 634.089	679.023	0	(1.553)	(1.553)	(0,07)
	08.2024	£ 119.522	151.245	129	0	129	0,01
MYI	07.2024	€ 6	6	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 31	39	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 13.779	1.303	3	(1)	2	0,00
	07.2024	\$ 561	€ 523	0	0	0	0,00
	07.2024	2.972	£ 2.350	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	6.595	SEK 69.654	0	(17)	(17)	0,00
	08.2024	SEK 69.547	\$ 6.595	17	0	17	0,00
	09.2024	\$ 267	INR 22.341	0	0	0	0,00
SCX	09.2024	1.812	151.658	3	0	3	0,00
UAG	07.2024	CHF 4.080	\$ 4.515	0	(25)	(25)	0,00
				\$ 12.091	\$ (2.347)	\$ 9.744	0,44

#### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 64.945	CHF 58.419	\$ 66	\$ 0	\$ 66	0,00
BRC	07.2024	CHF 449	\$ 502	3	0	3	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 1	CHF 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	07.2024	5.564	5.064	71	0	71	0,00
GLM	07.2024	CHF 54	\$ 61	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	59.293	66.072	88	0	88	0,00
	07.2024	\$ 42	CHF 38	0	0	0	0,00
	08.2024	66.072	59.074	0	(86)	(86)	0,00
MBC	07.2024	CHF 89	\$ 100	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 55.207	CHF 49.723	127	0	127	0,01
	08.2024	CHF 452	\$ 505	1	0	1	0,00
MYI	07.2024	\$ 27	CHF 31	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 3	CHF 3	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	CHF 573	\$ 642	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 1.222	CHF 1.098	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	CHF 59.283	\$ 66.074	101	0	101	0,00
	07.2024	\$ 64.078	CHF 57.905	361	0	361	0,02
	08.2024	66.074	59.064	0	(100)	(100)	0,00
				\$ 823	\$ (186)	\$ 637	0,03

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 84	\$ 90	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 307.336	€ 283.076	0	(3.950)	(3.950)	(0,18)
BPS	07.2024	€ 277.390	\$ 296.708	9	(594)	(585)	(0,03)
	07.2024	\$ 292.007	€ 269.724	0	(2.932)	(2.932)	(0,13)
	08.2024	295.992	276.328	595	0	595	0,03
BRC	07.2024	272.627	251.757	0	(2.808)	(2.808)	(0,13)
CBK	07.2024	€ 223	\$ 239	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.644	€ 1.532	2	(5)	(3)	0,00
GLM	07.2024	€ 4	\$ 4	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	104	111	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	287.046	306.939	0	(703)	(703)	(0,03)
	07.2024	\$ 983	€ 909	0	(9)	(9)	0,00
	08.2024	307.260	286.928	704	0	704	0,03
SCX	07.2024	€ 286.451	\$ 306.903	0	(100)	(100)	0,00
	07.2024	\$ 47.666	€ 44.305	0	(182)	(182)	(0,01)
	08.2024	307.354	286.451	97	0	97	0,01
				\$ 1.407	\$ (11.283)	\$ (9.876)	(0,44)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 96.675	\$ 122.246	\$ 40	\$ 0	\$ 40	0,00
	07.2024	\$ 345.144	£ 271.087	0	(2.463)	(2.463)	(0,11)
	08.2024	122.266	96.675	0	(37)	(37)	0,00
BRC	07.2024	£ 20	\$ 26	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	41	53	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 11.852	£ 9.330	0	(58)	(58)	0,00
	08.2024	45	35	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	£ 95.326	\$ 120.613	111	0	111	0,01
	07.2024	\$ 395	£ 312	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	119.602	94.516	0	(102)	(102)	(0,01)
				\$ 151	\$ (2.661)	\$ (2.510)	(0,11)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 112.796	SEK 1.184.644	\$ 0	\$ (933)	\$ (933)	(0,05)
BPS	07.2024	751	7.915	0	(4)	(4)	0,00
BRC	07.2024	SEK 1.887.273	\$ 178.074	0	(135)	(135)	(0,01)
	08.2024	\$ 178.074	SEK 1.884.388	135	0	135	0,01
CBK	07.2024	SEK 10	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 174.311	SEK 1.850.568	438	(6)	432	0,02
MBC	07.2024	2.249	23.607	0	(20)	(20)	0,00
	08.2024	737	7.795	1	0	1	0,00
MYI	07.2024	SEK 1.888.197	\$ 178.766	469	0	469	0,02
	07.2024	\$ 111.801	SEK 1.174.304	0	(915)	(915)	(0,04)
	08.2024	178.766	1.885.281	0	(473)	(473)	(0,02)
RYL	07.2024	113.268	1.187.652	0	(1.122)	(1.122)	(0,05)
SCX	07.2024	205	2.152	0	(2)	(2)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
UAG	07.2024	SEK	1.485	\$ 2	\$ 0	2	0,00
				\$ 1.045	\$ (3.610)	\$ (2.565)	(0,12)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ (4.537)</b>	<b>(0,20)</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>\$ 2.184.216</b>	<b>98,50</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>\$ 33.245</b>	<b>1,50</b>
<b>Nettovermögen</b>						<b>\$ 2.217.461</b>	<b>100,00</b>

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.  
(b) Wertpapier per Emissionstermin.  
(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.  
(d) Nullkuponwertpapier.  
(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,62 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	4,850 %	25.05.2047	23.09.2021	\$ 1.321	\$ 991	0,04

- (i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 9.588 USD (31. Dezember 2023: 106.702 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 36.266 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 25.055 USD (31. Dezember 2023: 25.394 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 10.200 USD (31. Dezember 2023: 560 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.134.247	\$ 0	\$ 2.134.247
Pensionsgeschäfte	0	54.087	0	54.087
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(968)	(3.150)	0	(4.118)
<b>Summen</b>	<b>\$ (968)</b>	<b>\$ 2.185.184</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 2.184.216</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.410.642	\$ 0	\$ 2.410.642
Pensionsgeschäfte	0	1.300	0	1.300
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(5.681)	18.437	0	12.756
<b>Summen</b>	<b>\$ (5.681)</b>	<b>\$ 2.430.379</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 2.424.698</b>

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,250 %	14.06.2024	11.07.2024	\$ (3.648)	\$ (3.657)	(0,17)
	5,350	28.06.2024	01.07.2024	(1.310)	(1.310)	(0,06)
BRC	0,500	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (273)	(293)	(0,01)
JPS	5,250	14.06.2024	02.08.2024	\$ (1.197)	(1.200)	(0,05)
	5,300	14.06.2024	02.08.2024	(2.769)	(2.775)	(0,13)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (9.235)</b>	<b>(0,42)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (32)	\$ 0	\$ (32)	\$ (78)	\$ 0	\$ (78)
BOA	3.797	(3.900)	(103)	4.398	(5.630)	(1.232)
BPS	(3.932)	3.950	18	(141)	0	(141)
BRC	(2.805)	3.370	565	(50)	560	510
CBK	456	(270)	186	874	(1.340)	(466)
GLM	(448)	230	(218)	2.486	(2.440)	46
JPM	80	0	80	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	229	(520)	(291)	476	(570)	(94)
MYI	(919)	1.070	151	3.642	(4.170)	(528)
RYL	(1.122)	1.270	148	341	(570)	(229)
SCX	(180)	220	40	4.854	(6.830)	(1.976)
UAG	339	90	429	7.236	(5.610)	1.626

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	72,47	84,95
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	23,18	26,04
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,60	0,09
Pensionsgeschäfte	2,44	0,06
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	(0,54)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,20)	1,11
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,42)	(4,98)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(1,70)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	0,80	0,45
Österreich	0,33	0,37
Belgien	1,46	1,46
Brasilien	0,29	0,03
Kanada	2,44	2,31
Cayman-Inseln	0,02	0,09
Chile	0,46	0,32
Kolumbien	0,20	k. A.
Tschechische Republik	0,28	0,21
Dänemark	1,22	1,29
Dominikanische Republik	0,08	k. A.
Finnland	0,42	0,60
Frankreich	7,00	6,61
Deutschland	3,47	2,66
Guernsey, Kanalinseln	0,21	0,23
Hongkong	0,33	0,36
Indien	0,36	0,39
Indonesien	0,03	0,03
Irland	1,31	1,04
Italien	1,35	1,62
Japan	3,11	3,84
Jersey, Kanalinseln	0,05	0,05
Luxemburg	1,27	0,85
Mauritius	0,05	0,21
Mexiko	0,65	0,37

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Multinational	0,10	0,32
Niederlande	8,57	8,70
Neuseeland	0,10	0,03
Norwegen	0,29	0,28
Peru	0,07	0,08
Polen	k. A.	0,07
Rumänien	0,27	0,31
Serbien	0,17	0,08
Singapur	0,31	0,32
Südkorea	1,68	1,95
Spanien	2,03	1,82
Supranational	1,11	3,75
Schweden	0,53	0,52
Schweiz	1,39	1,44
Vereinigte Arabische Emirate	k. A.	0,20
Großbritannien	11,16	9,90
USA	41,28	55,77
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	0,15
Pensionsgeschäfte	2,44	0,06
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	(0,54)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	(0,01)	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,44	(0,22)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,64)	1,33
Sonstige Aktiva und Passiva	1,50	(11,73)
Nettovermögen	100,00	100,00





## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 565	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	268 \$ (576)	\$ 565	\$ 565	0,06
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (576)	\$ 565	\$ 565	0,06

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	268	\$ (45)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	115	10	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2024	121	(1)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	734	(967)	(0,09)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	157	179	0,02
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	262	130	0,01
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	8	8	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	1.272	(682)	(0,07)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	740	(589)	(0,06)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	507	288	0,03
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	680	(772)	(0,08)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	181	99	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	412	(594)	(0,06)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	82	33	0,00
				\$ (2.903)	(0,29)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - EUREX Euro-Schatz August 2024 Futures	€ 106,200	26.07.2024	389	\$ (67)	\$ (27)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (2.930)	(0,29)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000 %	18.09.2029	£ 24.300	\$ 433	0,04
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	18.09.2026	58.900	(119)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 1.952.000	17	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,237	21.11.2053	\$ 8.700	2.226	0,22
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,340	21.11.2028	43.000	(3.144)	(0,31)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	13.500	1.943	0,19
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	30.000	(2.085)	(0,21)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	2.700	(119)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	7.300	(431)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	3.600	54	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	68.000	513	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,760	18.01.2026	39.200	307	0,03
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 61.800	1.913	0,19
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	136.800	(2.454)	(0,24)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,670	24.07.2024	956.900	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,750	23.08.2024	419.700	163	0,02
Zahlung	CPTFEMU	1,375	15.02.2040	1.600	(126)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	800	(125)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,000	15.04.2026	16.300	(10)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,356	15.11.2033	4.200	80	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	1.500	40	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,363	15.11.2033	2.300	42	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,390	15.11.2033	2.400	48	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,400	15.02.2044	3.900	8	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,488	15.05.2037	2.290	(74)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,590	15.12.2052	1.700	44	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	CPTFEMU		2,700 %	15.04.2053	€ 5.500	\$ 434	0,04
Zahlung	CPTFEMU		2,763	15.09.2053	2.400	222	0,02
Erhalt	CPTFEMU		2,975	15.08.2027	19.700	(88)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU		3,000	15.05.2027	5.400	58	0,01
Erhalt	CPTFEMU		3,130	15.05.2027	100	1	0,00
Zahlung	CPTFEMU		3,520	15.09.2024	5.200	(30)	0,00
Zahlung	CPTFEMU		3,720	15.09.2024	3.300	(6)	0,00
Zahlung	CPTFEMU		3,850	15.09.2024	7.700	(8)	0,00
Zahlung	CPURNSA		1,883	20.11.2029	\$ 7.400	(296)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA		1,954	03.06.2029	4.700	(192)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA		1,998	25.07.2029	4.300	(179)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA		2,311	24.02.2031	6.600	276	0,03
Zahlung	CPURNSA		2,335	05.02.2028	6.110	(284)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA		2,353	09.05.2028	960	(43)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA		2,364	10.05.2028	7.960	(361)	(0,04)
Zahlung	CPURNSA		2,379	09.07.2028	1.900	(87)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA		2,419	05.03.2026	400	17	0,00
Zahlung	CPURNSA		2,420	24.08.2024	17.800	(124)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA		2,560	12.09.2024	4.400	(22)	0,00
Zahlung	CPURNSA		2,565	12.09.2024	4.200	(21)	0,00
Erhalt	CPURNSA		2,813	14.05.2026	1.600	69	0,01
Zahlung	FRCPXTOB		1,280	15.11.2034	€ 1.700	(120)	(0,01)
Zahlung	FRCPXTOB		1,410	15.11.2039	2.000	(130)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		3,346	15.05.2030	£ 550	(43)	0,00
Zahlung	UKRPI		4,040	15.04.2029	4.400	32	0,00
						\$ (1.782)	(0,18)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (1.782)</b>	<b>(0,18)</b>

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.500	\$ (68)	\$ (53)	(0,01)

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BRC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	3,150 %	06.10.2025	16.800	\$ (194)	\$ (225)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,150	06.10.2025	16.800	(194)	(76)	(0,01)
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950	15.09.2025	14.000	(169)	(155)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	15.09.2025	14.000	(169)	(88)	(0,01)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	8.800	(115)	(85)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	8.800	(115)	(54)	(0,01)
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	18.900	(239)	(163)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	18.900	(239)	(133)	(0,01)
						\$ (1.434)	\$ (979)	(0,09)	

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens	
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 413	\$ (28)	\$ 28	\$ 0	0,00	
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.400	(3)	(7)	(10)	0,00	
UAG	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	893	(79)	78	(1)	0,00	
						\$ (110)	\$ 99	\$ (11)	0,00

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD	\$	6.856	\$	48	0,01
	07.2024	\$	NZD	2.121		(6)	0,00
	08.2024	NZD	\$	1.299		7	0,00
	10.2024	\$	CNH	10.737		(17)	0,00
BOA	07.2024	€	\$	83.994	1.079	0	0,11
	07.2024	KRW		1.753	11	0	0,00
	07.2024	SGD		21	0	0	0,00
	07.2024	\$	€	41.468		(185)	(0,02)
	07.2024		PLN	1.330	0	(3)	0,00
	07.2024		SGD	29	0	0	0,00
	08.2024	SGD	\$	21	0	0	0,00
BPS	07.2024	AUD		277	0	(3)	0,00
	07.2024	BRL		409	39	0	0,00
	07.2024	£		205.686	2.136	0	0,21
	07.2024	KRW		1.734	5	0	0,00
	07.2024	\$	AUD	23.468	36	0	0,00
	07.2024		€	709	0	(3)	(0,00)
	07.2024		IDR	4.096.598	0	0	0,00
	07.2024		ILS	375	0	(2)	0,00
	07.2024		NZD	1.887	0	(9)	0,00
	07.2024		PLN	3.160	0	(10)	0,00
	07.2024		SGD	2.549	1	0	0,00
	08.2024	AUD	\$	15.650	0	(36)	0,00
	08.2024	SGD		1.879	0	(1)	0,00
	09.2024	CNH		2.331	27	0	0,00
	09.2024	TWD		2.541	16	0	0,00
	09.2024	\$	INR	50.406	1	0	0,00
	10.2024	CNH	\$	1.039	11	0	0,00
	10.2024	\$	CNH	2.175	0	(3)	0,00
BRC	07.2024	DKK	\$	1.317	17	0	0,00
	07.2024	MXN		329	0	(3)	0,00
	07.2024	NOK		419	5	0	0,00
	07.2024	\$	PLN	1.802	0	(3)	0,00
	07.2024		SEK	129.128	9	0	0,00
	08.2024	SEK	\$	12.184	0	(9)	0,00
	09.2024	MXN		484	0	(10)	0,00
	09.2024	\$	MXN	69.282	46	0	0,00
CBK	07.2024	CHF	\$	526	0	(7)	0,00
	07.2024	KRW		121	1	0	0,00
	07.2024	SEK		12.165	0	(22)	0,00
	07.2024	\$	BRL	15.899	0	(55)	(0,01)
	07.2024		€	1.538	0	(2)	0,00
	07.2024		£	7.665	0	(108)	(0,01)
	07.2024		PLN	3.330	0	(11)	0,00
	08.2024	BRL	\$	2.918	56	0	0,01
	08.2024	£		1.095	0	0	0,00
	08.2024	PEN		391	5	0	0,00
	09.2024	TWD		967	4	0	0,00
	09.2024	\$	INR	247.795	2	(1)	0,00
DUB	07.2024	KRW	\$	945	1	0	0,00
FAR	07.2024	\$	PLN	3.137	0	(18)	0,00
	07.2024	AUD	\$	15.357	0	(37)	0,00
	07.2024	€		347.845	5.559	0	0,55
	07.2024	¥		67.897	1.983	0	0,20
	07.2024	\$	NZD	4.076	0	(2)	0,00
	08.2024	NZD	\$	2.486	2	0	0,00
GLM	07.2024	MXN		295	0	(4)	0,00
	07.2024	\$	€	4.239	0	(15)	0,00
	07.2024		PLN	1.967	0	(9)	0,00
	07.2024		ZAR	31.004	1	0	0,00
	08.2024		BRL	14.179	0	(220)	(0,02)
JPM	07.2024	BRL	\$	117	11	0	0,00
	07.2024	CHF		322	0	(2)	0,00
	07.2024	KRW		1.164	0	(2)	0,00
	07.2024	SGD		1.894	13	0	0,00
	07.2024	\$	CHF	3.616	0	(5)	0,00
	07.2024		DKK	13.654	3	0	0,00
	07.2024		IDR	2.303.628	0	(1)	0,00
	07.2024		ILS	739	0	(3)	0,00
	07.2024		PLN	1.242	0	(9)	0,00
	07.2024		ZAR	58.729	22	0	0,00
	08.2024	CHF	\$	4.029	5	0	0,00
	08.2024	DKK		1.959	0	(3)	0,00
	09.2024	TWD		1.647	9	0	0,00
	09.2024	\$	INR	28.834	1	0	0,00
	10.2024	CNH	\$	4.341	47	0	0,01
	10.2024	\$	CNH	2.169	0	(4)	0,00
MBC	07.2024	CAD	\$	6.312	31	0	0,00
	07.2024	\$	CAD	8.600	4	0	0,00
	07.2024		€	35.303	87	0	0,01
	07.2024		NOK	3.431	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	08.2024	CAD	8.594	\$ 6.281	\$ 0	\$ (4)	0,00	
	08.2024	€	35.303	37.805	0	(86)	(0,01)	
MYI	08.2024	NOK	3.429	322	0	0	0,00	
	07.2024	BRL	13.249	2.565	180	0	0,02	
	07.2024	\$	1.343	DKK 9.371	4	0	0,00	
	07.2024		349	€ 326	0	0	0,00	
	07.2024		1.418	£ 1.121	0	(1)	0,00	
	07.2024		92	NOK 980	0	0	0,00	
	08.2024	DKK	9.354	\$ 1.343	0	(4)	0,00	
	08.2024	NOK	979	92	0	0	0,00	
	09.2024	TWD	21.095	658	6	0	0,00	
	09.2024	\$	230	INR 19.246	0	0	0,00	
RBC	07.2024		194.475	£ 153.359	0	(614)	(0,06)	
	08.2024	£	153.359	\$ 194.508	611	0	0,06	
SCX	07.2024	IDR	164.120	10	0	0	0,00	
	07.2024	KRW	1.207.672	886	9	0	0,00	
	07.2024	MXN	74	4	0	0	0,00	
	07.2024	\$	338.444	€ 315.889	111	0	0,01	
	07.2024	ZAR	655	\$ 36	0	0	0,00	
	08.2024	€	315.889	338.941	0	(107)	(0,01)	
	08.2024	PEN	1.714	453	6	0	0,00	
	09.2024	CNH	11.668	1.626	19	0	0,00	
	09.2024	TWD	30.662	951	4	0	0,00	
	09.2024	\$	2.630	INR 220.094	4	0	0,00	
SSB	07.2024	€	2.410	\$ 2.584	1	0	0,00	
TOR	07.2024	CHF	13	14	0	0	0,00	
	07.2024	\$	66.313	¥ 10.603.487	0	(397)	(0,04)	
	07.2024		1.892	NZD 3.089	0	(10)	0,00	
	08.2024	¥	10.553.765	\$ 66.313	395	0	0,04	
	08.2024	NZD	3.089	1.892	10	0	0,00	
UAG	07.2024	CHF	2.835	3.138	0	(18)	0,00	
	07.2024	DKK	14.005	2.034	21	0	0,00	
	07.2024	ILS	1.239	334	5	0	0,00	
	08.2024	€	37.408	40.059	0	(92)	(0,01)	
					\$ 12.727	\$ (2.176)	\$ 10.551	1,05

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 11.890	CHF 10.695	\$ 12	\$ 0	\$ 12	0,00
BRC	07.2024	CHF 68	\$ 76	1	0	1	0,00
CBK	07.2024	2	2	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.199	CHF 1.091	15	0	15	0,00
GLM	07.2024	CHF 3	\$ 3	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	12.707	14.160	19	0	19	0,00
	08.2024	\$ 14.147	CHF 12.648	0	(19)	(19)	0,00
MYI	07.2024	4	4	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	216	194	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	13.998	12.644	73	0	73	0,01
UAG	07.2024	CHF 12.642	\$ 14.090	21	0	21	0,00
	07.2024	\$ 13.840	CHF 12.507	78	0	78	0,01
	08.2024	14.090	12.595	0	(21)	(21)	0,00
				\$ 219	\$ (40)	\$ 179	0,02

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 1.125	\$ 1.214	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	07.2024	\$ 127.586	€ 117.515	0	(1.639)	(1.639)	(0,16)
BPS	07.2024	€ 110.282	\$ 117.985	19	(229)	(210)	(0,02)
	07.2024	\$ 111.062	€ 102.588	0	(1.113)	(1.113)	(0,11)
	08.2024	114.110	106.530	229	0	229	0,02
BRC	07.2024	€ 372	\$ 399	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2024	2.150	2.311	7	0	7	0,00
FAR	07.2024	\$ 123.824	€ 113.688	0	(1.980)	(1.980)	(0,20)
GLM	07.2024	€ 365	\$ 395	4	0	4	0,00
JPM	07.2024	1.057	1.131	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2024	109.786	117.430	30	(263)	(233)	(0,02)
	08.2024	\$ 115.085	€ 107.469	264	0	264	0,03
RBC	07.2024	€ 316	\$ 343	5	0	5	0,00
RYL	07.2024	172	184	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	107.803	115.501	1	(38)	(37)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	\$ 115.445	€ 107.593	\$ 36	\$ 0	\$ 36	0,00
SSB	07.2024	€ 362	\$ 392	4	0	4	0,00
UAG	08.2024	70	75	0	0	0	0,00
				\$ 607	\$ (5.265)	\$ (4.658)	(0,46)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 24.348	\$ 30.789	\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,00
	07.2024	\$ 62.022	£ 48.671	0	(497)	(497)	(0,05)
	08.2024	30.678	24.257	0	(9)	(9)	0,00
BRC	07.2024	£ 20	\$ 26	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	577	736	6	0	6	0,00
	07.2024	\$ 670	£ 527	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	£ 125	\$ 158	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	\$ 32.175	£ 25.216	0	(300)	(300)	(0,03)
MBC	07.2024	£ 25.210	\$ 31.897	29	0	29	0,00
	07.2024	\$ 17	£ 13	0	0	0	0,00
	08.2024	30.829	24.363	0	(26)	(26)	0,00
RBC	07.2024	£ 24.373	\$ 30.907	97	0	97	0,01
	08.2024	\$ 30.912	£ 24.373	0	(97)	(97)	(0,01)
RYL	07.2024	130	101	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 143	\$ (935)	\$ (792)	(0,08)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 210.964	\$ 155.429	\$ 0	\$ (235)	\$ (235)	(0,02)
	07.2024	\$ 298.887	SGD 403.518	0	(1.142)	(1.142)	(0,12)
	08.2024	155.429	210.653	236	0	236	0,02
CBK	07.2024	3.616	4.877	0	(17)	(17)	0,00
GLM	07.2024	1.119	1.509	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07.2024	155.668	209.756	0	(895)	(895)	(0,09)
				\$ 236	\$ (2.295)	\$ (2.059)	(0,21)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 2.178	0,22
Summe Anlagen						\$ 1.745.089	173,13
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (737.102)	(73,13)
Nettovermögen						\$ 1.007.987	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Mit dem Fonds verbunden.

(c) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 597.995 USD (31. Dezember 2023: 620.826 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 24.628 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 1.102 USD (31. Dezember 2023: null EUR) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte geliefert.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2023: 3.735 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 16.689 USD (31. Dezember 2023: 17.518 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.420 USD (31. Dezember 2023: 7.060 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.744.857	\$ 0	\$ 1.744.857
Investmentfonds	2.201	0	0	2.201
Pensionsgeschäfte	0	565	0	565
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(680)	(1.854)	0	(2.534)
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.521</b>	<b>\$ 1.743.568</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 1.745.089</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.920.976	\$ 2.682	\$ 1.923.658
Investmentfonds	506	0	0	506
Pensionsgeschäfte	0	2.889	0	2.889
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(4.814)	(6.706)	0	(11.520)
<b>Summen</b>	<b>\$ (4.308)</b>	<b>\$ 1.917.159</b>	<b>\$ 2.682</b>	<b>\$ 1.915.533</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,480 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ (22.272)	\$ (22.282)	(2,21)
CIB	5,420	23.05.2024	09.07.2024	(513.241)	(516.255)	(51,22)
	5,420	03.06.2024	09.07.2024	(58.860)	(59.108)	(5,86)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (597.645)</b>	<b>(59,29)</b>

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 32	\$ 0	\$ 32	\$ 1.479	\$ (1.630)	\$ (151)
BOA	(1.858)	2.110	252	97	0	97
BPS	616	(440)	176	(1.764)	2.020	256
BRC	(249)	240	(9)	(1.660)	2.920	1.260
CBK	(374)	0	(374)	1.456	(2.120)	(664)
DUB	(317)	340	23	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	5.525	(5.800)	(275)	(553)	490	(63)
GLM	(441)	360	(81)	(516)	540	24
GST	(296)	470	174	(490)	470	(20)
JPM	80	0	80	(44)	0	(44)
MBC	66	0	66	(237)	310	73
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(56)	0	(56)
MYI	185	0	185	840	(1.770)	(930)
RBC	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(10)	10	0	(6)	10	4
SCX	(850)	890	40	(148)	300	152
SSB	5	0	5	324	(440)	(116)
TOR	71	(310)	(239)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(7)	(270)	(277)	(412)	0	(412)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	153,44	145,93
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	16,27	17,21
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,39	0,28
Investmentfonds	0,22	0,04
Pensionsgeschäfte	0,06	0,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,29)	(0,86)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,18)	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate	0,22	(0,14)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(59,29)	(52,51)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(2,10)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	1,30	1,15
Kanada	0,46	0,19
Cayman-Inseln	0,13	0,27
Dänemark	0,39	3,12
Frankreich	12,34	7,32
Deutschland	8,42	4,74
Irland	6,60	6,40
Italien	6,46	14,94
Japan	6,54	6,39
Luxemburg	4,82	1,63
Niederlande	0,41	0,18
Neuseeland	0,72	0,63
Peru	0,02	0,02
Rumänien	0,11	k. A.
Slowenien	k. A.	0,05
Spanien	0,73	0,67
Supranational	2,70	0,39
Schweden	1,23	1,01
Schweiz	0,08	0,26
Großbritannien	18,79	19,01
USA	100,85	94,50
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,55
Investmentfonds	0,22	0,04
Pensionsgeschäfte	0,06	0,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,29)	(0,83)
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,18)	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,01)	0,00
Zinsswapoptionen	(0,09)	(0,27)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	1,05	(0,71)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,73)	0,84
Sonstige Aktiva und Passiva	(73,13)	(62,74)
Nettovermögen	100,00	100,00







## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2024	205	\$ 46	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	627	(98)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	329	(408)	(0,02)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	199	(261)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2024	40	(1)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	1.272	(1.684)	(0,08)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	35	51	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	221	(320)	(0,02)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	1.029	(413)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	2.891	(1.090)	(0,05)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	1.915	(938)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	764	(767)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	35	(52)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	4	4	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	775	(725)	(0,03)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	127	51	0,00
				\$ (6.605)	(0,31)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURES-AHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - EUREX Euro-Schatz August 2024 Futures	€ 106,200	26.07.2024	852	\$ (147)	\$ (59)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (6.664)	(0,31)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	18.09.2054	£ 21.200	\$ (506)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	2.100	37	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	18.09.2026	24.500	59	0,00
Erhalt		1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 5.177.000	50	0,00
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,237	21.11.2053	\$ 22.000	5.631	0,26
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,340	21.11.2028	113.800	(8.322)	(0,38)
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	26.100	3.760	0,17
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	62.600	(4.369)	(0,20)
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	16.700	(987)	(0,05)
Zahlung		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	13.000	196	0,01
Erhalt		1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,700	15.02.2026	42.950	328	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 111.900	4.345	0,20
Zahlung <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	253.200	(5.427)	(0,25)
Erhalt <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	3,670	24.07.2024	1.963.300	(1)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	3,750	23.08.2024	842.700	327	0,01
Zahlung		CPTFEMU	2,243	15.05.2034	6.800	46	0,00
Erhalt		CPTFEMU	2,359	15.08.2030	25.700	521	0,02
Erhalt		CPTFEMU	2,600	15.05.2032	11.100	247	0,01
Zahlung		CPTFEMU	2,680	15.04.2053	6.400	423	0,02
Zahlung		CPTFEMU	2,700	15.04.2053	4.100	351	0,02
Erhalt		CPTFEMU	2,720	15.06.2032	63.300	(316)	(0,01)
Zahlung		CPTFEMU	2,763	15.09.2053	6.900	607	0,03
Erhalt		CPTFEMU	2,975	15.08.2027	17.800	(37)	0,00
Zahlung		CPTFEMU	3,520	15.09.2024	23.800	(177)	(0,01)
Zahlung		CPTFEMU	3,720	15.09.2024	6.400	(11)	0,00
Zahlung		CPURNSA	1,760	04.11.2029	\$ 23.300	(3.814)	(0,18)
Zahlung		CPURNSA	1,883	20.11.2029	300	(46)	0,00
Zahlung		CPURNSA	1,954	03.06.2029	6.200	(902)	(0,04)
Zahlung		CPURNSA	1,998	25.07.2029	1.800	(251)	(0,01)
Erhalt		CPURNSA	2,311	24.02.2031	6.500	765	0,04
Zahlung		CPURNSA	2,364	10.05.2028	800	(79)	0,00
Zahlung		CPURNSA	2,370	06.06.2028	12.900	(1.287)	(0,06)
Zahlung		CPURNSA	2,379	09.07.2028	700	(68)	0,00
Zahlung		CPURNSA	2,510	08.09.2024	9.500	(53)	0,00
Erhalt		CPURNSA	2,573	26.08.2028	2.200	161	0,01
Erhalt		CPURNSA	2,645	10.09.2028	3.600	236	0,01
Erhalt		CPURNSA	2,690	01.06.2026	2.300	203	0,01
Zahlung		UKRPI	4,040	15.04.2029	£ 11.500	83	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	UKRPI	4,143 %	15.10.2032	£ 7.800	\$ (326)	(0,02)
Erhalt	UKRPI	4,615	15.02.2027	12.300	569	0,03
					\$ (8.034)	(0,37)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (8.034)	(0,37)

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	7.800	\$ (356)	\$ (277)	(0,01)

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950 %	15.09.2025	26.700	\$ (323)	\$ (294)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	15.09.2025	26.700	(323)	(168)	(0,01)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,465	04.12.2025	17.700	(213)	(119)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,465	04.12.2025	17.700	(213)	(193)	(0,01)
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900	29.08.2025	16.800	(218)	(163)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	16.800	(218)	(103)	(0,01)
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	36.200	(458)	(312)	(0,01)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	36.200	(458)	(254)	(0,01)
							\$ (2.424)	\$ (1.606)	(0,08)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens	
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 8.388	\$ (449)	\$ 447	\$ (2)	0,00	
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.500	(5)	(14)	(19)	0,00	
						\$ (454)	\$ 433	\$ (21)	0,00

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2024	NZD	\$ 70.100	\$ 43.013	\$ 298	\$ 298	0,01	
	07.2024	\$	9.007	NZD 14.707	0	(45)	0,00	
	08.2024	NZD	14.707	\$ 9.007	45	45	0,00	
	10.2024	\$	3.300	CNH 23.622	0	(37)	0,00	
BOA	07.2024	€	711.874	\$ 772.881	9.930	9.930	0,46	
	07.2024	SGD	68	50	0	0	0,00	
	07.2024	\$	729	PLN 2.903	0	(7)	0,00	
	07.2024		1.251	SGD 1.688	0	(5)	0,00	
BPS	08.2024	SGD	68	\$ 50	0	0	0,00	
	07.2024	AUD	750	496	0	(5)	0,00	
	07.2024	BRL	4.892	973	92	92	0,00	
	07.2024	€	156.518	169.475	1.727	0	1.727	0,08
	07.2024	£	4.031	5.122	27	0	27	0,00
	07.2024	KRW	6.605.688	4.813	16	0	16	0,00
	07.2024	\$	32.737	AUD 49.132	76	0	76	0,00
	07.2024		193.803	€ 181.192	390	0	390	0,02
	07.2024		600	IDR 9.831.834	1	0	1	0,00
	07.2024		152	ILS 565	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024		1.684	NZD 2.742	0	(14)	(14)	0,00
	07.2024		1.717	PLN 6.820	0	(21)	(21)	0,00
07.2024		4.175	SGD 5.662	3	0	3	0,00	
08.2024	AUD	49.132	\$ 32.765	0	(75)	(75)	0,00	

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	08.2024	€	181.192	\$ 194.086	\$ 0	\$ (390)	(0,02)
	08.2024	SGD	5.654	4.175	0	(3)	0,00
	09.2024	CNH	55.023	7.678	98	0	0,01
	09.2024	TWD	157.659	4.900	30	0	0,00
	09.2024	\$	1.305	INR 109.212	2	0	0,00
	10.2024	CNH	18.967	\$ 2.649	29	0	0,00
	10.2024	\$	658	CNH 4.714	0	(7)	0,00
BRC	07.2024	DKK	43.968	\$ 6.401	82	0	0,00
	07.2024	£	6.384	8.163	93	0	0,01
	07.2024	MXN	12.714	688	0	(6)	0,00
	07.2024	PLN	14	3	0	0	0,00
	07.2024	SGD	1.620	1.200	4	0	0,00
	07.2024	THB	1.835	50	0	0	0,00
	07.2024	\$	104	NOK 1.089	0	(1)	0,00
	07.2024		1.053	PLN 4.206	0	(7)	0,00
	07.2024		25.547	SEK 270.753	19	0	0,00
	08.2024	SEK	270.339	\$ 25.547	0	(19)	0,00
	09.2024	MXN	7.389	398	0	(1)	0,00
	09.2024	\$	6.465	MXN 121.127	80	0	0,00
CBK	07.2024	CHF	1.067	\$ 1.172	0	(15)	0,00
	07.2024	KRW	350.371	257	2	0	0,00
	07.2024	\$	3.327	BRL 18.129	0	(63)	0,00
	07.2024		1.079	€ 1.006	0	(1)	0,00
	07.2024		12.474	£ 9.759	0	(138)	(0,01)
	07.2024		1.865	PLN 7.398	0	(25)	0,00
	07.2024		15	ZAR 273	0	0	0,00
	08.2024	BRL	18.190	\$ 3.327	64	0	0,00
	08.2024	PEN	4.139	1.096	15	0	0,00
	08.2024	\$	1.004	£ 794	0	0	0,00
	09.2024	TWD	60.110	\$ 1.865	8	0	0,00
	09.2024	\$	5.852	INR 489.233	4	(2)	0,00
DUB	07.2024	BRL	264	\$ 50	2	0	0,00
	07.2024	£	493.557	629.769	5.864	0	5,864
	07.2024	KRW	2.952.658	2.146	2	0	0,00
	07.2024	\$	1.797	PLN 7.061	0	(41)	0,00
	07.2024		4.083	SEK 43.212	0	(2)	0,00
	08.2024	BRL	4.310	\$ 837	64	0	0,00
	08.2024	SEK	43.145	4.083	2	0	0,00
FAR	07.2024	AUD	49.914	33.256	0	(79)	0,00
	07.2024	¥	17.105.893	109.540	3.200	0	3,200
	07.2024	\$	17.237	NZD 28.262	0	(16)	0,00
	08.2024	NZD	28.262	\$ 17.237	16	0	0,00
GLM	07.2024	KRW	3.849	3	0	0	0,00
	07.2024	MXN	11.860	639	0	(9)	0,00
	07.2024	\$	7.343	€ 6.842	0	(10)	0,00
	07.2024		50	KRW 68.690	0	0	0,00
	07.2024		1.147	PLN 4.533	0	(20)	0,00
	07.2024		3.222	ZAR 58.954	2	0	0,00
	08.2024		5.136	BRL 26.346	0	(410)	(0,02)
JPM	07.2024	BRL	1.404	\$ 279	26	0	0,00
	07.2024	CHF	634	701	0	(5)	0,00
	07.2024	IDR	3.005.773	185	2	0	0,00
	07.2024	KRW	5.215.136	3.781	0	(7)	0,00
	07.2024	SGD	5.598	4.159	28	0	0,00
	07.2024	\$	9.054	CHF 8.125	0	(12)	0,00
	07.2024		9.531	DKK 66.422	15	0	0,00
	07.2024		449	ILS 1.661	0	(8)	0,00
	07.2024		715	PLN 2.795	0	(19)	0,00
	07.2024		6.066	ZAR 111.671	42	0	0,00
	08.2024	AUD	820	\$ 547	0	(1)	0,00
	08.2024	CHF	8.095	9.054	12	0	0,00
	08.2024	DKK	66.305	9.531	0	(15)	0,00
	09.2024	TWD	102.268	3.177	18	0	0,00
	09.2024	\$	666	INR 55.807	2	0	0,00
	10.2024	CNH	32.675	\$ 4.566	52	0	0,00
	10.2024	\$	658	CNH 4.699	0	(9)	0,00
MBC	07.2024	CAD	60.707	\$ 44.585	220	0	0,01
	07.2024	DKK	114	17	0	0	0,00
	07.2024	€	4.627	4.998	39	0	0,00
	07.2024	NOK	847	80	0	0	0,00
	07.2024	SEK	313.865	29.881	244	0	0,01
	07.2024	SGD	64	48	0	0	0,00
	07.2024	\$	44.367	CAD 60.745	26	0	0,00
	07.2024		738.111	€ 690.261	1.689	(13)	1,676
	07.2024		625.278	£ 494.213	0	(544)	(0,02)
	07.2024		101	ZAR 1.863	1	0	0,00
	08.2024	CAD	60.704	\$ 44.367	0	(28)	0,00
	08.2024	€	689.474	738.332	0	(1.689)	(0,08)
	08.2024	£	494.213	625.383	535	0	0,03
	08.2024	\$	80	NOK 846	0	0	0,00
MYI	07.2024	BRL	11.565	\$ 2.239	157	0	0,01
	07.2024	NOK	242	23	0	0	0,00
	07.2024	\$	95	CHF 85	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2024	\$	6.531 DKK	45.587	\$ 20	\$ 0	\$ 20	0,00
	07.2024		895 €	836	2	0	2	0,00
	07.2024		5.042 £	3.986	1	(4)	(3)	0,00
	07.2024		1.819 NZD	2.966	0	(12)	(12)	0,00
	08.2024	DKK	45.506	\$ 6.531	0	(20)	(20)	0,00
	08.2024	\$	23 NOK	242	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD	40.683	\$ 1.268	11	0	11	0,00
	09.2024	\$	445 INR	37.251	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	€	6.282	\$ 6.823	91	0	91	0,00
RYL	07.2024	\$	1.022 AUD	1.532	1	0	1	0,00
SCX	07.2024	IDR	164.120	\$ 10	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW	2.760.673	2.024	19	0	19	0,00
	07.2024	MXN	130	7	0	0	0	0,00
	07.2024	ZAR	927	50	0	0	0	0,00
	08.2024	PEN	4.805	1.271	16	0	16	0,00
	09.2024	CNH	22.580	3.147	37	0	37	0,00
	09.2024	TWD	59.135	1.834	8	0	8	0,00
	09.2024	\$	5.372 INR	449.645	8	0	8	0,00
TOR	07.2024	CHF	29	\$ 32	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	106.985 ¥	17.106.963	0	(638)	(638)	(0,03)
	07.2024		13.121 NZD	21.422	0	(67)	(67)	0,00
	08.2024	¥	17.026.745	\$ 106.985	637	0	637	0,03
	08.2024	NZD	21.422	13.121	67	0	67	0,00
UAG	07.2024	CHF	6.400	7.082	0	(40)	(40)	0,00
	07.2024	DKK	68.060	9.884	103	0	103	0,01
	07.2024	ILS	2.296	620	10	0	10	0,00
	08.2024	€	21.914	23.467	0	(54)	(54)	0,00
	09.2024	MXN	12.174	641	0	(17)	(17)	0,00
					\$ 26.426	\$ (4.678)	\$ 21.748	1,01

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend und Investor CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2024	\$	24.752 CHF	22.265	\$ 25	\$ 0	\$ 25	0,00
BRC	07.2024	CHF	33	\$ 37	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	\$	2.471 CHF	2.249	32	0	32	0,00
JPM	07.2024	CHF	26.357	\$ 29.371	39	0	39	0,00
	07.2024	\$	7 CHF	6	0	0	0	0,00
	08.2024		29.371	26.260	0	(38)	(38)	0,00
MBC	07.2024	CHF	13	\$ 15	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	754 CHF	673	0	(5)	(5)	0,00
	08.2024		2	2	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	CHF	21	\$ 24	0	0	0	0,00
SCX	07.2024		56	63	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	171 CHF	153	0	0	0	0,00
TOR	07.2024		28.800	26.015	150	0	150	0,01
UAG	07.2024	CHF	26.161	\$ 29.158	45	0	45	0,00
	07.2024	\$	28.410 CHF	25.673	160	0	160	0,01
	08.2024		29.158	26.064	0	(44)	(44)	0,00
					\$ 451	\$ (87)	\$ 364	0,02

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2024	NZD	94	\$ 58	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	\$	58 NZD	94	0	0	0	0,00
BPS	07.2024	AUD	767	\$ 511	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$	168 CAD	229	0	0	0	0,00
	07.2024		10.559 £	8.266	0	(110)	(110)	(0,01)
	07.2024		0 ¥	58	0	0	0	0,00
	08.2024		511 AUD	767	1	0	1	0,00
BRC	07.2024		26 DKK	177	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	£	95	\$ 121	1	0	1	0,00
	07.2024	\$	336 SEK	3.569	1	0	1	0,00
FAR	07.2024	NZD	181	\$ 110	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	511 AUD	767	1	0	1	0,00
	07.2024		9.774 €	8.973	0	(156)	(156)	(0,01)
	07.2024		969 ¥	151.325	0	(28)	(28)	0,00
	07.2024		254 NZD	412	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024		110	181	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	DKK	267	\$ 38	0	0	0	0,00
	08.2024	\$	38 DKK	267	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	CAD	1.053	\$ 769	0	(1)	(1)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	¥ 151.393	\$ 943	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2024	SEK 9		0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 604	CAD 823	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	769	1.052	0	0	0	0,00
	08.2024	943	¥ 150.684	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2024	DKK 184	\$ 26	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 3.564	337	1	0	1	0,00
	08.2024	\$ 26	DKK 183	0	0	0	0,00
	08.2024	337	SEK 3.559	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07.2024	£ 8.170	\$ 10.361	33	0	33	0,00
	08.2024	\$ 10.363	£ 8.170	0	(33)	(33)	0,00
RYL	07.2024	0	DKK 0	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	€ 8.973	\$ 9.614	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	\$ 9.628	€ 8.973	3	0	3	0,00
TOR	07.2024	NZD 137	\$ 84	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 84	NZD 137	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07.2024	40	DKK 274	0	0	0	0,00
				\$ 43	\$ (342)	\$ (299)	(0,02)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 548	\$ 595	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	07.2024	\$ 331.137	€ 304.999	0	(4.255)	(4.255)	(0,20)
BPS	07.2024	€ 274.689	\$ 293.863	38	(573)	(535)	(0,03)
	07.2024	\$ 285.483	€ 263.701	0	(2.861)	(2.861)	(0,13)
	08.2024	285.178	266.232	573	0	573	0,03
BRC	07.2024	€ 122	\$ 131	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	370	397	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 386	€ 354	0	(6)	(6)	0,00
FAR	07.2024	324.449	297.891	0	(5.185)	(5.185)	(0,24)
GLM	07.2024	€ 788	\$ 853	9	0	9	0,00
JPM	07.2024	31.356	33.553	0	(53)	(53)	0,00
MBC	07.2024	284.191	303.934	26	(674)	(648)	(0,03)
	08.2024	\$ 294.463	€ 274.978	674	0	674	0,03
MYI	07.2024	€ 515	\$ 552	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	760	826	11	0	11	0,00
RYL	07.2024	514	550	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2024	275.028	294.666	0	(96)	(96)	0,00
	08.2024	\$ 294.795	€ 274.745	93	0	93	0,00
SSB	07.2024	2.101	1.937	0	(25)	(25)	0,00
UAG	08.2024	€ 367	\$ 393	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1.432	\$ (13.730)	\$ (12.298)	(0,57)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und R Class GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 74.460	\$ 94.156	\$ 31	\$ 0	\$ 31	0,00
	07.2024	\$ 192.527	£ 151.083	0	(1.544)	(1.544)	(0,07)
	08.2024	93.983	74.312	0	(29)	(29)	0,00
BRC	07.2024	£ 370	\$ 473	5	0	5	0,00
CBK	07.2024	1.052	1.337	7	0	7	0,00
	07.2024	\$ 694	£ 545	0	(5)	(5)	0,00
	08.2024	£ 48	\$ 61	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	\$ 99.662	£ 78.106	0	(928)	(928)	(0,04)
MBC	07.2024	£ 76.989	\$ 97.411	89	0	89	0,00
	07.2024	\$ 223	£ 176	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	96.916	76.588	0	(83)	(83)	0,00
RBC	07.2024	£ 76.622	\$ 97.164	307	0	307	0,01
	08.2024	\$ 97.181	£ 76.622	0	(305)	(305)	(0,01)
RYL	07.2024	£ 417	\$ 533	7	0	7	0,00
				\$ 446	\$ (2.895)	\$ (2.449)	(0,11)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 120.811	\$ 89.008	\$ 0	\$ (135)	\$ (135)	(0,01)
	07.2024	\$ 82.353	SGD 111.147	0	(340)	(340)	(0,02)
	08.2024	89.008	120.633	135	0	135	0,01
BPS	07.2024	SGD 121.542	\$ 89.617	0	(66)	(66)	0,00
	08.2024	\$ 89.617	SGD 121.367	69	0	69	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2024	\$ 986	SGD 1.330	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
JPM	07.2024	89.721	120.762	0	(614)	(614)	(0,03)
MYI	07.2024	49	66	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	89.213	120.211	0	(513)	(513)	(0,02)
				\$ 204	\$ (1.672)	\$ (1.468)	(0,07)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						\$ 3.694	0,17
<b>Summe Anlagen</b>						\$ 3.642.814	168,35
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						\$ (1.479.028)	(68,35)
<b>Nettovermögen</b>						\$ 2.163.786	100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Mit dem Fonds verbunden.

(c) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 1.320.131 USD (31. Dezember 2023: 1.193.907 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(d) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 8.425 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurde zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 3.132 USD (31. Dezember 2023: 4.789 USD) und Barmittel in Höhe von 419 USD (31. Dezember 2023: 3.304 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 33.589 USD (31. Dezember 2023: 32.998 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 7.910 USD (31. Dezember 2023: 20.690 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.653.399	\$ 4	\$ 3.653.403
Investmentfonds	415	0	0	415
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(3.096)	(7.908)	0	(11.004)
<b>Summen</b>	\$ (2.681)	\$ 3.645.491	\$ 4	\$ 3.642.814

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.694.700	\$ 5.369	\$ 3.700.069
Investmentfonds	23.397	0	0	23.397
Pensionsgeschäfte	0	2.878	0	2.878
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(9.807)	(13.514)	0	(23.321)
<b>Summen</b>	\$ 13.590	\$ 3.684.064	\$ 5.369	\$ 3.703.023

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,470 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ (2.958)	\$ (2.959)	(0,14)
		5,480	28.06.2024	(2.398)	(2.399)	(0,11)
CIB	5,420	23.05.2024	09.07.2024	(162.074)	(163.026)	(7,53)
MEI	3,680	12.06.2024	24.07.2024	€ (33.316)	(35.776)	(1,65)
NOM	5,430	29.05.2024	10.07.2024	\$ (345.066)	(346.784)	(16,03)
	5,430	21.06.2024	10.07.2024	(28.033)	(28.075)	(1,30)
SCX	3,760	12.06.2024	24.07.2024	€ (27.603)	(29.643)	(1,37)
STR	5,450	28.06.2024	01.07.2024	\$ (599.719)	(599.991)	(27,73)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					\$ (1.208.653)	(55,86)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BRC	5,540 %	27.06.2024	05.07.2024	\$ (8.442)	\$ (8.448)	(0,39)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (8.448)</b>	<b>(0,39)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 5 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 261	\$ 0	\$ 261	\$ (470)	\$ 350	\$ (120)
BOA	5.356	(5.700)	(344)	(2.771)	2.700	(71)
BPS	(2.498)	2.410	(88)	(4.313)	6.400	2.087
BRC	249	(260)	(11)	1.986	(3.850)	(1.864)
CBK	(587)	(90)	(677)	(1.090)	660	(430)
DUB	4.963	(4.620)	343	470	(350)	120
FAR	(2.250)	2.510	260	(1.133)	1.000	(133)
GLM	(1.293)	920	(373)	(2.794)	2.320	(474)
GST	(568)	650	82	(932)	900	(32)
JPM	(545)	720	175	46	0	46
MBC	502	(460)	42	2.587	(4.050)	(1.463)
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(27)	0	(27)
MYI	155	0	155	928	(1.200)	(272)
RBC	104	0	104	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	7	0	7	(4)	0	(4)
SAL	(19)	130	111	(9)	130	121
SCX	(428)	570	142	(4.738)	5.720	982
SSB	(25)	0	(25)	645	(560)	85
TOR	148	(360)	(212)	613	(440)	173
UAG	162	(300)	(138)	(163)	510	347

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	143,72	131,53
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	22,42	23,61
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,70	0,26
Investmentfonds	0,02	0,98
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,31)	(0,78)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,37)	0,27
Freiverkehrsfinanzderivate	0,17	(0,47)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(55,86)	(65,39)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,39)	k. A.

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	1,29	1,22
Belgien	k. A.	0,08
Kanada	1,92	1,61
Cayman-Inseln	0,66	1,09
Dänemark	0,73	2,92
Frankreich	10,64	9,43
Deutschland	6,76	3,63
Irland	8,66	9,23
Italien	13,84	12,38
Japan	4,95	5,12
Luxemburg	2,35	0,87
Niederlande	0,81	0,75
Neuseeland	2,06	1,87
Peru	0,01	0,01
Slowenien	k. A.	0,04
Spanien	2,37	2,27
Supranational	2,43	0,37
Schweden	1,41	1,33
Schweiz	0,18	0,17
Großbritannien	27,13	28,51
USA	80,64	71,99

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,51
Investmentfonds	0,02	0,98
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,31)	(0,76)
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,37)	0,27
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,08)	(0,23)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	1,01	(0,83)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,75)	0,60
Sonstige Aktiva und Passiva	(68,35)	(55,52)
Nettovermögen	100,00	100,00









































## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Westmoreland Mining LLC (e)(l)	102.178	\$ 332	0,00	<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
		335	0,00	Uniti Group, Inc.	726.414	\$ 2.121	0,00	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
				VICI Properties, Inc.	5.793.243	165.919	0,21	PIMCO Select Funds			
						168.040	0,21	plc - PIMCO			
<b>IMMOBILIEN</b>								US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)	268.980.943	\$ 2.680.539	3,40
ADLER Group S.A. (e)	4.488	1	0,00								
		618.104	0,78								
				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
<b>OPTIONSSCHEINE</b>				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				PIMCO ETFs plc -			
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071 (l)	4	0	0,00	Gateway Re Ltd. 5,355 % fällig am 23.12.2028	\$ 5.500	5.054	0,01	PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (i)	2.903.000	290.460	0,37
Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17.02.2027	160.093	400	0,00	5,355 % fällig am 23.12.2028	900	841	0,00				
		400	0,00	TER Finance Jersey Ltd. 7,020 % fällig am 02.01.2025 (f)	10.100	9.739	0,01	<b>Summe Investmentfonds</b>		\$ 2.970.999	3,77
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				Summe kurzfristige Instrumente		15.634	0,02				
Nationwide Building Society 10,250 %	811.496	134.079	0,17	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$108.870.993	138,11				
Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	12.927	0	0,00								
		134.079	0,17								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
BOM	4,710 %	24.06.2024	02.07.2024	CAD 580.000	Canada Government International Bond 3,000 % fällig am 01.06.2034	\$ (279.765) (146.372)	\$ 423.868	\$ 424.251	0,54
	4,710	26.06.2024	03.07.2024	120.000	Province of Ontario 2,900 % fällig am 02.06.2049	(88.937)	87.697	87.753	0,11
	4,710	28.06.2024	02.07.2024	280.000	Canada Government International Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	(208.258)	204.626	204.705	0,26
	4,710	28.06.2024	08.07.2024	920.000	Province of Ontario fällig am 01.06.2034	(682.878)	672.343	672.603	0,85
CEW	4,720	24.06.2024	02.07.2024	890.000	Province of Ontario 2,550 % - 4,650 % fällig am 02.06.2041 - 02.12.2052	(647.101) (6.790)	650.418	651.007	0,83
	4,720	25.06.2024	03.07.2024	770.000	Province of Ontario 2,250 % - 2,650 % fällig am 02.06.2027 - 02.12.2052	(565.495)	562.722	563.158	0,71
	4,720	27.06.2024	05.07.2024	1.780.000	Province of British Columbia 2,800 % fällig am 18.06.2048	(27.895)	1.300.836	1.301.509	1,65
					Province of Ontario 2,900 % - 4,650 % fällig am 02.06.2041 - 02.06.2049	(1.068.983) (222.068)			
	4,720	28.06.2024	08.07.2024	850.000	Province of Quebec 3,500 % fällig am 01.12.2048	(376.263)	621.186	621.427	0,79
					Province of Ontario 1,350 % - 2,800 % fällig am 02.12.2030 - 02.06.2048				
					Province of Quebec 4,250 % - 5,000 % fällig am 01.12.2041 - 01.12.2043	(256.381)			
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	\$ 8.088	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 31.12.2025	(8.250)	8.088	8.088	0,01
MEI	4,710	25.06.2024	03.07.2024	CAD 150.000	Canada Government International Bond 3,000 % - 3,250 % fällig am 01.09.2028 - 01.06.2034	(111.210)	109.621	109.706	0,14
	4,710	26.06.2024	03.07.2024	90.000	Canada Government International Bond 4,500 % fällig am 01.11.2025	(67.154)	65.773	65.815	0,08
	4,710	27.06.2024	05.07.2024	670.000	Canada Government International Bond 1,500 % - 3,250 % fällig am 01.09.2028 - 01.06.2032	(370.535)	489.641	489.893	0,62
					Canada Housing Trust 1,800 % - 4,250 % fällig am 15.12.2024 - 15.03.2034	(128.513)			
	4,710	28.06.2024	08.07.2024	470.000	Canada Housing Trust 1,600 % fällig am 15.12.2031	(124.072)	343.479	343.612	0,44
					Province of Ontario 2,700 % - 3,750 % fällig am 02.06.2029 - 02.12.2053	(132.116)			
					Province of Quebec 3,250 % - 5,850 % fällig am 01.09.2032 - 01.12.2043	(93.388)			
SOG	5,380	23.01.2024	22.01.2026	\$ 1.760	Lloyds Banking Group PLC 4,976 % fällig am 08.11.2033	(1.816)	1.760	1.802	0,00
TOR	4,680	24.06.2024	02.07.2024	CAD 630.000	Province of Ontario 2,900 % fällig am 02.12.2046	(275.406)	460.409	460.822	0,58
					Province of Quebec 2,850 % - 4,250 % fällig am 01.12.2043 - 01.12.2053	(187.410)			
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (6.077.056)</b>	<b>\$ 6.002.467</b>	<b>\$ 6.006.151</b>	<b>7,61</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	1.188	\$ 7.752	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	1.289	5.865	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	1.498	11.014	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	1.206	6.452	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	1.087	6.439	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	1.206	5.106	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	1.390	9.867	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	986	4.823	0,01
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	230	(1)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	3.750	(3.739)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	793	403	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	10.007	4.951	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	22.345	13.869	0,02
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	723	850	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	9.144	(6.269)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	6.106	(4.197)	(0,01)
				\$ 63.185	0,08

## VERKAUFSOPTIONEN

## FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 109,000	26.07.2024	159	\$ (45)	\$ (60)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	112,000	26.07.2024	159	(47)	(21)	0,00
				\$ (92)	\$ (81)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 63.104	0,08

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.06.2028	€ 13.400	\$ 2	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	\$ 9.500	(37)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	9.400	(43)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	29.400	643	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2024	5.570	153	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2025	11.800	219	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	11.700	237	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	35.600	(2)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2029	12.000	(85)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	12.100	(865)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2026	3.300	(85)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2026	4.400	(102)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2027	3.300	62	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2028	15.700	22	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2024	44.900	(1.631)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	24.800	(791)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2025	25.300	599	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	8.200	(203)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2026	6.600	(85)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	11.500	88	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	7.600	169	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	53.500	428	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	6.700	52	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 10.000	773	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	25.100	2.807	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2026	41.400	3.835	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2026	114.700	7.514	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2027	18.100	1.918	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2024	\$ 155.600	131	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	6.700	(68)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	32.300	(297)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	36.150	689	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	7.100	140	0,00
				\$ 16.187	0,02

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz (1,000) %	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index		20.12.2025	\$ 107.200	\$ 1.347	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000 %	20.12.2024	\$ 71.910	\$ 3.248	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	218.224	9.707	0,01
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	1.380	42	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	493.028	35.354	0,04
CDX.EM-37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	6.958	507	0,00
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	62.500	4.419	0,01
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	31.300	1.586	0,00
CDX.EM-40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	198.900	4.645	0,01
CDX.EM-41 5-Year Index	1,000	20.06.2029	123.700	609	0,00
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000	20.06.2025	4.984	(266)	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	8.245	(311)	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	413.317	12.239	0,02
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	148.119	2.192	0,00
CDX.HY-38 5-Year Index	5,000	20.06.2027	26.869	1.862	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	28.126	967	0,00
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	19.701	1.271	0,00
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	983.862	52.845	0,07
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000	20.06.2029	1.980.400	(8.223)	(0,01)
CDX.IG-37 5-Year Index	1,000	20.12.2026	1.400	(8)	0,00
CDX.IG-38 5-Year Index	1,000	20.06.2027	400	4	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	200	2	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	1.300	9	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	92.700	522	0,00
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	1.434.700	(1.754)	0,00
				\$ 121.468	0,15

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2030	£ 254.700	\$ 7.003	0,01
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,060	21.02.2052	14.400	(8.865)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,096	14.02.2052	31.300	(19.065)	(0,02)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101	21.02.2052	14.400	(8.738)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	28.800	(16.971)	(0,02)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,700	28.03.2034	24.100	665	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	925.000	24.056	0,03
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	5.706.530	(66.180)	(0,08)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320	20.10.2033	20.700	823	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,020	20.09.2028	¥ 395.820.000	56.217	0,07
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	22.270.000	(1.172)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	31.750.700	4.909	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	15.498.000	6.085	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,700	18.09.2029	53.893.000	(176)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	5.408.000	2.510	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	18.09.2034	27.764.000	(177)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	5,890	20.09.2026	48.830.000	(2.875)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	5,890	15.03.2029	344.670.000	16.793	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	\$ 1.090.500	(58.419)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	2.503.737	(221.167)	(0,28)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,550	15.01.2031	4.567.800	1.003.811	1,27
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,674	05.08.2030	62.900	13.022	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,678	29.07.2030	65.200	13.500	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,711	28.07.2030	69.000	14.164	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,715	27.07.2030	200.000	41.014	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	30.03.2031	963.600	202.280	0,26
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	3.358.883	(398.184)	(0,51)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,800	15.01.2051	1.479.300	814.817	1,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,928	06.05.2026	150.100	11.827	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,975	17.06.2052	52.200	21.666	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,990	24.06.2052	75.000	30.809	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	386.590	23.186	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	495.770	43.986	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	120.615	21.983	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,035	28.06.2052	25.900	10.589	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,144	04.11.2050	49.600	(23.202)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,150	30.03.2051	191.500	16.519	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,215	13.10.2050	83.500	(39.152)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,235	12.05.2028	75.400	9.195	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	1.654.500	(155.840)	(0,20)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	15.560	2.257	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250 %	15.06.2032	\$ 635.270	\$ (63.255)	(0,08)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	1.456.600	408.035	0,52
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,280	24.03.2028	423.400	(44.660)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,306	02.11.2051	48.000	18.978	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,317	16.12.2050	33.800	(14.768)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	109.100	9.315	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	387.430	32.564	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	91.400	16.824	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	61.300	11.261	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	212.800	(17.722)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,405	07.09.2031	154.300	27.929	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,418	20.01.2027	71.900	(5.885)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,420	24.02.2027	269.100	22.060	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	146.000	(11.831)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,443	18.01.2027	157.300	(12.654)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	361.600	29.485	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	137.000	24.758	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,485	13.01.2051	78.100	(33.145)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	473.684	(65.502)	(0,08)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	85.443	10.569	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	05.10.2031	89.100	(15.668)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	43.100	(5.175)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	88.600	(15.371)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,535	22.10.2031	59.100	(10.195)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,545	26.10.2031	58.900	(10.113)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,550	20.01.2027	485.100	(36.996)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,570	11.01.2027	121.400	(9.426)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,570	12.01.2027	76.200	(5.920)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,573	28.02.2027	96.300	(7.857)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	150.400	(11.286)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,595	13.01.2051	82.600	(33.435)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	943.900	48.855	0,06
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	15.02.2027	1.549.700	(114.405)	(0,15)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	27.100	(3.143)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,620	18.04.2027	153.700	(11.729)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	60.000	(6.898)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	72.000	(8.235)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,650	24.02.2027	897.000	(64.487)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	91.900	(14.947)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,655	24.01.2032	72.000	(12.121)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	1.446.200	(102.306)	(0,13)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	12.01.2029	310.700	(34.412)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	86.300	(13.459)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,735	12.01.2032	57.800	(9.461)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	190.144	9.127	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	209.290	13.171	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	96.400	(8.449)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	30.400	(4.599)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,770	14.02.2032	81.500	(12.572)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	114.300	(8.138)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	76.100	30.049	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	114.800	(8.090)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	14.400	(5.356)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	318.600	(46.669)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	14.400	(5.213)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	160.000	(22.759)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	159.500	(11.167)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,945	23.06.2051	127.800	46.173	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,988	09.02.2032	22.000	3.117	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	193.480	3.491	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	910.590	23.731	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	18.02.2032	133.700	(18.623)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	1.477.810	63.299	0,08
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	324.000	32.369	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,008	09.02.2032	36.700	5.213	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,185	21.04.2029	96.000	(8.240)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	678.900	34.494	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	1.204.900	36.160	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,370	21.06.2027	159.400	(8.121)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	26.800	2.632	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,430	30.09.2027	230.020	18.106	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	2.408.100	71.353	0,09
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	221.690	17.213	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,451	08.06.2032	90.600	8.591	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,468	27.07.2028	79.800	(5.344)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,537	24.07.2053	20.300	(3.410)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,550	21.07.2053	20.300	(3.381)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,605	28.06.2027	158.600	(11.407)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,675	24.07.2028	81.100	(4.712)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,680	11.07.2032	27.300	(2.771)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,690	04.04.2025	41.500	(722)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,690	11.07.2032	27.300	(2.744)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,697	04.04.2025	249.100	(4.317)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,700 %	21.07.2028	\$ 79.700	\$ (4.546)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,721	10.04.2025	80.600	(1.389)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,765	27.07.2024	377.400	(8.087)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	77.400	(1.496)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,850	30.08.2027	137.400	(8.170)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,880	30.09.2027	657.200	(35.637)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	633.400	(33.850)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	78.600	(1.471)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	96.700	(1.872)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	141.800	(7.323)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	77.700	(1.405)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	82.900	(1.508)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	2.179.420	88.027	0,11
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	710.885	41.102	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	77.900	(1.401)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	21.07.2024	377.000	(7.036)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	69.900	(3.591)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	69.900	(4.218)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	104.600	(7.870)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,052	24.07.2024	376.700	(6.945)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	29.400	(3.483)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	77.800	(1.275)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	70.000	(4.021)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	77.500	(1.255)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	77.500	(1.222)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	77.500	(1.196)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	2.045.860	68.754	0,09
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	54.100	(2.803)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	86.000	(3.343)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	28.200	1.687	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	52.300	(2.391)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	12.07.2053	40.100	(3.306)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	49.800	(2.186)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	53.700	(2.318)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	88.200	(3.381)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	53.900	(2.269)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	53.600	(2.236)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	109.100	(4.386)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	102.500	(3.267)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2026	195.110	3.465	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	175.800	(4.252)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	4.138.645	113.520	0,14
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	5.163.180	138.224	0,18
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	117.200	(3.569)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	290.730	(5.286)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	37.900	(1.104)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,555	05.03.2054	21.800	(702)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,594	09.01.2034	53.500	2.007	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,600	17.01.2034	51.000	2.103	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	56.700	2.286	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,620	31.01.2034	26.100	(784)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,648	08.01.2034	52.100	1.962	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	155.600	(2.236)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	158.300	(2.315)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	10.07.2033	60.400	(2.295)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.03.2034	54.400	(1.418)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,655	24.01.2034	26.500	(733)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,665	24.01.2034	53.000	(1.424)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,670	08.01.2034	52.900	1.901	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	26.000	907	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,685	24.01.2034	53.200	(1.338)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	3.050.720	87.887	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	05.03.2034	27.300	(611)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,710	05.03.2034	54.100	(1.170)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,725	07.02.2034	26.000	(527)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	30.800	(917)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	33.100	(955)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	23.01.2034	26.700	(560)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,738	23.01.2034	15.900	(329)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	155.600	(2.060)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	159.200	(2.156)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	13.12.2027	141.600	3.902	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	1.360.714	25.825	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	3.846.760	72.400	0,09
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	1.179.710	5.188	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	1.468.420	19.266	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2031	444.800	2.792	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	12.07.2033	57.200	(1.665)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	26.000	758	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	674.050	5.538	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	16.030	(164)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,760	23.08.2033	97.900	(2.552)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,783	07.02.2034	20.700	(320)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800 %	10.03.2028	\$ 104.800	\$ (1.751)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	24.500	(562)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	30.08.2033	49.300	(1.109)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	26.000	628	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	15.600	94	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	26.000	566	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	52.000	1.072	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,860	21.02.2034	106.200	(956)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	15.700	206	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	15.700	235	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	30.08.2033	49.400	(705)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	10.04.2034	55.300	(242)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	15.04.2034	27.100	(112)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	22.02.2029	159.500	(1.541)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	13.09.2033	146.600	(1.377)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	51.500	667	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	16.04.2034	55.100	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,970	27.02.2029	54.000	(438)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	103.700	(191)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	51.700	341	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,078	29.04.2034	55.300	567	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	17.04.2034	55.300	577	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	05.06.2034	56.200	(284)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,085	22.04.2034	55.300	642	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,090	30.04.2034	166.400	2.780	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,105	24.04.2034	84.800	1.080	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,130	03.05.2034	55.000	800	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	49.900	453	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	22.04.2034	56.400	931	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,165	27.09.2033	115.400	1.139	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	81.600	843	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	50.000	538	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,200	18.10.2033	39.900	518	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	50.300	744	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	25.100	398	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2029	208.940	6.089	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2031	239.020	8.286	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	51.700	(552)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	25.100	451	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	23.500	694	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	26.400	898	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	29.800	1.037	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	51.700	1.829	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	11.396.340	(38.431)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	6.663.690	(23.165)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,874	02.01.2026	BRL 453.700	(2.649)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,899	02.01.2026	229.400	(1.319)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,939	02.01.2026	366.700	(2.043)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,998	04.01.2027	669.600	(5.374)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,037	04.01.2027	163.900	(1.284)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,041	04.01.2027	696.800	(5.480)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,052	02.01.2026	857.800	(4.487)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,072	04.01.2027	388.330	(2.325)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,085	02.01.2026	851.400	(4.372)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,090	04.01.2027	1.313.900	(10.086)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,098	04.01.2027	1.174.240	(6.915)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,105	02.01.2026	843.500	(4.307)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,138	04.01.2027	326.900	(2.444)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,165	04.01.2027	595.440	(3.359)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,170	04.01.2027	993.630	(5.588)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,183	04.01.2027	1.784.770	(9.942)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,203	04.01.2027	1.390.590	(7.649)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,210	04.01.2027	200.330	(1.097)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,256	04.01.2027	1.389.360	(7.373)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,328	04.01.2027	1.084.260	(5.471)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,157	02.01.2025	26.500	(131)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,177	02.01.2025	17.600	(85)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,250	04.01.2027	32.000	(196)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,275	04.01.2027	16.100	(96)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,290	04.01.2027	16.200	(95)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,367	02.01.2025	21.800	(88)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,731	04.01.2027	8.300	(26)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,746	04.01.2027	35.900	(110)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,901	04.01.2027	85.800	(181)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,018	02.01.2025	59.500	(72)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,098	02.01.2025	98.900	(86)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,158	02.01.2025	49.800	(30)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,163	02.01.2025	48.800	(29)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,178	02.01.2025	99.600	(52)	0,00
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,000	16.06.2047	CAD 2.600	(15)	0,00
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	1,300	16.06.2047	2.500	(19)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,400	20.06.2029	6.300	12	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	1.042.300	13.119	0,02

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,750 %	19.06.2029	NZD 486.100	\$ 858	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,360	07.08.2028	ZAR 550.900	353	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,380	04.08.2028	275.800	188	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,400	07.08.2028	550.900	396	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	31.07.2028	252.300	(9)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	04.08.2028	664.400	493	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	07.08.2028	162.900	120	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	31.07.2028	201.400	152	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	04.08.2028	275.800	207	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,420	31.07.2028	753.500	577	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,421	04.08.2028	281.900	215	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,426	01.08.2028	304.400	236	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,428	31.07.2028	501.600	392	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	01.08.2028	513.900	433	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	02.08.2028	520.900	439	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,464	02.08.2028	522.200	444	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,543	04.08.2028	280.700	282	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,550	03.08.2028	554.000	566	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD 72.880	(1.336)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	1.179.040	(47.970)	(0,06)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024	197.200	(6.842)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025	361.600	(18.578)	(0,02)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024	97.200	(8.319)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	552.400	3.202	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	18.09.2034	53.300	(636)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	€ 907.700	(18.594)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,294	30.06.2026	6.200	447	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	13.200	779	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	20.500	839	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	10.800	263	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	17.06.2030	244.000	(7.268)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050	126.900	57.402	0,07
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	331.900	(23.336)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	113.000	(7.867)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	1.064.900	61.196	0,08
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	243.100	(14.610)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	116.300	(6.944)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	21.09.2027	355.500	(12.983)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	17.09.2024	149.000	18.304	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	21.09.2032	170.580	(14.648)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	1.851.400	50.945	0,06
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	127.800	(570)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,650	08.01.2034	46.900	1.191	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,670	03.04.2034	23.700	477	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	450.400	(6.853)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	05.03.2034	35.500	(267)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	3.872.600	(69.280)	(0,09)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	40.900	580	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	04.03.2034	34.900	(233)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	16.04.2029	58.000	(365)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	29.04.2034	35.100	(141)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029	58.700	(306)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,818	26.06.2029	58.700	229	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029	59.600	(164)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,860	24.04.2029	46.900	(76)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	58.400	(726)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	46.700	(847)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	29.300	(593)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	70.700	(992)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	35.200	(581)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029	46.100	229	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033	47.100	(1.181)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033	41.100	(1.101)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	29.400	(980)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033	23.500	(922)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	37.500	(1.519)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	29.400	(770)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033	38.300	(1.875)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	29.400	(876)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	08.11.2028	62.400	(1.859)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	21.08.2033	35.300	2.032	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	17.800	(940)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	105.000	6.460	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	36.600	(2.020)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028	62.900	2.429	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028	61.700	2.634	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	06.09.2032	MXN 266.600	(1.908)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,360	21.08.2037	285.500	(2.007)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,380	14.08.2037	111.200	539	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037	337.300	(2.803)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,495	14.01.2032	2.373.500	(13.940)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,498	15.01.2032	5.192.600	(30.436)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,498	19.06.2037	810.000	(6.693)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,103 %	04.01.2038	MXN 3.750.800	\$ 18.551	0,02
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,280	28.11.2036	690.000	(6.785)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,300	16.06.2028	665.100	(1.340)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,310	28.11.2036	1.066.400	(10.639)	(0,01)
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,410	31.03.2027	1.182.800	2.484	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,444	25.07.2028	1.502.400	(3.566)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,471	26.07.2028	757.500	(1.756)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,512	24.07.2028	1.136.300	(2.556)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,550	27.07.2028	383.300	(830)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,556	27.07.2028	2.280.700	(4.912)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,600	31.07.2028	610.800	(1.255)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,620	28.07.2028	361.800	(734)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,636	28.07.2028	722.200	(1.443)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,640	28.07.2028	144.800	(288)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,650	28.07.2028	365.300	(720)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,660	28.07.2028	361.100	(705)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>		28-Day MXN-TIIE	8,673	31.05.2029	201.100	406	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,680	31.05.2029	283.100	567	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,681	31.05.2029	363.100	726	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>		28-Day MXN-TIIE	8,683	31.05.2029	131.500	263	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,701	31.03.2032	905.900	2.074	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,720	07.03.2029	116.900	222	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,725	07.03.2029	292.200	551	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,730	06.04.2027	787.600	1.385	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,730	07.03.2029	176.900	332	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,732	30.03.2032	394.000	866	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,760	01.03.2029	473.600	818	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,770	01.03.2029	237.500	405	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,780	01.03.2029	234.900	396	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,810	29.05.2031	247.300	460	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	9,073	03.06.2027	809.900	1.027	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	9,260	03.06.2027	478.400	478	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	9,340	03.06.2027	898.200	794	0,00
Zahlung		UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 53.800	(8.612)	(0,01)
Zahlung		UKRPI	4,020	15.10.2031	69.900	(10.657)	(0,01)
Zahlung		UKRPI	4,055	15.09.2031	49.800	(7.843)	(0,01)
Zahlung		UKRPI	4,066	15.09.2031	96.800	(13.509)	(0,02)
Zahlung		UKRPI	4,140	15.10.2031	135.400	(18.495)	(0,02)
Zahlung		UKRPI	4,250	15.11.2031	135.600	(14.811)	(0,02)
Zahlung		UKRPI	4,400	15.10.2031	60.700	(6.791)	(0,01)
						\$ 1.574.309	2,00
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 1.713.311</b>	<b>2,17</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF									
ZINSSWAPOPTIONEN									
Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,243 %	05.08.2024	291.100	\$ 3.930	\$ 0	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,243	05.08.2024	291.100	3.930	12.359	0,02
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110	26.07.2032	59.200	9.590	5.547	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	85.900	13.916	22.485	0,03
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	869.400	6.520	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	869.400	6.520	19.665	0,02
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,590	19.07.2024	616.200	8.473	0	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,590	19.07.2024	616.200	8.473	22.556	0,03
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,170	19.07.2032	68.100	10.801	6.470	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,170	19.07.2032	76.800	12.180	19.607	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	68.100	8.986	3.273	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	76.800	10.134	17.900	0,02
							\$ 103.453	\$ 129.862	0,16

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

## VERKAUFSoPTIONEN

### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
DUB	Call - OTC USD versus MXN	MXN 18,150	06.02.2025	75.276	\$ (3.447)	\$ (4.719)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	18,100	11.02.2025	30.067	(1.370)	(1.948)	0,02
	Call - OTC USD versus MXN	18,150	13.02.2025	75.167	(3.354)	(4.797)	(0,01)
MYI	Call - OTC USD versus MXN	18,230	29.01.2025	75.704	(3.629)	(4.466)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	18,250	30.01.2025	75.703	(3.637)	(4.451)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	18,150	10.02.2025	75.676	(3.406)	(4.778)	(0,01)
					\$ (18.843)	\$ (25.159)	(0,03)

### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens	
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	55.000	\$ (247)	\$ (71)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	55.000	(248)	(3)	0,00	
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700	04.07.2024	58.100	(87)	(12)	0,00	
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	58.100	(87)	(16)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,700	05.07.2024	35.400	(139)	(22)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	35.400	(139)	(20)	0,00	
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	39.100	(148)	(112)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	39.100	(148)	(195)	0,00	
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689	15.07.2024	111.800	(229)	(50)	0,00	
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	111.800	(229)	(263)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	79.900	(336)	(75)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	111.800	(425)	(128)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	112.400	(407)	(201)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	55.500	(216)	(104)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	89.600	(300)	(141)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	112.500	(343)	(318)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	111.800	(425)	(722)	(0,01)	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	112.400	(407)	(733)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	79.900	(336)	(516)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	55.500	(216)	(286)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	89.600	(300)	(23)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	112.500	(343)	(29)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	29.300	(104)	(20)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	18.07.2024	35.600	(119)	(33)	0,00	
	JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	29.300	(104)	(118)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	18.07.2024	35.600	(119)	(151)	0,00	
Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,850	05.07.2024	114.900	(282)	(38)	0,00	
Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	05.07.2024	114.900	(282)	(39)	0,00	
Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,610	15.07.2024	35.400	(63)	(17)	0,00	
Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	15.07.2024	35.400	(63)	(62)	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,640	23.07.2024	28.200	(113)	(45)	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	55.800	(218)	(102)	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	27.000	(105)	(26)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,990	23.07.2024	28.200	(113)	(187)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	55.800	(218)	(295)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	27.000	(105)	(13)	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,800	03.07.2024	30.600	(124)	(38)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,150	03.07.2024	30.600	(124)	(1)	0,00	
MYC		Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	58.200	(93)	(137)	0,00
		Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	58.200	(93)	(16)	0,00
		Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	56.500	(146)	(111)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	56.500	(209)	(153)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	54.700	(231)	(171)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	56.500	(209)	(322)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	56.500	(146)	(248)	0,00	
RYL	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	54.700	(231)	(62)	0,00	
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	17.07.2024	59.500	(103)	(42)	0,00	
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	22.07.2024	59.500	(96)	(53)	0,00	
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	59.000	(94)	(84)	0,00	
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	22.07.2024	59.500	(96)	(128)	0,00	
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,970	17.07.2024	59.500	(103)	(91)	0,00	
ULO	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	59.000	(94)	(44)	0,00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	35.600	(110)	(56)	0,00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	35.600	(110)	(166)	0,00	
						\$ (10.175)	\$ (7.109)	(0,01)		

### ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,022 %	08.08.2026	291.100	\$ (5.021)	\$ (12.640)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,022	08.08.2026	291.100	(5.021)	(375)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	869.400	(7.615)	(19.629)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	1.738.800	(6.941)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	869.400	(7.615)	(164)	0,00
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	616.200	(10.898)	(23.557)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	616.200	(10.897)	(1.032)	0,00
						\$ (54.008)	\$ (57.397)	(0,07)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	\$ 94,969	08.07.2024	25.700	\$ (100)	\$ (6)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,266	08.07.2024	35.700	(73)	(46)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,719	08.07.2024	25.800	(48)	(13)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,969	08.07.2024	25.700	(80)	(7)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	95,594	06.08.2024	48.200	(109)	(168)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	98,594	06.08.2024	48.200	(90)	(62)	0,00
MSC	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,250	08.07.2024	38.700	(73)	(51)	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,969	08.07.2024	30.700	(101)	(8)	0,00
					\$ (674)	\$ (361)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

<sup>(2)</sup> Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 5.500	\$ (241)	\$ 224	\$ (17)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	23.000	(2.501)	2.550	49	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	14.700	(705)	634	(71)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.900	(259)	223	(36)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.000	(287)	296	9	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.300	(222)	223	1	0,00
BRC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	84.600	(11.485)	11.666	181	0,00
BYL	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.260	(1.322)	1.355	33	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	168.400	(2.908)	3.420	512	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	29.600	116	(14)	102	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	42.900	(1.989)	1.950	(39)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.600	(381)	330	(51)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	31.000	(203)	504	301	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.700	(490)	500	10	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	176.800	(2.751)	3.289	538	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	17.600	(687)	603	(84)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	8.200	(731)	630	(101)	0,00
	Equinix, Inc.	5,000	20.06.2027	9.000	1.258	(232)	1.026	0,01
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2029	18.200	252	(74)	178	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	60.300	(502)	744	242	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.400	(101)	117	16	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	9.800	(103)	102	(1)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	10.200	(565)	601	36	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.800	(215)	200	(15)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	58.600	(6.583)	6.708	125	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.200	(101)	99	(2)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.500	(135)	118	(17)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	33.200	(259)	581	322	0,00
MBC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	6.200	(676)	689	13	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	21.700	(781)	677	(104)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	24.900	(2.220)	1.912	(308)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	47.400	(418)	608	190	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	5.300	(73)	117	44	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	56.100	(326)	870	544	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	44.400	68	348	416	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	40.600	(137)	504	367	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	17.300	(335)	409	74	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	74.600	(787)	777	(10)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	124.200	(5.441)	5.047	(394)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.600	(518)	528	10	0,00
					\$ (45.744)	\$ 49.833	\$ 4.089	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	ABX.HE.AA.6-1 Index	0,320 %	25.07.2045	\$ 637	\$ (220)	\$ 174	\$ (46)	0,00
	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	29.101	(7.460)	5.735	(1.725)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	80	0	0	0	0,00
BRC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	2.289	(585)	449	(136)	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	100.000	(1.840)	779	(1.061)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	552	(19)	19	0	0,00
	PRIMEX.ARM.2-AAA Index	4,580	25.12.2037	188	8	(5)	3	0,00
CBK	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	57.924	9.644	(8.189)	1.455	0,00
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	233.645	(4.705)	4.094	(611)	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	162.200	(1.133)	(85)	(1.218)	0,00
GST	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	751	(181)	136	(45)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.169.250	(14.905)	11.849	(3.056)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	912.039	2.357	(6.811)	(4.454)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	86.300	(1.494)	579	(915)	0,00
	CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18.11.2064	473.700	(13.688)	5.368	(8.320)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPS	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 171.400	\$ (2.957)	\$ 2.509	\$ (448)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	171.700	(1.351)	512	(839)	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	45.500	(336)	(6)	(342)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	66.700	(1.419)	1.245	(174)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	364.800	(3.092)	1.310	(1.782)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	923.900	(14.119)	7.179	(6.940)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	379.100	507	(4.528)	(4.021)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500	16.12.2072	171.300	(4.147)	1.821	(2.326)	0,00
	CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18.11.2064	74.400	(631)	(676)	(1.307)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	48	(1)	1	0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	810.495	(7.907)	5.788	(2.119)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	664.561	(913)	(2.332)	(3.245)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.386.500	(13.794)	3.379	(10.415)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	88.800	0	(942)	(942)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	15.500	(445)	404	(41)	0,00
					\$ (84.826)	\$ 29.756	\$ (55.070)	(0,07)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
BPS	Erhalt iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,144 %	\$ 35.800	20.09.2024	\$ 359	\$ (413)	\$ (54)	0,00	
JPM	Erhalt iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,144	100.700	20.09.2024	1.101	(1.075)	26	0,00	
MYC	Erhalt iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,144	124.500	20.09.2024	1.292	(1.388)	(96)	0,00	
	Erhalt iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	5,321	31.100	20.09.2024	32	(39)	(7)	0,00	
	Erhalt iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	5,330	15.600	20.09.2024	4	(16)	(12)	0,00	
	Erhalt iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,144	15.500	20.12.2024	115	(156)	(41)	0,00	
							\$ 2.903	\$ (3.087)	\$ (184)	0,00

### TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	Erhalt U.S. Treasury Inflation Protected Securities	k. A.	5,410 %	\$ 725.000	09.07.2024	\$ 0	\$ (3.118)	\$ (3.118)	0,00

### DEVISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2024	AUD	1.110.339	\$ 739.781	\$ (1.759)	\$ (1.759)	0,00	
	07.2024	NZD	150.885	92.402	460	460	0,00	
	07.2024	\$	80.404	AUD 120.709	211	211	0,00	
	08.2024	AUD	120.709	\$ 80.472	0	(210)	0,00	
	08.2024	\$	92.402	NZD 150.885	0	(460)	0,00	
BOA	10.2024	CNH	3.594.714	\$ 502.218	5.667	5.667	0,01	
	07.2024	CHF	608.333	676.294	0	(685)	0,00	
	07.2024	€	19.566	21.057	88	88	0,00	
	07.2024	KRW	556.920.941	407.094	2.602	2.602	0,00	
	07.2024	NZD	1.787	1.091	2	2	0,00	
	07.2024	SEK	4.645	446	7	7	0,00	
	07.2024	SGD	13.654	10.075	12	(12)	0,00	
	07.2024	\$	16.669	€ 15.288	0	(284)	0,00	
	07.2024		6.024	£ 4.748	0	(22)	0,00	
	07.2024		2.386	HKD 18.622	0	0	0,00	
	07.2024		87.645	PLN 349.253	0	(784)	0,00	
	07.2024		82.136	SGD 110.855	0	(339)	0,00	
	07.2024		2.646	TRY 88.945	67	67	0,00	
	08.2024	SGD	353	\$ 260	0	0	0,00	
	08.2024	TRY	881	25	0	0	0,00	
	08.2024	\$	9.695	TRY 339.504	111	111	0,00	
	02.2025		30.281	MXN 552.659	0	(1.060)	0,00	
BPS	07.2024	BRL	453.637	\$ 90.129	8.459	8.459	0,01	
	07.2024	CAD	1.773.120	1.295.628	57	(238)	(181)	0,00
	07.2024	€	2.346.316	2.538.518	23.854	23.854	0,03	
	07.2024	£	880.987	1.119.741	6.086	6.086	0,01	
	07.2024	KRW	557.232.999	405.981	1.265	(2)	1.263	0,00
	07.2024	\$	663.487	AUD 995.788	1.550	1.550	0,00	
	07.2024		2.550	BRL 13.651	0	(92)	(92)	0,00
	07.2024		1.147.477	€ 1.072.510	2.251	(265)	1.986	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 74.763	IDR 1.225.016.078	\$ 113	\$ (3)	\$ 110	0,00
	07.2024	20.810	ILS 77.145	0	(319)	(319)	0,00
	07.2024	1.833	¥ 286.300	0	(53)	(53)	0,00
	07.2024	191.469	NZD 311.676	0	(1.550)	(1.550)	0,00
	07.2024	206.459	PLN 819.832	0	(2.564)	(2.564)	0,00
	07.2024	1.324	TRY 47.396	99	0	99	0,00
	08.2024	AUD 987.188	\$ 658.329	0	(1.515)	(1.515)	0,00
	08.2024	€ 1.046.739	1.121.227	0	(2.251)	(2.251)	0,00
	09.2024	CNH 3.040.169	424.720	5.877	0	5.877	0,01
	09.2024	INR 1.379.282	16.457	0	(47)	(47)	0,00
	09.2024	TWD 17.217.084	535.140	3.337	0	3.337	0,00
	09.2024	\$ 152.262	INR 12.742.354	211	0	211	0,00
	10.2024	CNH 2.825.854	\$ 394.112	3.766	0	3.766	0,00
	10.2024	\$ 76.831	CNH 550.256	0	(822)	(822)	0,00
	05.2029	KWD 21.985	\$ 75.580	2.175	0	2.175	0,00
BRC	07.2024	AUD 26.602	17.605	0	(162)	(162)	0,00
	07.2024	€ 200.659	214.713	0	(344)	(344)	0,00
	07.2024	HKD 14.350	1.838	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 1.486.863	80.439	0	(715)	(715)	0,00
	07.2024	NOK 65.354	6.206	68	0	68	0,00
	07.2024	PLN 1.668	424	9	0	9	0,00
	07.2024	SGD 200.965	148.817	530	0	530	0,00
	07.2024	THB 122.952	3.358	3	0	3	0,00
	07.2024	TRY 756	21	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	\$ 33.059	CAD 45.188	6	(42)	(36)	0,00
	07.2024	716.785	€ 669.493	745	0	745	0,00
	07.2024	3.038	£ 2.391	0	(15)	(15)	0,00
	07.2024	128.912	PLN 514.950	0	(842)	(842)	0,00
	07.2024	9.495	SGD 12.847	0	(15)	(15)	0,00
	07.2024	186.154	TRY 6.398.440	6.019	0	6.019	0,01
	08.2024	€ 669.493	\$ 717.834	0	(741)	(741)	0,00
	08.2024	TRY 877	25	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 84.956	TRY 2.912.162	741	0	741	0,00
	09.2024	CNH 1.323	\$ 184	2	0	2	0,00
	09.2024	MXN 1.595.355	83.790	0	(2.415)	(2.415)	0,00
	09.2024	\$ 8.648	INR 723.847	13	0	13	0,00
	09.2024	1.524	MXN 28.364	9	0	9	0,00
	09.2024	142.302	TRY 5.221.921	5.796	0	5.796	0,01
	10.2024	CNH 20	\$ 3	0	0	0	0,00
	11.2024	\$ 5.650	TRY 222.954	284	0	284	0,00
BSH	02.2025	30.110	MXN 546.066	0	(1.264)	(1.264)	0,00
CBK	07.2024	104	PLN 406	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	BRL 3.090.643	\$ 568.196	11.770	0	11.770	0,01
	07.2024	CAD 4.269.629	3.118.963	1.055	(2.446)	(1.391)	0,00
	07.2024	CHF 130.197	143.064	0	(1.825)	(1.825)	0,00
	07.2024	COP 13.322.000	3.196	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	€ 1.576	1.691	2	0	2	0,00
	07.2024	£ 2.762	3.499	7	0	7	0,00
	07.2024	IDR 1.504.523	93	1	0	1	0,00
	07.2024	KRW 40.457.725	29.658	274	0	274	0,00
	07.2024	NZD 657	401	0	0	0	0,00
	07.2024	PEN 156.590	41.890	1.013	0	1.013	0,00
	07.2024	PLN 761	191	2	0	2	0,00
	07.2024	SEK 15.596	1.469	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	\$ 5.718	AUD 8.648	57	0	57	0,00
	07.2024	550	BRL 2.970	0	(15)	(15)	0,00
	07.2024	87.901	£ 68.905	0	(798)	(798)	0,00
	07.2024	151	ILS 561	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	3.292	NOK 34.704	0	(33)	(33)	0,00
	07.2024	4.635	PEN 17.669	0	(23)	(23)	0,00
	07.2024	224.909	PLN 892.071	0	(3.048)	(3.048)	(0,01)
	07.2024	3.605	SGD 4.863	0	(17)	(17)	0,00
	07.2024	13.094	TRY 441.420	59	0	59	0,00
	07.2024	34.937	ZAR 635.339	1	(188)	(187)	0,00
	08.2024	£ 7.019	\$ 8.873	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	INR 1.718	21	0	0	0	0,00
	09.2024	PEN 130.249	34.960	961	0	961	0,00
	09.2024	TWD 5.094.233	158.059	708	0	708	0,00
	09.2024	\$ 946.907	INR 79.193.260	981	(271)	710	0,00
	10.2024	568.196	BRL 3.120.815	0	(11.985)	(11.985)	(0,02)
DUB	01.2025	28.768	MXN 523.983	0	(1.046)	(1.046)	0,00
	07.2024	AUD 51.410	\$ 34.025	0	(309)	(309)	0,00
	07.2024	BRL 15.565	2.950	148	0	148	0,00
	07.2024	CAD 5.000	3.642	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	CLP 2.017.734	2.182	44	0	44	0,00
	07.2024	€ 609.496	661.947	8.719	0	8.719	0,01
	07.2024	£ 1.351.405	1.724.367	16.057	0	16.057	0,02
	07.2024	IDR 17.126.550	1.050	3	0	3	0,00
	07.2024	KRW 476.032.070	346.012	269	0	269	0,00
	07.2024	PLN 80	20	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.193.175	BRL 6.054.395	0	(103.168)	(103.168)	(0,13)
	07.2024	218.389	PLN 858.288	0	(4.935)	(4.935)	(0,01)
	08.2024	25.301	BRL 130.225	0	(1.941)	(1.941)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	09.2024	INR	5.933.819	\$ 70.792	\$ 0	\$ (211)	\$ (211)	0,00
	09.2024	TWD	4.784.545	148.289	503	0	503	0,00
	02.2025	MXN	1.309.179	72.204	3.089	0	3.089	0,00
	02.2025	\$	42.094	MXN 764.604	0	(1.746)	(1.746)	0,00
	03.2025		5.089	TRY 242.226	615	0	615	0,00
FAR	07.2024	CAD	1.226.267	\$ 895.088	0	(1.140)	(1.140)	0,00
	07.2024	¥	290.109.617	1.820.762	17.272	0	17.272	0,02
	07.2024	NZD	289.947	176.839	159	0	159	0,00
	07.2024	\$	1.898.220	¥ 296.428.431	0	(55.448)	(55.448)	(0,07)
	07.2024		6.134	NZD 9.956	0	(67)	(67)	0,00
	08.2024		1.820.762	¥ 288.748.561	0	(17.247)	(17.247)	(0,02)
	08.2024		176.838	NZD 289.947	0	(160)	(160)	0,00
GLM	07.2024	BRL	2.173.200	\$ 400.000	8.746	0	8.746	0,01
	07.2024	CAD	10.711	\$ 7.799	0	(29)	(29)	0,00
	07.2024	€	698.363	758.541	10.070	0	10.070	0,01
	07.2024	KRW	411.871	299	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN	4.426.393	239.002	0	(2.594)	(2.594)	0,00
	07.2024	SGD	681	505	2	0	2	0,00
	07.2024	\$	1.373	AUD 2.064	5	0	5	0,00
	07.2024		5.350	KRW 7.349.805	0	(15)	(15)	0,00
	07.2024		1.319	MXN 23.845	0	(18)	(18)	0,00
	07.2024		138.562	PLN 547.402	0	(2.422)	(2.422)	0,00
	07.2024		17.542	TRY 597.287	162	0	162	0,00
	07.2024		145.270	ZAR 2.657.807	100	0	100	0,00
	08.2024		900.000	BRL 4.842.280	0	(31.376)	(31.376)	(0,04)
	08.2024		59.111	TRY 2.039.995	360	0	360	0,00
	09.2024		23.316	827.204	125	0	125	0,00
GSC	09.2024		34.820	1.390.882	4.640	0	4.640	0,01
	03.2025		7.925	378.878	998	0	998	0,00
IND	10.2024	CNH	180	\$ 25	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	AUD	5.093	3.394	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	BRL	719.851	134.088	4.489	0	4.489	0,01
	07.2024	CHF	78.123	86.372	0	(566)	(566)	0,00
	07.2024	CNY	173	24	0	0	0	0,00
	07.2024	€	1.665.950	1.809.210	23.729	0	23.729	0,03
	07.2024	IDR	378.470.600	23.336	205	0	205	0,00
	07.2024	KRW	373.252.372	270.591	0	(503)	(503)	0,00
	07.2024	\$	1.327	CNY 9.468	0	(14)	(14)	0,00
	07.2024		8.652	€ 8.086	14	0	14	0,00
	07.2024		12.156	£ 9.597	0	(25)	(25)	0,00
	07.2024		53.844	ILS 199.133	0	(951)	(951)	0,00
	07.2024		514	KRW 708.167	0	0	0	0,00
	07.2024		86.875	PLN 339.807	0	(2.364)	(2.364)	0,00
	07.2024		79.831	TRY 2.701.348	1.517	0	1.517	0,00
	07.2024		273.898	ZAR 5.042.010	1.880	(2)	1.878	0,00
	08.2024	AUD	9.267	\$ 6.184	0	(10)	(10)	0,00
	08.2024	CNY	9.474	1.327	0	0	0	0,00
	08.2024	TRY	655	19	0	0	0	0,00
	08.2024	\$	3.397	AUD 5.093	7	0	7	0,00
	08.2024		6.214	NZD 10.196	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024		116.267	TRY 4.018.800	1.140	0	1.140	0,00
	09.2024	TWD	9.330.055	\$ 289.761	1.574	0	1.574	0,00
	09.2024	\$	334.325	INR 27.984.985	540	0	540	0,00
	09.2024		3.662	TRY 135.425	206	0	206	0,00
	10.2024	CNH	672.044	\$ 93.854	1.022	0	1.022	0,00
	10.2024	\$	108.753	BRL 598.206	0	(2.137)	(2.137)	0,00
	10.2024		76.824	CNH 548.670	0	(1.034)	(1.034)	0,00
	11.2024		12.345	TRY 487.170	622	0	622	0,00
MBC	03.2025		10.236	495.963	1.456	0	1.456	0,00
	07.2024	CAD	2.242.893	\$ 1.637.852	0	(1.501)	(1.501)	0,00
	07.2024	€	57.912	62.984	916	0	916	0,00
	07.2024	£	37.380	47.581	329	0	329	0,00
	07.2024	HKD	228	29	0	0	0	0,00
	07.2024	¥	8.133.800	51.619	1.055	0	1.055	0,00
	07.2024	SGD	18.047	13.363	47	0	47	0,00
	07.2024	\$	1.062.442	CAD 1.454.773	716	0	716	0,00
	07.2024		24.112	€ 22.468	0	(32)	(32)	0,00
	07.2024		2.713.329	£ 2.144.467	0	(2.509)	(2.509)	0,00
	07.2024		388	HUF 144.702	4	0	4	0,00
	07.2024		15	IDR 240.242	0	0	0	0,00
	07.2024		2.741	¥ 436.700	0	(26)	(26)	0,00
	07.2024		682	NOK 7.270	0	0	0	0,00
	07.2024		6.225	NZD 10.196	0	(12)	(12)	0,00
	08.2024	CAD	1.420.995	\$ 1.038.598	0	(613)	(613)	0,00
	08.2024	£	2.043.895	2.586.371	2.213	0	2.213	0,00
	08.2024	NOK	7.264	682	0	0	0	0,00
	08.2024	\$	29	HKD 227	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD	4.549.602	\$ 141.327	798	0	798	0,00
	10.2024	CNH	596.733	82.867	438	0	438	0,00
	02.2025	\$	30.270	MXN 549.037	0	(1.277)	(1.277)	0,00
MYI	07.2024	AUD	1.136	\$ 756	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	CHF	6.710	7.482	15	0	15	0,00
	07.2024	€	131.729	141.190	60	(51)	9	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
	07.2024	£	800	\$	1.012	\$	1	(1)	\$	0	0,00		
	07.2024	¥	1.833.170		11.430		33	0		33	0,00		
	07.2024	NZD	2.845		1.743		9	0		9	0,00		
	07.2024	SGD	20.172		14.854		0	(31)		(31)	0,00		
	07.2024	\$	204	AUD	306		1	0		1	0,00		
	07.2024		72.939	BRL	376.761		0	(5.108)		(5.108)	(0,01)		
	07.2024		1.229	CAD	1.682		0	0		0	0,00		
	07.2024		8.656	€	8.071		2	(8)		(6)	0,00		
	07.2024		58.307	£	45.669		0	(577)		(577)	0,00		
	07.2024		29	HKD	228		0	0		0	0,00		
	07.2024		195	NOK	2.076		0	0		0	0,00		
	07.2024		203.025	NZD	331.033		0	(1.310)		(1.310)	0,00		
	07.2024		1.919	SEK	20.266		0	(5)		(5)	0,00		
	07.2024		31	SGD	43		0	0		0	0,00		
	07.2024		491	ZAR	9.033		3	0		3	0,00		
	08.2024	NOK	2.074	\$	195		0	0		0	0,00		
	08.2024	SEK	20.235		1.919		5	0		5	0,00		
	09.2024	TWD	3.447.793		107.468		972	0		972	0,00		
	09.2024	\$	61.112	INR	5.110.087		35	0		35	0,00		
	09.2024		2.329	MXN	42.499		0	(33)		(33)	0,00		
	01.2025	MXN	524.182	\$	28.768		1.035	0		1.035	0,00		
	02.2025		1.101.932		60.551		2.324	0		2.324	0,00		
RBC	07.2024	\$	25.506	CAD	35.012		81	0		81	0,00		
RYL	07.2024	€	41.383	\$	44.271		0	(81)		(81)	0,00		
	07.2024	\$	44.122	AUD	66.133		45	0		45	0,00		
	07.2024		2.007	NOK	21.305		0	(7)		(7)	0,00		
SCX	07.2024		8.176	NZD	13.224		0	(118)		(118)	0,00		
	07.2024	CHF	1.144	\$	1.273		0	0		0	0,00		
	07.2024	CNY	9.288		1.306		18	0		18	0,00		
	07.2024	€	129.851		139.503		335	0		335	0,00		
	07.2024	HKD	4.658		597		0	0		0	0,00		
	07.2024	IDR	27.243.920		1.660		0	(5)		(5)	0,00		
	07.2024	KRW	282.554.432		207.184		1.964	0		1.964	0,00		
	07.2024	PEN	173.442		46.264		986	0		986	0,00		
	07.2024	SGD	597.601		443.502		2.549	0		2.549	0,00		
	07.2024	\$	8.036	CAD	10.987		0	(7)		(7)	0,00		
	07.2024		85.408	€	78.532		0	(1.242)		(1.242)	0,00		
	07.2024		2.486	¥	396.400		0	(21)		(21)	0,00		
	07.2024		4.183	ZAR	77.086		33	0		33	0,00		
	09.2024	CNH	2.512.369	\$	350.196		4.068	0		4.068	0,01		
	09.2024	MXN	994.917		53.245		0	(515)		(515)	0,00		
	09.2024	TWD	9.384.043		291.563		1.708	0		1.708	0,00		
	09.2024	\$	276.978	INR	23.183.085		428	0		428	0,00		
	10.2024	CNH	59	\$	8		0	0		0	0,00		
SSB	10.2024	\$	43	CNH	305		0	(1)		(1)	0,00		
	07.2024	CAD	16.700	\$	12.205		12	(11)		1	0,00		
	07.2024	€	372.052		403.922		5.175	0		5.175	0,01		
	07.2024	MXN	887.831		47.590		0	(853)		(853)	0,00		
	07.2024	\$	8.831	¥	1.379.600		0	(254)		(254)	0,00		
	08.2024	€	621.895	\$	667.235		0	(252)		(252)	0,00		
TOR	07.2024	CHF	169.801		187.980		0	(982)		(982)	0,00		
	07.2024	NZD	219.769		134.608		692	0		692	0,00		
	07.2024	\$	213	PLN	842		0	(4)		(4)	0,00		
	07.2024		1.906	ZAR	34.395		0	(25)		(25)	0,00		
	08.2024		134.608	NZD	219.769		0	(692)		(692)	0,00		
UAG	07.2024	CAD	210.190	\$	153.969		357	0		357	0,00		
	07.2024	ILS	273.069		73.687		1.152	0		1.152	0,00		
	07.2024	SGD	224		166		0	0		0	0,00		
	07.2024	\$	984.055	CHF	882.917		0	(1.508)		(1.508)	0,00		
	08.2024	CHF	879.654	\$	984.055		1.484	0		1.484	0,00		
	08.2024	€	14.548		15.579		0	(36)		(36)	0,00		
							\$	242.028	\$	(293.767)	\$	(51.739)	(0,07)

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend, Institutional AUD (Hedged) ausschüttend, Investor AUD (Hedged) ausschüttend, Administrative AUD (Hedged) ausschüttend, Class E AUD (Hedged) ausschüttend und Class Z AUD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
AZD	07.2024	AUD	953.688	\$	635.251	\$	(1.669)	0,00		
	07.2024	\$	841.184	AUD	1.263.051		2.344	0,01		
	08.2024		635.789		953.688		1.662	0,00		
BOA	07.2024	AUD	4.331	\$	2.879		0	(14)	0,00	
BPS	07.2024		954.422		635.933		0	(1.478)	0,00	
	07.2024	\$	313	AUD	469		0	0	0,00	
	08.2024		635.988		953.688		1.464	0	1.464	0,00
BRC	07.2024	AUD	530	\$	351		0	(3)	0,00	
CBK	07.2024		2.093		1.381		0	(17)	0,00	

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 2.172	AUD 3.262	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
	08.2024	452	677	1	0	1	0,00
DUB	07.2024	168	254	2	0	2	0,00
FAR	07.2024	AUD 897.170	\$ 598.413	0	(763)	(763)	0,00
	07.2024	\$ 633.248	AUD 950.447	1.508	0	1.508	0,00
	08.2024	598.924	897.170	751	0	751	0,00
GLM	07.2024	AUD 7.282	\$ 4.845	0	(18)	(18)	0,00
JPM	07.2024	458	305	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 305	AUD 458	1	0	1	0,00
MBC	07.2024	AUD 5.626	\$ 3.738	0	(20)	(20)	0,00
	07.2024	\$ 16.105	AUD 24.214	67	0	67	0,00
MYI	07.2024	4.015	6.034	15	0	15	0,00
RBC	07.2024	AUD 912	\$ 608	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07.2024	951	634	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 5.888	AUD 8.930	76	0	76	0,00
TOR	07.2024	379.623	570.801	1.587	0	1.587	0,00
				\$ 9.484	\$ (3.985)	\$ 5.499	0,01

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	BRL 671.282	\$ 124.485	\$ 3.631	\$ 0	\$ 3.631	0,00
	07.2024	\$ 134.093	BRL 693.661	0	(9.210)	(9.210)	(0,01)
	08.2024	BRL 11.853	\$ 2.182	56	0	56	0,00
	08.2024	\$ 121.712	BRL 658.550	0	(3.579)	(3.579)	(0,01)
CBK	07.2024	BRL 655.665	\$ 121.195	3.152	0	3.152	0,00
	07.2024	\$ 152.041	BRL 787.186	0	(10.320)	(10.320)	(0,01)
	08.2024	121.195	657.907	0	(3.177)	(3.177)	0,00
JPM	07.2024	BRL 545.461	\$ 100.740	2.537	0	2.537	0,00
	07.2024	\$ 101.801	BRL 521.561	0	(7.901)	(7.901)	(0,01)
	08.2024	BRL 3.359	\$ 609	7	0	7	0,00
	08.2024	\$ 98.672	BRL 536.132	0	(2.498)	(2.498)	0,00
MYI	07.2024	211	1.089	0	(15)	(15)	0,00
SCX	07.2024	152	795	0	(9)	(9)	0,00
TOR	07.2024	BRL 131.884	\$ 23.919	175	0	175	0,00
	08.2024	\$ 23.836	BRL 131.884	0	(179)	(179)	0,00
				\$ 9.558	\$ (36.888)	\$ (27.330)	(0,04)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CAD (Hedged) thesaurierend und Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	CAD 11.660	\$ 8.518	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	07.2024	\$ 31.575	CAD 43.212	4	0	4	0,00
BRC	07.2024	CAD 14.778	\$ 10.824	24	0	24	0,00
CBK	07.2024	54.004	39.468	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 28.036	CAD 38.190	0	(126)	(126)	0,00
	08.2024	39.468	53.967	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	CAD 110.804	\$ 80.934	1	(43)	(42)	0,00
	07.2024	\$ 37.167	CAD 50.607	0	(183)	(183)	0,00
	08.2024	80.510	110.150	46	0	46	0,00
MYI	07.2024	CAD 533	\$ 389	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	\$ 43.257	CAD 59.257	48	0	48	0,00
				\$ 124	\$ (355)	\$ (231)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 261.667	CHF 235.372	\$ 265	\$ 0	\$ 265	0,00
BRC	07.2024	CHF 2.886	\$ 3.238	26	0	26	0,00
	07.2024	\$ 6.493	CHF 5.775	0	(66)	(66)	0,00
CBK	07.2024	32.327	29.420	412	0	412	0,00
GLM	07.2024	401	360	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2024	CHF 292.867	\$ 326.354	440	0	440	0,00
	07.2024	\$ 869	CHF 786	6	0	6	0,00
	08.2024	325.969	291.445	0	(425)	(425)	0,00
MBC	07.2024	CHF 1	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.013	CHF 904	0	(8)	(8)	0,00
	08.2024	8.333	7.450	0	(11)	(11)	0,00
MYI	07.2024	CHF 1.409	\$ 1.564	2	(6)	(4)	0,00
	07.2024	\$ 6.260	CHF 5.602	0	(26)	(26)	0,00
SCX	07.2024	CHF 4.802	\$ 5.379	35	0	35	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
TOR	07.2024	\$ 9.070	CHF 8.150	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2024	319.105	288.245	1.667	0	1.667	0,00
UAG	07.2024	CHF 292.283	\$ 325.764	499	0	499	0,00
	07.2024	\$ 315.592	CHF 285.190	1.779	0	1.779	0,01
	08.2024	325.764	291.202	0	(491)	(491)	0,00
				\$ 5.131	\$ (1.035)	\$ 4.096	0,01

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) ausschuttend A, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschuttend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) ausschuttend, E Class EUR (Hedged) ausschuttend II, E Class EUR (Hedged) ausschuttend II Q, G Retail EUR (Hedged) ausschuttend, R Class EUR (Hedged) ausschuttend, T Class EUR (Hedged) thesaurierend und T Class EUR (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2024	\$ 6.216.698	€ 5.725.997	\$ 0	\$ (79.857)	\$ (79.857)	(0,10)
BPS	07.2024	€ 5.342.619	\$ 5.714.629	110	(11.435)	(11.325)	(0,01)
	07.2024	\$ 5.252.484	€ 4.851.726	0	(52.645)	(52.645)	(0,07)
	08.2024	5.695.798	5.317.401	11.434	0	11.434	0,01
BRC	07.2024	1.279	1.195	2	0	2	0,00
CBK	07.2024	6.504	5.988	0	(86)	(86)	0,00
FAR	07.2024	5.981.670	5.492.033	0	(95.580)	(95.580)	(0,12)
GLM	07.2024	2.220	2.050	0	(22)	(22)	0,00
JPM	07.2024	€ 841	\$ 900	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2024	5.438.701	5.815.603	0	(13.327)	(13.327)	(0,02)
	07.2024	\$ 51.842	€ 47.963	0	(439)	(439)	0,00
	08.2024	5.824.104	5.438.701	13.321	0	13.321	0,02
MYI	07.2024	€ 11.140	\$ 11.945	6	0	6	0,00
RBC	07.2024	27.322	29.677	395	0	395	0,00
RYL	07.2024	\$ 4.034	€ 3.771	7	0	7	0,00
SCX	07.2024	€ 5.475.679	\$ 5.866.646	4	(1.920)	(1.916)	0,00
	08.2024	\$ 5.873.819	€ 5.474.330	1.847	0	1.847	0,00
SSB	07.2024	179.616	165.579	0	(2.156)	(2.156)	0,00
UAG	08.2024	10.253	9.574	23	0	23	0,00
				\$ 27.149	\$ (257.468)	\$ (230.319)	(0,29)

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschuttend, Investor GBP (Hedged) ausschuttend, Administrative GBP (Hedged) ausschuttend, Class E GBP (Hedged) ausschuttend und Class R GBP (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	07.2024	£ 455.120	\$ 575.503	\$ 186	\$ 0	\$ 186	0,00
	07.2024	\$ 1.116.649	£ 876.268	0	(8.959)	(8.959)	(0,01)
	08.2024	575.597	455.120	0	(175)	(175)	0,00
BRC	07.2024	252	197	0	(3)	(3)	0,00
CBK	07.2024	£ 5.739	\$ 7.301	46	0	46	0,00
	07.2024	\$ 31.025	£ 24.377	0	(210)	(210)	0,00
	08.2024	819	648	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	582.137	456.227	0	(5.421)	(5.421)	(0,01)
MBC	07.2024	£ 463.933	\$ 586.968	511	0	511	0,00
	07.2024	\$ 3.697	£ 2.903	0	(28)	(28)	0,00
	08.2024	585.459	462.662	0	(501)	(501)	0,00
RBC	07.2024	£ 462.728	\$ 586.785	1.851	0	1.851	0,00
	08.2024	\$ 586.885	£ 462.728	0	(1.844)	(1.844)	0,00
RYL	07.2024	35.254	27.548	0	(431)	(431)	0,00
				\$ 2.594	\$ (17.572)	\$ (14.978)	(0,02)

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilklassen Institutional JPY (Hedged) thesaurierend, Institutional JPY (Hedged) ausschuttend, Investor JPY (Hedged) thesaurierend, E Class JPY (Hedged) thesaurierend und E Class JPY (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	07.2024	\$ 3.874	¥ 602.257	\$ 0	\$ (130)	\$ (130)	0,00
BRC	07.2024	7.720	1.211.547	0	(189)	(189)	0,00
CBK	07.2024	19.850	3.172.765	0	(126)	(126)	0,00
GLM	07.2024	375.524	58.746.327	0	(10.323)	(10.323)	(0,01)
MBC	07.2024	¥ 63.366.749	\$ 394.700	775	0	775	0,00
	07.2024	\$ 390.798	¥ 61.156.217	0	(10.615)	(10.615)	(0,02)
	08.2024	393.114	62.819.077	0	(748)	(748)	0,00
MYI	07.2024	¥ 587.499	\$ 3.755	103	0	103	0,00
	07.2024	\$ 5.960	¥ 934.078	0	(153)	(153)	0,00
SCX	07.2024	6.688	1.050.183	0	(159)	(159)	0,00
	08.2024	9.435	1.507.365	0	(20)	(20)	0,00
SSB	07.2024	363.858	56.967.224	0	(9.716)	(9.716)	(0,01)
				\$ 878	\$ (32.179)	\$ (31.301)	(0,04)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2024	\$ 76.076	NOK 800.351	\$ 0	\$ (908)	\$ (908)	(0,01)
CBK	07.2024	75.787	798.885	0	(757)	(757)	0,00
MBC	07.2024	NOK 630.945	\$ 59.230	0	(28)	(28)	0,00
	07.2024	\$ 2.370	NOK 24.906	0	(30)	(30)	0,00
	08.2024	59.230	630.447	28	0	28	0,00
MYI	07.2024	NOK 809.780	\$ 75.954	0	(99)	(99)	0,00
	07.2024	\$ 69.191	NOK 729.293	0	(696)	(696)	0,00
	08.2024	75.954	809.134	99	0	99	0,00
RYL	07.2024	NOK 16.685	\$ 1.583	16	0	16	0,00
	07.2024	\$ 1.414	NOK 14.975	0	(8)	(8)	0,00
SCX	07.2024	427	4.550	0	0	0	0,00
				\$ 143	\$ (2.526)	\$ (2.383)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional RMB (Hedged) ausschüttend, Investor RMB (Hedged) thesaurierend und Class E RMB (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	CNH 5.050	\$ 697	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
BOA	07.2024	\$ 67.748	CNH 491.387	0	(443)	(443)	0,00
BPS	07.2024	243	1.765	0	(2)	(2)	0,00
BRC	07.2024	166	1.212	0	0	0	0,00
	08.2024	65.393	476.131	0	(14)	(14)	0,00
DUB	07.2024	233	1.690	0	(2)	(2)	0,00
GLM	07.2024	62.541	452.761	0	(526)	(526)	0,00
IND	07.2024	CNH 1.385	\$ 190	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 57	CNH 415	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	CNH 12.414	\$ 1.717	16	0	16	0,00
MBC	07.2024	62.510	8.614	52	0	52	0,00
	07.2024	\$ 3.883	CNH 28.176	0	(24)	(24)	0,00
MYI	07.2024	1.734	12.628	0	(5)	(5)	0,00
RBC	07.2024	138	1.001	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2024	66.912	483.980	0	(621)	(621)	0,00
TOR	07.2024	CNH 477.528	\$ 65.422	15	0	15	0,00
	08.2024	\$ 65.422	CNH 476.472	4	0	4	0,00
				\$ 94	\$ (1.638)	\$ (1.544)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) thesaurierend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 3.295.068	\$ 2.427.664	\$ 0	\$ (3.672)	\$ (3.672)	0,00
	07.2024	\$ 2.206.324	SGD 2.978.391	41	(8.696)	(8.655)	(0,01)
	08.2024	2.450.367	3.320.980	3.718	0	3.718	0,00
BPS	07.2024	SGD 3.288.346	\$ 2.424.593	0	(1.784)	(1.784)	0,00
	08.2024	\$ 2.424.593	SGD 3.283.594	1.865	0	1.865	0,00
BRC	07.2024	SGD 25	\$ 19	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 10.672	SGD 14.418	0	(33)	(33)	0,00
CBK	07.2024	79.244	106.891	0	(372)	(372)	0,00
GLM	07.2024	72.140	97.370	0	(294)	(294)	0,00
JPM	07.2024	SGD 37.679	\$ 27.960	158	0	158	0,00
	07.2024	\$ 2.351.067	SGD 3.164.477	0	(16.090)	(16.090)	(0,02)
MBC	07.2024	61.056	82.498	0	(183)	(183)	0,00
SCX	07.2024	2.375.174	3.200.473	0	(13.637)	(13.637)	(0,02)
UAG	07.2024	14.104	19.078	0	(27)	(27)	0,00
				\$ 5.782	\$ (44.788)	\$ (39.006)	(0,05)

Summe Freiverkehrsfinaanzderivate

\$ (403.683) (0,51)

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Ginnie Mae, TBA			
2,500 % fällig am 01.08.2054	\$ 33.900	(28.527)	(0,04)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,500 % fällig am 01.07.2054 (k)	1.025.392	(907.631)	(1,15)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (936.158)	(1,19)
Summe Anlagen		\$ 118.281.033	150,04
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (39.447.879)	(50,04)
Nettovermögen		\$ 78.833.154	100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):**

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- μ Der gesamte Betrag oder ein Teil davon stellt ungedeckte Kreditengagements dar. Der Zinssatz für den ungedeckten Anteil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Reines Kapitalwertpapier.
- (c) Wertpapier per Emissionstermin.
- (d) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (e) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (f) Nullkuponwertpapier.
- (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (i) Mit dem Fonds verbunden.
- (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (k) Zum 30. Juni 2024 leerverkauft Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (l) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 1,06 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum		Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
AMSURG Corp.	02.11.2023 - 06.11.2023		\$ 146.801	\$ 173.920	0,22
Chester A PLC 0,000 % fällig am 17.03.2046		18.04.2019	13.025	16.829	0,02
Chester A PLC 1,000 % fällig am 20.05.2046		18.04.2019	17.298	5.041	0,01
Chester A PLC 6,634 % fällig am 17.03.2046		18.04.2019	44.552	43.403	0,06
Chester A PLC 7,484 % fällig am 17.03.2046		18.04.2019	19.159	18.624	0,03
Chester A PLC 8,384 % fällig am 17.03.2046		18.04.2019	17.790	17.292	0,02
Chester A PLC 9,234 % fällig am 17.03.2046		18.04.2019	10.947	10.624	0,01
Chester A PLC 9,734 % fällig am 17.03.2046		18.04.2019	5.473	5.308	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'		10.06.2022	353	353	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071		10.06.2022	0	0	0,00
Corestate Capital Holding S.A.		22.08.2023	0	0	0,00
DreamWell Ltd.		24.04.2024	701	3	0,00
Intelsat Emergence S.A.	19.06.2017 - 23.02.2022		440.150	173.298	0,22
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032		11.02.2020	60.606	43.457	0,06
Neiman Marcus Group Ltd. LLC		25.09.2020	37.976	159.397	0,20
Serta Simmons Bedding LLC		29.06.2023	701	0	0,00
Sierra Hamilton Holder LLC		31.07.2017	560	0	0,00
Westmoreland Mining LLC	08.12.2014 - 19.12.2019		1.491	102	0,00
Westmoreland Mining LLC		03.07.2023	338	230	0,00
			\$ 817.921	\$ 667.881	0,86

(m) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 4.000 USD (31. Dezember 2023: 502 USD) und Barmittel in Höhe von 59.299 USD (31. Dezember 2023: 1.172 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.497.139 USD (31. Dezember 2023: 1.514.049 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 486.564 USD (31. Dezember 2023: 76.085 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 214.172	\$ 107.785.200	\$ 871.621	\$ 108.870.993
Investmentfonds	2.970.999	0	0	2.970.999
Pensionsgeschäfte	0	6.002.467	0	6.002.467
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(3.740)	1.378.421	(1.949)	1.372.732
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(936.158)	0	(936.158)
<b>Summen</b>	<b>\$ 3.181.431</b>	<b>\$ 114.229.930</b>	<b>\$ 869.672</b>	<b>\$ 118.281.033</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 257.726	\$ 95.849.535	\$ 842.568	\$ 96.949.829
Investmentfonds	1.515.725	289.487	0	1.805.212
Pensionsgeschäfte	0	274.468	0	274.468
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(17.482)	1.286.825	(1.363)	1.267.980
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(937.631)	0	(937.631)
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.755.969</b>	<b>\$ 96.762.684</b>	<b>\$ 841.205</b>	<b>\$ 99.359.858</b>

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
JML	2,650 %	09.05.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (2.389)	\$ (2.572)	0,00
	4,750	03.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (1.260)	(1.264)	0,00
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (3.836)</b>	<b>0,00</b>

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 6.122	\$ (5.240)	\$ 882	\$ 2.888	\$ (3.940)	\$ (1.052)
BOA	(90.768)	100.070	9.302	17.923	(17.500)	423
BPS	(21.292)	16.838	(4.454)	17.770	(62.687)	(44.917)
BRC	5.421	(2.170)	3.251	(41.205)	12.970	(28.235)
BSH	(3)	0	(3)	66	0	66
BYL	33	0	33	66	0	66
CBK	(14.407)	14.179	(228)	27.413	(31.601)	(4.188)
DUB	(100.371)	88.930	(11.441)	12.926	(16.750)	(3.824)
FAR	(151.371)	159.040	7.669	(1.931)	1.840	(91)
FBF	(1.218)	1.093	(125)	(1.499)	1.643	144
GLM	(3.947)	18.500	14.553	426	13.900	14.326
GSC	5.638	0	5.638	k. A.	k. A.	k. A.
GST	(14.830)	10.286	(4.544)	(5.488)	(92.884)	(98.372)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	357	(500)	(143)
IND	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	6.200	(1.930)	4.270	(9.341)	10.510	1.169
JPS	(1.287)	1.090	(197)	(305)	220	(85)
MBC	(10.828)	8.570	(2.258)	4.940	(9.640)	(4.700)
MEI	(342)	286	(56)	(177)	286	109
MSC	(51)	0	(51)	(210)	0	(210)
MYC	24.874	16.230	41.104	26.609	16.040	42.649
MYI	(17.102)	16.610	(492)	44.314	(60.260)	(15.946)
RBC	529	(540)	(11)	4.348	(3.900)	448
RYL	(944)	810	(134)	49	0	49
SAL	(16.729)	5.130	(11.599)	(7.368)	7.430	62
SCX	(4.183)	5.600	1.417	(7.202)	5.630	(1.572)
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	463	(420)	43
SSB	(8.055)	6.980	(1.075)	(211)	180	(31)
TOR	2.258	(970)	1.288	9.016	(8.540)	476
UAG	3.191	(3.150)	41	13.340	(12.670)	670
ULO	(222)	0	(222)	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	50,64	53,15
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	85,92	83,76
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,55	0,53
Investmentfonds	3,77	2,56
Pensionsgeschäfte	7,61	0,39
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,08	(0,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	2,17	1,68
Freiverkehrsfinaanzderivate	(0,51)	0,15
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,19)	(1,33)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	0,00	0,00

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,25	1,83
Unternehmensanleihen und Wechsel	23,59	20,33
Wandelanleihen und Wechsel	0,03	0,03
Kommunalanleihen und Wechsel	0,10	0,12
US-Regierungsbehörden	67,04	62,99
US-Schatzobligationen	20,92	21,40
Non-Agency-MBS	9,48	10,79
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,60	9,14
Staatsemissionen	5,92	5,49
Stammaktien	0,78	0,95
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,17	0,20
Real Estate Investment Trusts	0,21	0,27
Kurzfristige Instrumente	0,02	3,90
Investmentfonds	3,77	2,56
Pensionsgeschäfte	7,61	0,39
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,08	(0,04)
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,15	0,36
Zinsswaps	2,00	1,30
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,16	0,14
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,03)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,02)
Zinscaps	(0,07)	(0,06)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,07)	(0,04)
Total Return Swaps auf Indizes	0,00	0,00
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,07)	(0,31)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,43)	0,43
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,19)	(1,33)
Sonstige Aktiva und Passiva	(50,04)	(40,85)
Nettovermögen	100,00	100,00



BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,000 % fällig am 01.07.2054 - 01.08.2054	\$ 9.900	\$ 9.567	4,01	Madison Avenue Mortgage Trust 3,294 % fällig am 15.08.2034	\$ 692	\$ 643	0,27	Sculptor European CLO DAC 4,756 % fällig am 15.04.2034	€ 800	\$ 854	0,36
5,500 % fällig am 01.08.2054	12.300	12.130	5,08	Mansard Mortgages PLC 5,702 % fällig am 15.10.2048	£ 393	488	0,20	SLM Student Loan Trust 4,282 % fällig am 25.10.2039	2.193	2.216	0,93
6,000 % fällig am 01.08.2054	13.100	13.132	5,50	Morgan Stanley Capital Trust 6,828 % fällig am 15.07.2035	\$ 450	450	0,19	4,432 % fällig am 25.07.2039	676	678	0,28
		110.118	46,12	Newgate Funding PLC 5,512 % fällig am 01.12.2050	£ 307	379	0,16	Structured Asset Investment Loan Trust 6,435 % fällig am 25.05.2035	\$ 711	627	0,26
<b>US-SCHATZOBLIGATIONEN</b>				5,552 % fällig am 01.12.2050	1.473	1.771	0,74	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,895 % fällig am 25.07.2036	672	648	0,27
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.10.2024	1.772	1.754	0,74	Residential Accredit Loans, Inc. Trust 6,000 % fällig am 25.09.2035	\$ 107	87	0,04	Toro European CLO DAC 4,896 % fällig am 15.07.2034	€ 800	856	0,36
0,125 % fällig am 15.04.2025	121	118	0,05	6,000 % fällig am 25.09.2035	107	87	0,04			18.746	7,85
0,125 % fällig am 15.02.2052	676	384	0,16	RMAC Securities PLC 5,623 % fällig am 12.06.2044	£ 355	434	0,18	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
0,250 % fällig am 15.01.2025	1.324	1.296	0,54	Stratton Hawkmoor PLC 6,733 % fällig am 25.02.2053	1.700	2.169	0,91	Argentina Government International Bond 0,750 % fällig am 09.07.2030	\$ 760	428	0,18
0,250 % fällig am 15.07.2029	490	450	0,19	Stratton Mortgage Funding PLC 6,134 % fällig am 28.06.2050	945	1.195	0,50	3,500 % fällig am 09.07.2041	1.072	422	0,18
0,625 % fällig am 15.07.2032	4.208	3.775	1,58	Towd Point Mortgage Funding PLC 0,000 % fällig am 20.07.2053	2.300	2.916	1,22	3,625 % fällig am 09.07.2035	179	76	0,03
1,000 % fällig am 15.02.2049	125	95	0,04	6,634 % fällig am 20.02.2054	908	1.153	0,48	4,250 % fällig am 09.01.2038	63	29	0,01
1,375 % fällig am 15.07.2033	9.807	9.265	3,88	Tower Bridge Funding PLC 6,333 % fällig am 20.01.2066	450	572	0,24	Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos 4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP 50.000	53	0,02
1,625 % fällig am 15.10.2027	317	313	0,13	Trinity Square PLC 0,000 % fällig am 15.07.2059	1.700	2.148	0,90	Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 1.000	1.088	0,46
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.08.2025	7.500	7.344	3,08	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,669 % fällig am 25.07.2037	\$ 492	421	0,18	Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031 (d)	MXN 8.128	374	0,16
3,500 % fällig am 31.01.2028	1.100	1.065	0,45		38.543	16,14		4,000 % fällig am 30.11.2028 (d)	9.104	466	0,20
3,875 % fällig am 31.12.2027	1.600	1.570	0,66	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				5,750 % fällig am 12.10.2110	\$ 100	83	0,03
4,125 % fällig am 15.11.2032	1.200	1.180	0,49	AlbaCore Euro CLO DAC 4,984 % fällig am 18.10.2034	€ 800	858	0,36	6,350 % fällig am 09.02.2035	200	202	0,08
4,500 % fällig am 31.03.2026 (i)	11.400	11.341	4,75	AREIT LLC 7,441 % fällig am 17.08.2041	\$ 493	495	0,21	7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN 30.000	1.494	0,63
4,500 % fällig am 15.04.2027	11.000	10.985	4,60	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass- Through Certificates	400	359	0,15	10,000 % fällig am 05.12.2024	10.000	544	0,23
		50.935	21,34	7,260 % fällig am 25.11.2034	400	359	0,15	Romania Government International Bond 3,750 % fällig am 07.02.2034	€ 220	203	0,08
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Armada Euro CLO DAC 4,811 % fällig am 15.07.2033	€ 800	859	0,36	5,250 % fällig am 30.05.2032	1.100	1.148	0,48
1211 Avenue of the Americas Trust 4,280 % fällig am 10.08.2035	400	374	0,16	BNPP AM Euro CLO DAC 5,156 % fällig am 15.04.2031	900	955	0,40	5,500 % fällig am 18.09.2028	150	165	0,07
225 Liberty Street Trust 4,501 % fällig am 10.02.2036	500	432	0,18	Cumulus Static CLO DAC 5,725 % fällig am 15.11.2033	1.100	1.181	0,49	5,625 % fällig am 30.05.2037	1.100	1.138	0,48
280 Park Avenue Mortgage Trust 7,163 % fällig am 15.09.2034	100	91	0,04	Dryden Euro CLO DAC 4,904 % fällig am 18.04.2033	800	854	0,36	6,375 % fällig am 18.09.2033	150	167	0,07
Adjustable Rate Mortgage Trust 5,700 % fällig am 25.08.2036	649	226	0,09	First Franklin Mortgage Loan Trust 5,013 % fällig am 25.03.2036	\$ 733	686	0,29	Russia Government International Bond 5,250 % fällig am 23.06.2047	\$ 200	116	0,05
Alba PLC 5,612 % fällig am 15.12.2038	£ 528	629	0,26	Golden Bar Securitisation SRL 6,600 % fällig am 22.09.2043	€ 310	339	0,14	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 35.760	2.033	0,85
Bridgegate Funding PLC 9,233 % fällig am 16.10.2062	190	246	0,10	Home Equity Asset Trust 6,120 % fällig am 25.04.2036	\$ 738	681	0,29	Turkey Government International Bond 5,250 % fällig am 13.03.2030	\$ 1.000	916	0,38
Cheshire PLC 7,334 % fällig am 20.08.2045	940	1.193	0,50	Long Beach Mortgage Loan Trust 5,780 % fällig am 25.10.2036	746	237	0,10	5,750 % fällig am 11.05.2047	250	192	0,08
Curzon Mortgages PLC 6,983 % fällig am 28.07.2049	1.000	1.272	0,53	5,920 % fällig am 25.12.2036	614	213	0,09			11.337	4,75
Dilosk RBMS DAC 4,470 % fällig am 25.01.2063	€ 1.100	1.181	0,50	6,060 % fällig am 25.02.2036	351	289	0,12	<b>STAMMAKTEN</b>			
Eurosail PLC 4,179 % fällig am 13.03.2045	500	516	0,22	Marzio Finance SRL 4,685 % fällig am 28.05.2049	€ 1.908	2.059	0,86	<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
4,189 % fällig am 13.03.2045	1.500	1.488	0,62	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 6,015 % fällig am 25.01.2036	\$ 900	691	0,29	Intelsat Emergence S.A. (h)	937	35	0,02
6,353 % fällig am 13.06.2045	£ 1.003	1.207	0,51	New Century Home Equity Loan Trust 6,195 % fällig am 25.10.2035	700	591	0,25	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>			
Great Hall Mortgages PLC 5,613 % fällig am 18.06.2038	3.895	4.876	2,04	Rockford Tower Europe CLO DAC 5,220 % fällig am 24.04.2037	€ 1.100	1.180	0,49	\$ 279.719	117,16		
5,653 % fällig am 18.06.2039	1.500	1.856	0,78					<b>INVESTMENTFONDS</b>			
5,813 % fällig am 18.06.2038	2.400	2.905	1,22					<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Grifonas Finance PLC 4,181 % fällig am 28.08.2039	€ 473	495	0,21					PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (f)	22.973	229	0,10
GS Mortgage Securities Corp. Trust 7,626 % fällig am 15.11.2032	\$ 489	485	0,20					<b>Summe Investmentfonds</b>			
Harbour PLC 7,233 % fällig am 28.01.2054	£ 2.000	2.517	1,05					\$ 229	0,10		
Hospitality Mortgage Trust 7,442 % fällig am 15.11.2036	\$ 174	172	0,07					<b>AKTIEN</b>			
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2,949 % fällig am 06.09.2038	900	845	0,35								
Lehman XS Trust 5,820 % fällig am 25.11.2035	432	380	0,16								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 2.903	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (2.961)	\$ 2.903	\$ 2.903	1,22
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (2.961)</b>	<b>\$ 2.903</b>	<b>\$ 2.903</b>	<b>1,22</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund II (Forts.)

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	1	\$ 2	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	10	(2)	0,00
				\$ 0	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 0	0,00

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000 %	20.12.2026	\$ 460	\$ 0	0,00
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	900	2	0,00
CDX.EM-40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	800	4	0,00
CDX.EM-41 5-Year Index	1,000	20.06.2029	600	3	0,00
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	4.752	(25)	(0,01)
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000	20.06.2029	12.100	(44)	(0,02)
				\$ (60)	(0,03)

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,500 %	27.07.2027	£ 14.500	\$ 7	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	15.200	(133)	(0,06)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2028	¥ 130.000	0	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	490.000	(2)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	15.12.2041	30.000	(1)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	27.400	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	\$ 450	20	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	800	57	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	900	6	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	3.800	21	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,697	04.04.2025	100	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	1.750	109	0,05
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,790	10.04.2025	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	100	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	9.850	275	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	100	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	1.900	65	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	200	(8)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	4.300	(131)	(0,06)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2054	5.500	(59)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	100	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	10.500	(292)	(0,13)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	4.000	(11)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	5.200	19	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	17.200	175	0,07
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2031	8.200	(42)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	11.300	136	0,06
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	2.600	(86)	(0,03)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	11.400	73	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	18.12.2025	23.500	(28)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	8.300	(117)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2034	3.400	142	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	20.06.2025	16.900	(6)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,256	04.01.2027	BRL 29.700	(146)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,512	04.01.2027	10.200	(84)	(0,04)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500 %	18.09.2054	€ 3.000	\$ (55)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	100	(3)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	400	6	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	1.100	27	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,295	30.10.2028	MXN 19.400	(42)	(0,02)
					\$ (122)	(0,05)
					\$ (182)	(0,08)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – Schutzverkauf<sup>(1)</sup>**

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 900	\$ (4)	\$ 5	\$ 1	0,00
MYC	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	200	(9)	8	(1)	0,00
					\$ (13)	\$ 13	\$ 0	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**DEVISEINTERMINKONTRAKTE**

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD 195	\$ 130	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BOA	07.2024	€ 31.335	\$ 34.020	438	0	438	0,18
	07.2024	HKD 4.816	617	0	0	0	0,00
BPS	08.2024	\$ 168	TRY 5.882	2	0	2	0,00
	07.2024	€ 2.161	\$ 2.339	23	0	23	0,01
	07.2024	£ 22.643	28.924	302	0	302	0,13
	07.2024	KRW 790.073	576	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 130	AUD 195	0	0	0	0,00
	07.2024	5.993	¥ 936.881	0	(170)	(170)	(0,07)
	08.2024	AUD 195	\$ 130	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 1.570	1.681	0	(4)	(4)	0,00
	09.2024	CNH 114	16	0	0	0	0,00
	09.2024	MXN 42.724	2.292	0	(16)	(16)	(0,01)
	05.2029	KWD 67	230	7	0	7	0,00
BRC	07.2024	\$ 68	HKD 533	0	0	0	0,00
	07.2024	404	TRY 14.399	29	0	29	0,01
	08.2024	834	28.963	6	0	6	0,00
	11.2024	98	3.863	5	0	5	0,00
CBK	07.2024	£ 2.290	\$ 2.901	6	0	6	0,00
	07.2024	\$ 445	BRL 2.425	0	(8)	(8)	0,00
	07.2024	2.304	CNY 16.393	0	(30)	(30)	(0,01)
	07.2024	341	£ 269	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	103	ZAR 1.868	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	BRL 2.434	\$ 445	9	0	9	0,00
	09.2024	TWD 11.726	364	2	0	2	0,00
DUB	07.2024	BRL 665	127	7	0	7	0,00
	07.2024	KRW 355.409	258	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 5.237	BRL 27.881	0	(237)	(237)	(0,10)
GLM	07.2024	ZAR 6.771	\$ 370	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 212	TRY 8.476	28	0	28	0,01
JPM	07.2024	CNY 304	\$ 43	1	0	1	0,00
	07.2024	KRW 627.280	455	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 28	CNY 198	0	0	0	0,00
	07.2024	261	£ 206	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	ZAR 12.826	\$ 697	0	(5)	(5)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund II (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	08.2024	CNY 198	\$ 28	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	\$ 455	TRY 15.848	11	0	11	0,00
	09.2024	CLP 57.306	\$ 62	1	0	1	0,00
	09.2024	TWD 21.850	679	4	0	4	0,00
	10.2024	CNH 598	84	1	0	1	0,00
	11.2024	\$ 51	TRY 2.021	3	0	3	0,00
MBC	07.2024	CAD 4.533	\$ 3.327	14	0	14	0,01
	07.2024	€ 125	135	1	0	1	0,00
	07.2024	¥ 924.237	5.764	18	0	18	0,01
	07.2024	\$ 30.944	£ 24.458	0	(27)	(27)	(0,01)
	08.2024	£ 24.458	\$ 30.949	26	0	26	0,01
	08.2024	\$ 488	CAD 668	0	0	0	0,00
	08.2024	5.449	¥ 870.742	0	(10)	(10)	0,00
MYI	07.2024	€ 5	\$ 5	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 104.742	653	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 3.295	CAD 4.533	17	0	17	0,01
SCX	07.2024	CNY 16.287	\$ 2.290	31	0	31	0,01
	07.2024	\$ 36.022	€ 33.621	12	0	12	0,01
	07.2024	930	HKD 7.265	0	0	0	0,00
	07.2024	ZAR 19.225	\$ 1.043	0	(8)	(8)	0,00
	08.2024	€ 33.621	36.074	0	(11)	(11)	0,00
	09.2024	CNH 54	7	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 18.968	588	2	0	2	0,00
	10.2024	\$ 616	CNH 4.441	0	(3)	(3)	0,00
SSB	07.2024	MXN 5.710	\$ 306	0	(5)	(5)	0,00
	09.2024	\$ 2.069	TWD 66.663	0	(10)	(10)	0,00
UAG	07.2024	BRL 1.760	\$ 327	10	0	10	0,00
	07.2024	\$ 1.669	KRW 2.294.543	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 1.020	\$ (551)	\$ 469	0,20

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklasse Class E AUD (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	07.2024	AUD 9.976	\$ 6.645	\$ 0	\$ (17)	\$ (17)	(0,01)
	07.2024	\$ 11.980	AUD 17.995	38	0	38	0,02
	08.2024	6.651	9.976	18	0	18	0,01
BPS	07.2024	AUD 9.976	\$ 6.647	0	(15)	(15)	(0,01)
	08.2024	\$ 6.653	AUD 9.976	15	0	15	0,01
BRC	07.2024	5.691	8.600	52	0	52	0,02
CBK	07.2024	AUD 435	\$ 290	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 226	AUD 343	3	0	3	0,00
GLM	07.2024	AUD 196	\$ 131	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2024	9.362	6.240	0	(13)	(13)	(0,01)
	08.2024	\$ 6.245	AUD 9.362	12	0	12	0,01
MBC	07.2024	AUD 133	\$ 89	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 768	AUD 1.155	3	0	3	0,00
MYI	07.2024	1.322	1.987	5	0	5	0,00
				\$ 146	\$ (47)	\$ 99	0,04

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklasse Class E EUR (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2024	\$ 2.945	€ 2.712	\$ 0	\$ (38)	\$ (38)	(0,02)
BPS	07.2024	€ 2.516	\$ 2.693	1	(5)	(4)	0,00
	07.2024	\$ 2.882	€ 2.662	0	(29)	(29)	(0,01)
	08.2024	2.579	2.408	5	0	5	0,00
BRC	07.2024	2.608	2.408	0	(27)	(27)	(0,01)
CBK	07.2024	€ 366	\$ 393	1	0	1	0,00
GLM	07.2024	51	56	1	0	1	0,00
JPM	07.2024	\$ 70	€ 65	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	€ 2.468	\$ 2.639	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	\$ 22	€ 20	0	0	0	0,00
	08.2024	2.642	2.468	6	0	6	0,00
SCX	07.2024	€ 2.466	\$ 2.642	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 2.646	€ 2.466	1	0	1	0,00
				\$ 15	\$ (106)	\$ (91)	(0,04)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 2.791	\$ 3.530	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2024	\$ 11.207	£ 8.802	0	(80)	(80)	(0,04)
	08.2024	3.429	2.711	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07.2024	£ 15	\$ 19	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	3.372	4.275	13	0	13	0,01
	07.2024	\$ 13	£ 10	0	0	0	0,00
MBC	08.2024	3.202	2.530	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	£ 2.667	\$ 3.374	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 41	£ 32	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	3.354	2.650	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 18	\$ (88)	\$ (70)	(0,03)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Class E JPY (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	\$ 604	¥ 93.887	\$ 0	\$ (20)	\$ (20)	(0,01)
BRC	07.2024	806	125.446	0	(26)	(26)	(0,01)
CBK	07.2024	147	23.477	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2024	2.338	362.963	0	(82)	(82)	(0,03)
MBC	07.2024	¥ 3.393.642	\$ 21.138	41	0	41	0,02
	07.2024	\$ 21.862	¥ 3.424.243	0	(575)	(575)	(0,24)
MYI	08.2024	21.138	3.377.757	0	(40)	(40)	(0,02)
	07.2024	¥ 62.767	\$ 401	11	0	11	0,00
SCX	07.2024	\$ 342	¥ 53.581	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	19.167	2.999.330	0	(522)	(522)	(0,22)
	08.2024	79	12.698	0	0	0	0,00
SSB	07.2024	26	4.079	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	17.906	2.792.028	0	(549)	(549)	(0,23)
				\$ 52	\$ (1.824)	\$ (1.772)	(0,74)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (1.365) (0,57)

#### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2054	\$ 600	\$ (566)	(0,24)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (566)	(0,24)
Summe Anlagen		\$ 280.738	117,59
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (41.994)	(17,59)
Nettovermögen		\$ 238.744	100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,02 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2021	\$ 77	\$ 35	0,02

(i) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 2.487 USD (31. Dezember 2023: 3.529 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund II (Forts.)

Barmittel in Höhe von 2.686 USD (31. Dezember 2023: 1.462 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 951 USD (31. Dezember 2023: 31 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 279.684	\$ 35	\$ 279.719
Investmentfonds	229	0	0	229
Pensionsgeschäfte	0	2.903	0	2.903
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2	(1.549)	0	(1.547)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(566)	0	(566)
<b>Summen</b>	<b>\$ 231</b>	<b>\$ 280.472</b>	<b>\$ 35</b>	<b>\$ 280.738</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 135.326	\$ 602	\$ 135.928
Investmentfonds	123	0	0	123
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2	495	0	497
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(582)	0	(582)
<b>Summen</b>	<b>\$ 125</b>	<b>\$ 135.239</b>	<b>\$ 602</b>	<b>\$ 135.966</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,480 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ (2.516)	\$ (2.517)	(1,05)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (2.517)</b>	<b>(1,05)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 18	\$ 0	\$ 18	\$ 97	\$ 0	\$ 97
BOA	402	(300)	102	50	0	50
BPS	37	0	37	16	0	16
BRC	39	(30)	9	12	0	12
CBK	(11)	0	(11)	109	0	109
DUB	(230)	0	(230)	(1)	0	(1)
GLM	(53)	0	(53)	(3)	0	(3)
JPM	13	0	13	16	0	16
MBC	(550)	320	(230)	(8)	0	(8)
MYC	(1)	31	30	(1)	31	30
MYI	26	0	26	12	0	12
SCX	(499)	270	(229)	44	0	44
SSB	(15)	0	(15)	48	0	48
UAG	(541)	330	(211)	16	0	16

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	56,36	44,99
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	56,28	63,19
Sonstige übertragbare Wertpapiere	4,52	0,42
Investmentfonds	0,10	0,10
Pensionsgeschäfte	1,22	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,08)	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,57)	0,33
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,24)	(0,47)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(2,85)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,05)	k. A.

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,68	0,96
Unternehmensanleihen und Wechsel	20,26	18,65
US-Regierungsbehörden	46,12	43,99
US-Schatzobligationen	21,34	19,70
Non-Agency-MBS	16,14	14,67
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,85	4,99
Staatsemissionen	4,75	5,62
Stammaktien	0,02	0,02
Investmentfonds	0,10	0,10
Pensionsgeschäfte	1,22	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,03)	(0,02)
Zinsswaps	(0,05)	0,08
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,20	0,06
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,77)	0,28
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,24)	(0,47)
Sonstige Aktiva und Passiva	(17,59)	(8,63)
Nettovermögen	100,00	100,00



BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GEN S	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GEN S	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GEN S
Cerevel Therapeutics Holdings, Inc. (a)	1.100	\$ 45	0,02	Equity LifeStyle Properties, Inc.	3.944	\$ 257	0,12	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
		82	0,04	Essex Property Trust, Inc.	4.950	343	0,16	<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Extra Space Storage, Inc.	457	124	0,06	Alimentation Couche-Tard, Inc.	\$ 250	\$ 249	0,12
International Distribution Services PLC (a)	5.827	24	0,01	Federal Realty Investment Trust	1.193	185	0,09	5,510 % fällig am 16.07.2024			
Stericycle, Inc. (a)	500	29	0,02	First Industrial Realty Trust, Inc.	1.100	111	0,05	Conagra Brands, Inc.	250	249	0,12
		53	0,03	Gaming and Leisure Properties, Inc.	4.868	231	0,11	5,800 % fällig am 09.07.2024			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				Healthcare Realty Trust, Inc.	4.819	218	0,10	Crown Castle, Inc.	250	249	0,12
Altium Ltd.	598	27	0,01	Healthpeak Properties, Inc.	5.100	84	0,04	5,840 % fällig am 09.07.2024	250	249	0,12
ANSYS, Inc. (a)	100	32	0,02	Highwoods Properties, Inc.	10.957	215	0,10	5,520 % fällig am 30.07.2024	250	250	0,12
HashiCorp, Inc. 'A' (a)	900	30	0,01	Host Hotels & Resorts, Inc.	1.300	34	0,02	Keurig Dr Pepper, Inc.	250	249	0,12
		89	0,04	InvenTrust Properties Corp.	7.738	139	0,07	5,500 % fällig am 24.07.2024	250	249	0,12
<b>BAUSTOFFE</b>				Invitation Homes, Inc.	1.567	39	0,02	5,520 % fällig am 01.08.2024	250	249	0,12
United States Steel Corp.	1.100	42	0,02	Kilroy Realty Corp.	12.274	441	0,21	5,520 % fällig am 24.07.2024	250	249	0,12
<b>IMMOBILIEN</b>				Kimco Realty Corp.	1.395	44	0,02	5,600 % fällig am 11.07.2024	250	249	0,12
Howard Hughes Holdings, Inc. (a)	1.291	84	0,04	Mid-America Apartment Communities, Inc.	7.212	140	0,07	Penske Truck Leasing Co. LP	250	249	0,12
		624	0,30	National Storage Affiliates Trust	416	59	0,03	5,510 % fällig am 02.08.2024	300	299	0,14
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				Park Hotels & Resorts, Inc.	687	28	0,01	Targa Resources Corp.	250	250	0,12
Nationwide Building Society 10,250 %	813	134	0,06	Prologis, Inc.	6.038	90	0,04	6,000 % fällig am 26.07.2024	250	250	0,12
<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>				Public Storage	9.158	1.029	0,49	VW Credit, Inc.	250	250	0,12
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	753	88	0,04	Realty Income Corp.	1.743	501	0,24	5,530 % fällig am 09.07.2024		3.040	1,46
American Assets Trust, Inc.	1.191	27	0,01	Regency Centers Corp.	6.117	323	0,16	Summe kurzfristige Instrumente			
American Homes 4 Rent 'A'	8.918	331	0,16	Retail Opportunity Investments Corp.	2.553	159	0,08	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 262.191	125,84	
American Tower Corp.	636	124	0,06	Rexford Industrial Realty, Inc.	6.000	75	0,04				
Americold Realty Trust, Inc.	6.037	154	0,07	RLJ Lodging Trust	3.166	141	0,07	<b>AKTIEN</b>			
AvalonBay Communities, Inc.	2.225	460	0,22	Ryman Hospitality Properties, Inc.	15.671	151	0,07	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Boston Properties, Inc.	575	35	0,02	SBA Communications Corp.	1.458	146	0,07	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Brixmor Property Group, Inc.	665	15	0,01	Simon Property Group, Inc.	614	121	0,06	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	131	1.314	0,63
Camden Property Trust	1.302	142	0,07	SITE Centers Corp.	4.200	638	0,31	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
COPT Defense Properties	1.149	29	0,01	Sun Communities, Inc.	3.801	55	0,03	Invesco Physical Gold ETC	36	8.253	3,96
Crown Castle, Inc.	1.040	102	0,05	Sunstone Hotel Investors, Inc.	1.929	232	0,11	iShares Physical Gold ETC	288	13.078	6,28
CubeSmart	625	28	0,01	Terreno Realty Corp.	10.197	107	0,05			21.331	10,24
DiamondRock Hospitality Co.	11.804	100	0,05	UDR, Inc.	981	58	0,03	Summe Investmentfonds	\$ 22.645	10,87	
Digital Realty Trust, Inc.	3.653	555	0,27	Ventas, Inc.	3.125	129	0,06				
Equinix, Inc.	960	726	0,35	VICI Properties, Inc.	1.658	85	0,04				
				Welltower, Inc.	9.601	275	0,13				
				WP Carey, Inc.	4.700	490	0,24				
					347	19	0,01				
					10.432	5,01					

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto-vermögens
SSB	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 543	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 28.02.2027	\$ (554)	\$ 543	\$ 543	0,26
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (554)</b>	<b>\$ 543</b>	<b>\$ 543</b>	<b>0,26</b>

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2024	8	\$ 2	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	75	(13)	(0,01)
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2024	9	3	0,00
Euro STOXX 50 September Futures	Long	09.2024	46	(33)	(0,02)
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	21	(26)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	56	(71)	(0,03)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2024	53	(1)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	57	(50)	(0,02)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	11	(36)	(0,02)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	24	\$ (35)	(0,02)
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	97	48	0,02
FTSE 100 Index September Futures	Long	09.2024	6	(9)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	170	(109)	(0,05)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	333	(255)	(0,12)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	100	(72)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	4	(4)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	133	(51)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	6	(4)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	58	3	0,00
				\$ (713)	(0,34)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - EUREX Euro-Schatz August 2024 Futures	€ 106,200	26.07.2024	79	\$ (13)	\$ (6)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (719)	(0,35)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.03.2042	£ 2.200	\$ 143	0,07
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,500	15.06.2052	600	(214)	(0,10)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	3.500	(46)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2031	¥ 50.000	15	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	20.03.2029	154.390	54	0,03
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.12.2031	77.000	10	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,550	14.09.2028	1.950.000	8	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,237	21.11.2053	\$ 1.730	443	0,21
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	10.900	1.585	0,76
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	18.800	(1.313)	(0,63)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	2.600	41	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	34.000	284	0,14
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	€ 200	88	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	200	100	0,05
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	400	176	0,08
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	600	(42)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	300	(20)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	300	(21)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	600	(36)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	200	(12)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	13.500	583	0,28
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	39.800	(732)	(0,35)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,879	15.08.2032	8.400	135	0,06
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026	15.900	107	0,05
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,475	26.02.2025	41.900	64	0,03
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	1.100	22	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,548	15.11.2053	400	(9)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,590	15.12.2052	500	13	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,620	15.11.2053	200	(10)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,680	15.04.2053	2.100	139	0,07
Zahlung	CPTFEMU	2,700	15.04.2053	900	42	0,02
Zahlung	CPURNSA	1,280	19.05.2030	\$ 600	(46)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	1,794	24.08.2027	850	73	0,03
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	300	26	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	500	43	0,02
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	750	(66)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA	2,165	16.04.2029	500	(45)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,314	26.02.2026	400	35	0,02
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	300	(28)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,360	09.05.2028	450	(42)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	460	(43)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	300	(28)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,419	05.03.2026	700	62	0,03
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	300	27	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	500	45	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	300	27	0,01
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	£ 800	(182)	(0,09)
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	500	(95)	(0,05)
Zahlung	UKRPI	3,760	15.03.2026	10.100	14	0,01
Zahlung	UKRPI	3,850	15.09.2024	400	(91)	(0,04)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	UKRPI		4,040 %	15.04.2029	£ 2.100	\$ 15	0,01
Erhalt	UKRPI		4,143	15.10.2032	400	5	0,00
Erhalt	UKRPI		4,287	15.02.2032	2.500	194	0,09
Erhalt	UKRPI		4,595	15.08.2032	4.600	(169)	(0,08)
Erhalt	UKRPI		4,615	15.02.2027	4.900	269	0,13
Erhalt	UKRPI		4,735	15.12.2026	400	48	0,02
						\$ 1.645	0,79
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 1.645	0,79

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	300	\$ (14)	\$ (11)	(0,01)

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,900 %	29.08.2025	4.000	\$ (52)	\$ (39)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	29.08.2025	4.000	(52)	(24)	(0,01)
GST	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,800	01.09.2025	22.800	(288)	(197)	(0,09)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	01.09.2025	22.800	(288)	(160)	(0,08)
							\$ (680)	\$ (420)	(0,20)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 200	\$ (6)	\$ 5	\$ (1)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	800	(26)	24	(2)	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	200	0	(1)	(1)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(12)	11	(1)	0,00
					\$ (44)	\$ 39	\$ (5)	0,00

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
MYC	Erhalt	CPURNSA	1,800 %	20.07.2026	\$ 600	\$ 0	\$ (99)	\$ (99)	(0,05)
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	50	0	(8)	(8)	0,00
	Erhalt	CPURNSA	1,810	19.07.2026	500	0	(81)	(81)	(0,04)
						\$ 0	\$ (188)	\$ (188)	(0,09)

#### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
CBK	Erhalt	TRNGLU Index	2.214	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 10.478	10.07.2024	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
JPM	Erhalt	JMABDEWU Index	1.627	0,053 %	261	18.02.2025	0	2	2	0,00
	Erhalt	JMABNIU5 Index	95.050	0,000	17.591	18.02.2025	0	35	35	0,02
MAC	Erhalt	PIMCOBBV Index	43.741	0,600	4.973	15.07.2024	0	148	148	0,07
	Erhalt	PIMCOBBV Index	143.704	0,210	24.018	16.09.2024	0	111	111	0,05
							\$ 0	\$ 291	\$ 291	0,14

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

## TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	ConocoPhillips Co.	459	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 52	04.06.2025	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	Zahlung	Noble Corp.	208	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	9	11.06.2025	0	0	0	0,00
	Zahlung	Synopsys, Inc.	34	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	19	22.01.2025	0	(1)	(1)	0,00
BRC	Zahlung	Capital One Financial Corp.	204	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	28	19.02.2025	0	0	0	0,00
MYI	Zahlung	Chevron Corp.	410	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	67	17.07.2024	0	2	2	0,00
							\$ 0	\$ 1	\$ 1	0,00

## DEWISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD	\$ 272	\$ 167	\$ 1	\$ 0	0,00
	08.2024	\$	167	NZD 272	0	(1)	0,00
	10.2024		600	CNH 4.293	0	(7)	0,00
BOA	07.2024	PLN	637	\$ 159	1	0	0,00
	07.2024	SGD	14	10	0	0	0,00
	07.2024	\$	283	HKD 2.207	0	0	0,00
	07.2024		176	KRW 240.522	0	(1)	0,00
	07.2024		131	PLN 524	0	(1)	0,00
	07.2024		258	SGD 349	0	(1)	0,00
	08.2024	SGD	14	\$ 10	0	0	0,00
BPS	07.2024	AUD	102	67	0	(1)	0,00
	07.2024	BRL	718	143	13	0	0,01
	07.2024	CAD	4.165	3.052	8	0	0,00
	07.2024	€	423	455	2	0	0,00
	07.2024	£	183	233	1	0	0,00
	07.2024	¥	2.684.700	17.188	497	0	0,24
	07.2024	PLN	531	132	0	0	0,00
	07.2024	SGD	2.594	1.913	0	(1)	0,00
	07.2024	\$	3.532	AUD 5.300	8	0	0,00
	07.2024		100	IDR 1.638.639	0	0	0,00
	07.2024		50	ILS 184	0	(1)	0,00
	07.2024		174	KRW 238.720	0	(1)	0,00
	07.2024		347	NZD 565	0	(3)	0,00
	07.2024		2.566	PLN 10.371	18	(4)	0,01
	08.2024	AUD	5.300	\$ 3.535	0	(8)	0,00
	08.2024	\$	1.913	SGD 2.590	1	0	0,00
	09.2024	CNH	10.783	\$ 1.505	19	0	0,01
	09.2024	TWD	3.118	97	1	0	0,00
	09.2024	\$	251	INR 21.002	0	0	0,00
	09.2024		20	TWD 640	0	0	0,00
	10.2024	CNH	3.967	\$ 554	6	0	0,00
	10.2024	\$	127	CNH 907	0	(1)	0,00
BRC	07.2024	DKK	4.257	\$ 620	8	0	0,00
	07.2024	MXN	2.465	133	0	(1)	0,00
	07.2024	SGD	270	200	1	0	0,00
	07.2024	\$	29	NOK 306	0	0	0,00
	07.2024		201	PLN 801	0	(1)	0,00
	07.2024		678	RON 3.123	0	(5)	0,00
	07.2024		1	THB 23	0	0	0,00
	07.2024		2.177	TRY 74.044	34	0	0,02
	09.2024	MXN	3.749	\$ 198	0	(4)	0,00
	09.2024	TRY	10.294	278	0	(16)	0,01
	09.2024	\$	3.845	MXN 72.036	48	0	0,02
CBK	07.2024	CHF	204	\$ 224	0	(3)	0,00
	07.2024	£	9.147	11.635	72	0	0,03
	07.2024	KRW	61.833	45	0	0	0,00
	07.2024	SGD	176	130	1	0	0,00
	07.2024	\$	767	BRL 4.181	0	(15)	0,01
	07.2024		320	PLN 1.268	0	(4)	0,00
	07.2024		292	SEK 3.099	1	0	0,00
	07.2024		1.605	THB 58.754	0	(2)	0,00
	08.2024	BRL	4.195	\$ 767	15	0	0,01
	09.2024	TWD	1.189	37	0	0	0,00
	09.2024	\$	2.631	INR 219.998	2	(1)	0,00
	09.2024		122	MXN 2.299	2	0	0,00
	09.2024		313	PHP 18.388	2	0	0,00
DUB	07.2024		607	CLP 560.918	0	(12)	0,01
	07.2024		95	KRW 130.475	0	0	0,00
	07.2024		349	PLN 1.373	0	(8)	0,00
	08.2024	BRL	537	\$ 104	8	0	0,00
FAR	07.2024	AUD	5.198	3.464	0	(8)	0,00
	07.2024	NZD	523	319	0	0	0,00
	07.2024	\$	85	NZD 138	0	(1)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	\$ 319	NZD 523	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	09.2024	304	PEN 1.139	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	MXN 2.281	\$ 123	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	\$ 1.686	MYR 7.940	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	201	PLN 792	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	821	ZAR 15.012	1	0	1	0,00
JPM	08.2024	2.436	BRL 12.498	0	(194)	(194)	(0,09)
	07.2024	BRL 206	\$ 41	4	0	4	0,00
	07.2024	CHF 132	146	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	CNY 22.428	3.145	34	0	34	0,02
	07.2024	\$ 120	CHF 106	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	60	CNY 427	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	922	DKK 6.424	1	0	1	0,00
	07.2024	1.262	IDR 20.466.945	0	(11)	(11)	(0,01)
	07.2024	100	ILS 369	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	117	KRW 161.025	0	0	0	0,00
	07.2024	139	PLN 543	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	2.010	SGD 2.705	0	(14)	(14)	(0,01)
	07.2024	1.545	ZAR 28.436	11	0	11	0,01
	08.2024	DKK 6.413	\$ 922	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	TRY 9.428	275	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 3.145	CNY 22.442	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	INR 8.464	\$ 101	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 2.022	63	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 334	INR 28.022	1	0	1	0,00
	10.2024	CNH 5.303	\$ 741	8	0	8	0,00
	10.2024	\$ 126	CNH 903	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2024	HUF 38.294	\$ 103	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	¥ 19.200	122	2	0	2	0,00
	07.2024	NOK 238	22	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.333	CZK 30.738	0	(17)	(17)	(0,01)
	07.2024	911	HUF 339.473	10	0	10	0,00
	08.2024	22	NOK 238	0	0	0	0,00
	09.2024	23	TWD 755	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	BRL 3.256	\$ 630	44	0	44	0,02
	07.2024	MYR 528	112	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 3.103	294	1	0	1	0,00
	07.2024	THB 3.937	107	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 632	DKK 4.409	2	0	2	0,00
	07.2024	297	€ 278	1	0	1	0,00
	07.2024	48	£ 38	0	0	0	0,00
	07.2024	299	NZD 488	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	DKK 4.401	\$ 632	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	\$ 294	SEK 3.098	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	TWD 805	\$ 25	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 224	INR 18.704	0	0	0	0,00
RBC	09.2024	127	10.656	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 394	\$ 423	1	0	1	0,00
SCX	07.2024	MXN 77	4	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 3.220	CNY 22.896	0	(44)	(44)	(0,02)
	07.2024	89	KRW 121.138	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	CNH 4.217	\$ 588	7	0	7	0,00
	09.2024	TWD 1.169	36	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 1.945	INR 162.748	3	0	3	0,00
	09.2024	313	PHP 18.368	1	0	1	0,00
SSB	09.2024	26	TWD 836	0	0	0	0,00
	07.2024	CNY 911	\$ 128	2	0	2	0,00
	07.2024	€ 35.209	38.194	459	0	459	0,22
TOR	07.2024	NZD 396	243	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 16.911	¥ 2.704.069	0	(101)	(101)	(0,05)
	08.2024	¥ 2.691.389	\$ 16.911	101	0	101	0,05
	08.2024	\$ 142	COP 570.005	0	(6)	(6)	0,00
UAG	08.2024	243	NZD 396	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	CHF 1.136	\$ 1.257	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	DKK 6.589	957	10	0	10	0,00
	07.2024	\$ 1.521	CHF 1.365	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	363	ILS 1.343	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	CHF 1.359	\$ 1.521	2	0	2	0,00
				\$ 1.477	\$ (551)	\$ 926	0,45

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Class E AUD (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD 119	\$ 80	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 159	AUD 239	1	0	1	0,00
BPS	08.2024	80	119	0	0	0	0,00
	07.2024	AUD 119	\$ 80	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 80	AUD 119	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BRC	07.2024	KRW 86	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 17	AUD 25	0	0	0	0,00
	07.2024	0	KRW 86	0	0	0	0,00
	08.2024	0	86	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	1	AUD 2	0	0	0	0,00
				\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2024	€ 240	\$ 260	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2024	\$ 27.584	€ 25.406	0	(355)	(355)	(0,17)
BPS	07.2024	€ 5.662	\$ 6.057	1	(12)	(11)	(0,01)
	07.2024	\$ 3.702	€ 3.420	0	(37)	(37)	(0,02)
BRC	08.2024	5.867	5.477	12	0	12	0,01
	07.2024	€ 106	\$ 113	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	347	376	4	0	4	0,00
FAR	07.2024	\$ 26.785	€ 24.592	0	(428)	(428)	(0,20)
GLM	07.2024	€ 85	\$ 92	1	0	1	0,00
JPM	07.2024	166	178	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	23.731	25.380	3	(57)	(54)	(0,03)
	08.2024	\$ 24.762	€ 23.123	57	0	57	0,03
MYI	07.2024	€ 88	\$ 95	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	162	176	2	0	2	0,00
RYL	07.2024	109	117	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	23.309	24.974	0	(8)	(8)	0,00
	08.2024	\$ 24.897	€ 23.204	8	0	8	0,00
SSB	07.2024	637	587	0	(8)	(8)	0,00
UAG	08.2024	€ 126	\$ 135	0	0	0	0,00
				\$ 91	\$ (905)	\$ (814)	(0,39)

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilklassen Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend und Class E GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	07.2024	£ 179	\$ 226	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 1.120	£ 877	0	(11)	(11)	(0,01)
	08.2024	220	174	0	0	0	0,00
BRC	07.2024	2	KRW 3.023	0	0	0	0,00
	08.2024	KRW 3.018	\$ 2	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	£ 27	\$ 34	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 19	£ 15	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	KRW 3.016	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 943	£ 739	0	(9)	(9)	0,00
MBC	07.2024	£ 716	\$ 906	1	0	1	0,00
	08.2024	\$ 895	£ 707	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07.2024	£ 709	\$ 900	3	0	3	0,00
	08.2024	\$ 900	£ 709	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 4	\$ (24)	\$ (20)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilklassen Administrative SGD (Hedged) ausschuttend II und E Class SGD (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2024	SGD 1.631	\$ 1.202	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07.2024	\$ 218	SGD 294	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	1.202	1.629	2	0	2	0,00
BPS	07.2024	SGD 1.636	\$ 1.206	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 1.206	SGD 1.633	1	0	1	0,00
BRC	07.2024	SGD 5	\$ 3	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	\$ 33	SGD 44	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	SGD 36	\$ 27	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	\$ 1.218	SGD 1.640	0	(8)	(8)	(0,01)
SCX	07.2024	1.224	1.650	0	(7)	(7)	0,00
UAG	07.2024	8	11	0	0	0	0,00
				\$ 3	\$ (19)	\$ (16)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfondsderivate

\$ (255) (0,12)

Summe Anlagen

\$ 286.050 137,29

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (77.697) (37,29)

Nettovermogen

\$ 208.353 100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (d) Mit dem Fonds verbunden.
- (e) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 28.025 USD (31. Dezember 2023: 15.168 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 1.225 USD) wurde zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 3.990 USD (31. Dezember 2023: 4.010 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.510 USD (31. Dezember 2023: 2.460 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 11.005	\$ 251.002	\$ 184	\$ 262.191
Investmentfonds	22.645	0	0	22.645
Pensionsgeschäfte	0	543	0	543
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(223)	894	0	671
<b>Summen</b>	<b>\$ 33.427</b>	<b>\$ 252.439</b>	<b>\$ 184</b>	<b>\$ 286.050</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 15.799	\$ 273.301	\$ 204	\$ 289.304
Investmentfonds	28.256	0	0	28.256
Pensionsgeschäfte	0	364	0	364
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	54	(5.167)	0	(5.113)
<b>Summen</b>	<b>\$ 44.109</b>	<b>\$ 268.498</b>	<b>\$ 204</b>	<b>\$ 312.811</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,570 %	26.06.2024	03.07.2024	\$ (28.015)	\$ (28.036)	(13,46)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (28.036)</b>	<b>(13,46)</b>

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (6)	\$ 0	\$ (6)	\$ 2	\$ 0	\$ 2
BOA	(356)	380	24	(151)	0	(151)
BPS	507	(330)	177	(990)	1.250	260
BRC	64	(70)	(6)	348	(370)	(22)
CBK	69	0	69	(53)	(1.080)	(1.133)
DUB	(21)	30	9	34	0	34
FAR	(444)	0	(444)	(225)	0	(225)
GLM	(273)	160	(113)	(203)	0	(203)
GST	(358)	560	202	(591)	560	(31)
JPM	48	0	48	(73)	0	(73)
MAC	259	(310)	(51)	(178)	0	(178)
MBC	(3)	0	(3)	169	(360)	(191)

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
MYC	\$ (190)	\$ 260	\$ 70	\$ (214)	\$ 260	\$ 46
MYI	45	120	165	262	(480)	(218)
RBC	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	(2)	10	8
SAL	(1)	0	(1)	(1)	0	(1)
SCX	(40)	0	(40)	15	0	15
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	8	0	8
SSB	453	(580)	(127)	7	0	7
TOR	(6)	0	(6)	(638)	380	(258)
UAG	(4)	0	(4)	46	0	46

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,55	79,26
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	35,49	34,78
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,80	0,20
Investmentfonds	10,87	11,16
Pensionsgeschäfte	0,26	0,14
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,35)	(0,88)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,79	(0,18)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,12)	(0,96)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(13,46)	(5,95)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,49)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	0,86	2,83
US-Regierungsbehörden	34,04	27,20
US-Schatzobligationen	39,38	33,95
Non-Agency-MBS	4,88	4,33
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,65	4,24
Staatsemissionen	35,20	33,66
Stammaktien	0,30	0,33
Vorzugswertpapiere	0,06	0,05
Real Estate Investment Trusts	5,01	5,91
Kurzfristige Instrumente	1,46	1,74
Investmentfonds	10,87	11,16
Pensionsgeschäfte	0,26	0,14
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,34)	(0,83)
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,79	(0,18)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,20)	(0,54)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,09)	(0,07)
Total Return Swaps auf Indizes	0,14	(0,14)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,45	(0,38)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,41)	0,18
Sonstige Aktiva und Passiva	(37,29)	(23,52)
Nettovermögen	100,00	100,00



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
6,433 % fällig am 20.05.2073	\$ 4.384	\$ 4.450	0,60	MortgageIT Trust				Palmer Square European Loan Funding DAC				
6,487 % fällig am 20.02.2062	8	8	0,00	6,100 % fällig am 25.02.2035	\$ 46	\$ 44	0,01	4,626 % fällig am 15.10.2031	€ 2.027	\$ 2.161	0,29	
6,493 % fällig am 20.11.2072	8.336	8.465	1,14	Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				4,636 % fällig am 15.07.2031	1.614	1.720	0,23	
6,503 % fällig am 20.11.2072	9.507	9.662	1,30	6,020 % fällig am 25.12.2035	235	226	0,03	Saranac CLO Ltd. 7,209 % fällig am 22.06.2030	\$ 1.278	1.280	0,17	
6,525 % fällig am 20.07.2067	4.771	4.803	0,65	Prime Mortgage Trust				Tikehau CLO DAC 4,723 % fällig am 04.08.2034	€ 1.993	2.136	0,29	
6,687 % fällig am 20.08.2070	2.459	2.518	0,34	5,860 % fällig am 25.02.2034	1	1	0,00	Toro European CLO DAC 4,638 % fällig am 15.02.2034	3.200	3.433	0,46	
6,833 % fällig am 20.08.2071	974	993	0,13	Ripon Mortgages PLC 5,934 % fällig am 28.08.2056	£ 3.615	4.570	0,61	4,832 % fällig am 12.01.2032	2.500	2.676	0,36	
Uniform Mortgage-Backed Security				Sequoia Mortgage Trust 5,873 % fällig am 20.06.2036	\$ 168	154	0,02	Venture CLO Ltd. 6,686 % fällig am 20.01.2029	\$ 819	821	0,11	
3,000 % fällig am 01.12.2026 - 01.04.2052	20.103	17.477	2,35	6,253 % fällig am 20.10.2027	1	1	0,00					
3,500 % fällig am 01.07.2047 - 01.12.2047	27.571	24.741	3,32	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 4,271 % fällig am 25.01.2035	95	93	0,01					
4,000 % fällig am 01.10.2047	18	17	0,00	Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,953 % fällig am 19.07.2035	13	12	0,00					
5,000 % fällig am 01.02.2025 - 01.08.2052	796	778	0,10	Towd Point Mortgage Funding PLC 6,583 % fällig am 20.07.2045	£ 2.021	2.556	0,34					
6,000 % fällig am 01.04.2035 - 01.01.2041	793	811	0,11	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 6,140 % fällig am 25.01.2045	\$ 380	359	0,05					
6,500 % fällig am 01.12.2035 - 01.01.2036	6	6	0,00	6,553 % fällig am 25.06.2042	4	3	0,00					
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				Warwick Finance Residential Mortgages PLC 6,184 % fällig am 21.12.2049	£ 759	963	0,13					
4,000 % fällig am 01.07.2054	19.600	17.936	2,41									
4,500 % fällig am 01.07.2054	42.600	40.166	5,40									
5,000 % fällig am 01.07.2054	70.800	68.434	9,19									
5,500 % fällig am 01.08.2054	6.300	6.213	0,84									
		272.383	36,59			23.967	3,22					
<b>US-SCHATZ Obligationen</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)				Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				STAAKSEMISSIONEN				
0,625 % fällig am 15.07.2032	5.611	5.034	0,68	6,480 % fällig am 25.10.2034	\$ 564	556	0,07	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.04.2025 (b)				
1,125 % fällig am 15.01.2033	5.262	4.871	0,65	Ares European CLO DAC 4,747 % fällig am 20.04.2032	€ 3.100	3.325	0,45	BRL	77.400	12.899	1,73	
U.S. Treasury Notes				Avoca CLO DAC 4,726 % fällig am 15.10.2032				Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,875 % fällig am 30.04.2029				
2,875 % fällig am 15.05.2032	1.800	1.622	0,22	Black Diamond CLO DAC 4,808 % fällig am 15.05.2032	3.000	3.221	0,43	\$	2.000	2.032	0,27	
4,375 % fällig am 15.08.2026	26.200	26.032	3,50	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 4,626 % fällig am 15.01.2031	2.382	2.551	0,34					
4,875 % fällig am 30.04.2026	4.600	4.607	0,62	BNPP AM Euro CLO DAC 4,717 % fällig am 22.07.2032	3.000	3.210	0,43					
4,875 % fällig am 31.05.2026	142.600	142.901	19,19	Bridgepoint CLO DAC 5,116 % fällig am 15.01.2034	3.399	3.656	0,49					
		185.067	24,86	Carbone CLO Ltd. 6,726 % fällig am 20.01.2031	\$ 2.595	2.598	0,35					
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Carlyle Euro CLO DAC 4,606 % fällig am 15.01.2031				Korea Housing Finance Corp. 4,875 % fällig am 27.08.2027				
Banc of America Mortgage Trust				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,578 % fällig am 15.11.2031				Republic of Poland Government International Bond 4,625 % fällig am 18.03.2029				
5,457 % fällig am 25.08.2034	146	141	0,02	Catamaran CLO Ltd. 6,686 % fällig am 22.04.2030	\$ 1.624	1.627	0,22	2.400	2.373	0,32		
6,650 % fällig am 25.07.2034	8	7	0,00	CBAM Ltd. 6,599 % fällig am 17.04.2031	407	407	0,05	17.703	2,38			
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. 6,510 % fällig am 25.11.2034				Summe kurzfristige Instrumente				
5,125 % fällig am 25.01.2035	6	5	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 5,099 % fällig am 25.01.2032	6	5	0,00	\$	1.397	1,397	0,19	
5,277 % fällig am 25.07.2034	98	89	0,01	Fortress Investment Group LLC 7,185 % fällig am 23.02.2039	5.115	5.063	0,68					
5,700 % fällig am 25.01.2034	6	6	0,00	GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,797 % fällig am 20.01.2032	€ 2.273	2.438	0,33					
Bear Stearns ALT-A Trust				Golub Capital Partners CLO Ltd. 6,641 % fällig am 25.10.2034				Summe Übertragbare Wertpapiere				
5,780 % fällig am 25.02.2034	37	34	0,01	Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd. 6,623 % fällig am 15.09.2037	228	228	0,03	\$	771.353	103,62		
5,990 % fällig am 25.12.2033	24	23	0,00	Griffith Park CLO DAC 4,550 % fällig am 21.11.2031	€ 2.754	2.940	0,39					
Benchmark Mortgage Trust				Jubilee CLO DAC 4,516 % fällig am 15.04.2030				AKTIEN				
3,965 % fällig am 10.04.2051	760	741	0,10	Madison Park Euro Funding DAC 4,656 % fällig am 15.01.2032	2.697	2.882	0,39	INVESTMENTFONDS				
Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.				Marble Point CLO Ltd. 6,769 % fällig am 18.12.2030				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
7,000 % fällig am 25.12.2018	1	1	0,00	Octagon Loan Funding Ltd. 6,767 % fällig am 18.11.2031	3.188	3.192	0,43	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (d)				
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.								PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)				
7,780 % fällig am 25.10.2035	13	12	0,00					131.665	1.312	0,18		
Countrywide Alternative Loan Trust								36.562				4,91
6,000 % fällig am 25.10.2033	9	8	0,00									
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust								BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
4,712 % fällig am 25.11.2034	26	24	0,00					PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)				
5,069 % fällig am 20.02.2035	5	5	0,00					362.860	36.306	4,88		
DBGS Mortgage Trust								Summe Investmentfonds				
6,221 % fällig am 15.06.2033	2.800	2.603	0,35					\$	72.868	9,79		
Eurosaill PLC												
6,303 % fällig am 13.06.2045	€ 2.981	3.766	0,51									
Formentera Issuer PLC												
6,033 % fällig am 28.07.2047	2.098	2.655	0,36									
Great Hall Mortgages PLC												
5,763 % fällig am 18.06.2039	\$ 158	157	0,02									
GSR Mortgage Loan Trust												
5,057 % fällig am 25.09.2035	65	60	0,01									
6,000 % fällig am 25.03.2032	0	0	0,00									
IndyMac Mortgage Loan Trust												
5,940 % fällig am 25.04.2035	248	193	0,03									
Morgan Stanley Capital Trust												
6,528 % fällig am 15.07.2035	4.260	4.257	0,57									
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust												
5,606 % fällig am 25.10.2034	215	198	0,03									

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	
								% des Netto- vermögens	
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 1.580	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (1.612)	\$ 1.580	\$ 1.580	0,21
SAL	5,340	28.06.2024	01.07.2024	18.800	U.S. Treasury Notes 5,000 % fällig am 30.09.2025	(19.411)	18.800	18.808	2,53
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (21.023)	\$ 20.380	\$ 20.388	2,74

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	91	\$ (99)	(0,01)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	16	23	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	629	336	0,04
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	733	520	0,07
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	517	(629)	(0,08)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	613	(915)	(0,12)
				\$ (764)	(0,10)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (764)	(0,10)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2024	\$ 1.000	\$ (18)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000 %	18.09.2029	£ 6.600	\$ (37)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,380	18.06.2028	¥ 90.000	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	\$ 2.900	(48)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	1.100	(19)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	1.200	(20)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,582	31.10.2030	9.000	268	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,623	31.10.2030	1.800	49	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,664	31.10.2030	1.200	30	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,677	31.10.2030	1.000	24	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,689	31.10.2030	4.000	94	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,691	31.10.2030	2.000	47	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,722	31.10.2030	3.900	84	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	31.10.2030	2.600	54	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,739	31.10.2030	1.400	29	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	8.400	40	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	1.800	(27)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,807	31.05.2028	1.300	19	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	22.02.2029	4.100	(40)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,970	27.02.2029	1.900	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.06.2026	56.100	(84)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.06.2026	190.400	359	0,05
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,095	18.02.2035	2.700	(52)	(0,01)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,500	13.09.2024	NZD 8.800	91	0,01
					\$ 844	0,11
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 826	0,11

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750 %	31.10.2024	22.700	\$ 19	\$ 38	0,01
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	10.10.2024	31.500	19	22	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,840	05.12.2024	18.900	0	17	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	09.12.2024	900	0	1	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	13.12.2024	6.300	0	8	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,920	03.12.2024	16.100	0	18	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	29.11.2024	21.700	0	24	0,01
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	11.12.2024	7.200	0	9	0,00
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	08.07.2025	90.200	108	124	0,02
							\$ 146	\$ 261	0,04

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700 %	04.07.2024	2.000	\$ (3)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	2.000	(3)	(1)	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	800	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	800	(3)	(4)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,885	10.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,235	10.07.2024	300	(1)	0	0,00
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689	15.07.2024	4.000	(8)	(2)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	4.000	(8)	(9)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	1.700	(6)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	2.600	(9)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	1.700	(6)	(11)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	2.600	(9)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,363	05.12.2024	2.100	0	(15)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,395	09.12.2024	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,425	13.12.2024	700	0	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	03.12.2024	1.800	0	(15)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,468	29.11.2024	2.400	0	(22)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,468	11.12.2024	800	0	(8)	0,00
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,850	05.07.2024	1.800	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	05.07.2024	1.800	(4)	(1)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,610	15.07.2024	700	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	15.07.2024	700	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,640	23.07.2024	500	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	900	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,990	23.07.2024	500	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	900	(4)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	1.400	(4)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	500	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	500	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	1.400	(4)	(6)	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
							\$ (95)	\$ (128)	(0,02)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprä- mien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 2.000	\$ (94)	\$ 88	\$ (6)	0,00
CBK	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.600	(270)	252	(18)	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.900	(108)	99	(9)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.300	(205)	176	(29)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.200	(195)	182	(13)	0,00
					\$ (872)	\$ 797	\$ (75)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	\$ 138	NZD 225	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	08.2024	NZD 225	\$ 138	1	0	1	0,00
BPS	07.2024	CAD 2.575	1.887	5	0	5	0,00
	07.2024	£ 13.076	16.703	174	0	174	0,02
	07.2024	¥ 24.100	153	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 761	¥ 118.300	0	(25)	(25)	0,00
BRC	07.2024	736	£ 579	0	(4)	(4)	0,00
	09.2024	MXN 1.183	\$ 63	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2024	\$ 2.821	BRL 15.192	0	(86)	(86)	(0,01)
	08.2024	BRL 13.109	\$ 2.398	46	0	46	0,01
DUB	07.2024	\$ 22	BRL 112	0	(2)	(2)	0,00
FAR	07.2024	€ 67.774	\$ 73.817	1.179	0	1.179	0,16
	07.2024	NZD 987	608	7	0	7	0,00
	07.2024	\$ 264	NZD 433	0	0	0	0,00
	08.2024	NZD 433	\$ 264	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	BRL 73.930	14.888	1.577	0	1.577	0,21
	07.2024	\$ 12.885	BRL 69.700	0	(336)	(336)	(0,05)
	07.2024	2.651	€ 2.470	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	ZAR 16.605	\$ 908	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 4.325	BRL 22.188	0	(344)	(344)	(0,05)
	10.2024	392	2.151	0	(9)	(9)	0,00
	04.2025	BRL 75.100	\$ 13.462	351	0	351	0,05
JPM	07.2024	13.175	2.426	54	0	54	0,01
	07.2024	\$ 385	BRL 2.100	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	1.819	€ 1.668	0	(31)	(31)	(0,01)
	07.2024	ZAR 31.453	\$ 1.709	0	(12)	(12)	0,00
	09.2024	\$ 2.426	BRL 13.262	0	(55)	(55)	(0,01)
	10.2024	CNH 476	\$ 67	1	0	1	0,00
	04.2025	BRL 2.300	409	8	0	8	0,00
MBC	07.2024	¥ 86.375	552	15	0	15	0,00
	07.2024	\$ 1.882	CAD 2.577	1	0	1	0,00
	08.2024	CAD 2.575	\$ 1.882	0	(1)	(1)	0,00
MYI	07.2024	€ 155	166	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 77	£ 61	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	15.847	12.497	0	(50)	(50)	(0,01)
	08.2024	£ 12.497	\$ 15.850	50	0	50	0,01
SCX	07.2024	\$ 72.884	€ 68.027	24	0	24	0,00
	08.2024	€ 68.027	\$ 72.991	0	(23)	(23)	0,00
SSB	07.2024	4.253	4.614	55	0	55	0,01
TOR	07.2024	\$ 201	NZD 328	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	NZD 328	\$ 201	1	0	1	0,00
UAG	07.2024	\$ 48	ILS 178	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 3.552	\$ (993)	\$ 2.559	0,34

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 10	\$ 11	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 14.463	€ 13.322	0	(187)	(187)	(0,02)
BPS	07.2024	€ 12.556	\$ 13.430	0	(27)	(27)	0,00
	07.2024	\$ 12.690	€ 11.722	0	(127)	(127)	(0,02)
	08.2024	13.431	12.539	27	0	27	0,00
BRC	07.2024	€ 1	\$ 1	0	0	0	0,00
FAR	07.2024	\$ 14.054	€ 12.904	0	(224)	(224)	(0,03)
JPM	07.2024	19	18	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	€ 12.727	\$ 13.610	0	(31)	(31)	0,00
	07.2024	\$ 8	€ 8	0	0	0	0,00
	08.2024	13.593	12.694	32	0	32	0,00
RBC	07.2024	€ 65	\$ 71	1	0	1	0,00
SCX	07.2024	12.687	13.592	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	\$ 4	€ 4	0	0	0	0,00
	08.2024	13.612	12.687	4	0	4	0,00
SSB	07.2024	75	69	0	(1)	(1)	0,00
UAG	08.2024	18	17	0	0	0	0,00
				\$ 64	\$ (601)	\$ (537)	(0,07)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 12.018	\$ 15.196	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
	07.2024	\$ 21.820	£ 17.125	0	(173)	(173)	(0,02)
	08.2024	15.199	12.018	0	(5)	(5)	0,00
BRC	07.2024	7	5	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	£ 8	\$ 11	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2.025	£ 1.590	0	(15)	(15)	0,00
DUB	07.2024	10.980	8.605	0	(102)	(102)	(0,01)
MBC	07.2024	£ 12.259	\$ 15.510	14	0	14	0,00
	07.2024	\$ 3.360	£ 2.655	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	15.365	12.142	0	(13)	(13)	0,00
RBC	07.2024	£ 12.132	\$ 15.385	48	0	48	0,01
	08.2024	\$ 15.387	£ 12.132	0	(48)	(48)	(0,01)
RYL	07.2024	2.601	2.033	0	(32)	(32)	(0,01)
SCX	07.2024	5.598	4.403	0	(32)	(32)	(0,01)
				\$ 67	\$ (423)	\$ (356)	(0,05)
Summe Freiverkehrsfondsderivate						\$ 1.724	0,23

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % fällig am 01.08.2054	\$ 24.500	\$ (20.863)	(2,80)
3,500 % fällig am 01.08.2054	31.000	(27.445)	(3,69)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (48.308)	(6,49)
Summe Anlagen		\$ 818.079	109,90
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (73.671)	(9,90)
Nettovermögen		\$ 744.408	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Reines Kapitalwertpapier.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (d) Mit dem Fonds verbunden.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 271.704 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 43.703 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 5 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 6.633 USD (31. Dezember 2023: 5.856 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2023: 1.641 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 770.951	\$ 402	\$ 771.353
Investmentfonds	72.868	0	0	72.868
Pensionsgeschäfte	0	20.380	0	20.380
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(76)	1.862	0	1.786
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(48.308)	0	(48.308)
Summen	\$ 72.792	\$ 744.885	\$ 402	\$ 818.079

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.099.282	\$ 492	\$ 1.099.774
Investmentfonds	34.262	48.331	0	82.593
Pensionsgeschäfte	0	100.744	0	100.744
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(500)	(3.709)	0	(4.209)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(50.185)	0	(50.185)
<b>Summen</b>	<b>\$ 33.762</b>	<b>\$ 1.194.463</b>	<b>\$ 492</b>	<b>\$ 1.228.717</b>

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (193)	\$ 0	\$ (193)	\$ 66	\$ 0	\$ 66
BPS	(143)	0	(143)	(24)	0	(24)
BRC	(6)	0	(6)	(6)	0	(6)
CBK	(79)	0	(79)	(47)	0	(47)
DUB	(66)	0	(66)	74	0	74
FAR	961	(1.060)	(99)	(9)	0	(9)
GLM	1.237	(980)	257	(636)	501	(135)
JPM	(50)	0	(50)	24	0	24
MBC	14	0	14	(173)	30	(143)
MYC	60	0	60	(37)	260	223
MYI	k. A.	k. A.	k. A.	268	(390)	(122)
RBC	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(32)	0	(32)	10	0	10
SCX	(31)	0	(31)	77	(110)	(33)
SSB	54	0	54	72	0	72
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	71	0	71
UAG	(1)	0	(1)	(354)	850	496
ULO	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	52,40	84,32
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	50,89	51,48
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,33	k. A.
Investmentfonds	9,79	10,20
Pensionsgeschäfte	2,74	12,44
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,10)	(0,42)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,11	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,23	(0,08)
Leerverkaufte Wertpapiere	(6,49)	(6,20)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(64,90)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(5,47)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	27,76	26,24
US-Regierungsbehörden	36,59	34,15
US-Schatzobligationen	24,86	56,55
Non-Agency-MBS	3,22	5,49
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,62	11,00
Staatsemissionen	2,38	2,37
Kurzfristige Instrumente	0,19	k. A.
Investmentfonds	9,79	10,20
Pensionsgeschäfte	2,74	12,44
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,10)	(0,42)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,11	(0,02)

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswaptionen	0,04	k. A.
Verkaufsoptionen		
Zinsswaptionen	(0,02)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	0,34	(0,15)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,12)	0,08
Leerverkaufte Wertpapiere	(6,49)	(6,20)
Sonstige Aktiva und Passiva	(9,90)	(51,72)
Nettovermögen	100,00	100,00









BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ElectraNet Pty. Ltd. 2,474 % fällig am 15.12.2028	AUD 700	\$ 409	0,04	Tallgrass Energy Partners LP 7,375 % fällig am 15.02.2029	\$ 300	\$ 302	0,03	Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % fällig am 05.05.2026	\$ 2.000	\$ 1.993	0,22
Electricite de France S.A. 3,750 % fällig am 05.06.2027	€ 3.200	3.445	0,38	Tampa Electric Co. 3,875 % fällig am 12.07.2024	800	800	0,09	CDP Financial, Inc. 4,250 % fällig am 25.07.2028	2.000	1.968	0,21
EnBW International Finance BV 2,500 % fällig am 04.06.2026	300	316	0,03	TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	€ 2.000	2.187	0,24	CPPIB Capital, Inc. 4,250 % fällig am 20.07.2028	1.050	1.035	0,11
3,625 % fällig am 22.11.2026	2.000	2.157	0,24	5,186 % fällig am 02.08.2029	1.000	1.089	0,12	Europäische Union 2,000 % fällig am 04.10.2027	€ 12.200	12.692	1,38
Enel Finance America LLC 7,100 % fällig am 14.10.2027	\$ 200	210	0,02	Teollisuuden Voima Oyj 1,125 % fällig am 09.03.2026	300	307	0,03	Hungary Government International Bond 4,000 % fällig am 25.07.2029	1.100	1.170	0,13
Enel Finance International NV 1,375 % fällig am 12.07.2026	1.400	1.297	0,14	Trans-Allegheny Interstate Line Co. 3,850 % fällig am 01.06.2025	\$ 1.305	1.281	0,14	Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	800	871	0,09
2,650 % fällig am 10.09.2024	1.200	1.192	0,13	Verizon Communications, Inc. 2,100 % fällig am 22.03.2028	400	360	0,04	5,375 % fällig am 12.03.2029	\$ 1.800	1.768	0,19
5,125 % fällig am 26.06.2029	3.200	3.151	0,34	3,550 % fällig am 15.07.2024	3.825	3.820	0,42	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % fällig am 01.04.2026 (b)	€ 2.700	2.728	0,30
EP Infrastructure A/S 1,698 % fällig am 30.07.2026	€ 2.000	1.985	0,22	Vistra Operations Co. LLC 3,550 % fällig am 15.07.2024	3.825	3.820	0,42	Korea Gas Corp. 5,000 % fällig am 08.07.2029 (a)	\$ 600	599	0,06
ETSA Utilities Finance Pty. Ltd. 5,108 % fällig am 03.06.2027	AUD 2.600	1.735	0,19	WEC Energy Group, Inc. 4,750 % fällig am 09.01.2026	1.500	1.484	0,16	Korea Housing Finance Corp. 3,124 % fällig am 18.03.2029	€ 1.300	1.384	0,15
Eurogrid GmbH 3,598 % fällig am 01.02.2029	€ 500	534	0,06	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		758.217	82,50	Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026 (c)	MXN 130.051	6.578	0,72
Evergy Missouri West, Inc. 5,150 % fällig am 15.12.2027	\$ 2.000	1.988	0,22	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Spain Government International Bond 0,000 % fällig am 31.01.2028 (b)	€ 4.100	3.948	0,43
Eversource Energy 5,450 % fällig am 01.03.2028	1.200	1.204	0,13	State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020	1.200	1.152	0,13	United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 31.01.2029	£ 4.000	4.316	0,47
Florida Power & Light Co. 5,150 % fällig am 15.06.2029	500	504	0,06	1,258 % fällig am 01.07.2025	1.200	1.152	0,13	1,625 % fällig am 22.10.2028	7.200	8.255	0,90
Georgia Power Co. 6,114 % fällig am 08.05.2025	200	201	0,02	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				Summe		78.119	8,50
ITC Holdings Corp. 4,950 % fällig am 22.09.2027	850	842	0,09	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2049	10.888	10.196	1,11	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
KeySpan Gas East Corp. 2,742 % fällig am 15.08.2026	1.600	1.509	0,16	4,500 % fällig am 01.08.2052	5.056	4.776	0,52	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
Lorca Telecom Bondco S.A. 4,000 % fällig am 18.09.2027	€ 600	628	0,07	5,000 % fällig am 01.02.2053	3.562	3.447	0,38	Yango Justice International Ltd. 5,300 % fällig am 11.01.2022 ^	\$ 200	3	0,00
5,750 % fällig am 30.04.2029	1.200	1.320	0,14	5,500 % fällig am 01.03.2054	20.251	19.983	2,17	Summe kurzfristige Instrumente		3	0,00
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. 5,687 % fällig am 18.10.2024	\$ 975	975	0,11	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2054	6.800	6.019	0,65	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 982.424	106,90	
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD 2.500	1.556	0,17	4,000 % fällig am 01.07.2054	34.000	31.114	3,39	<b>AKTIEN</b>			
NGPL PipeCo LLC 4,875 % fällig am 15.08.2027	\$ 3.170	3.102	0,34	5,000 % fällig am 01.07.2054	600	580	0,06	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Niagara Mohawk Power Corp. 3,508 % fällig am 01.10.2024	1.000	993	0,11	5,500 % fällig am 01.08.2054	8.900	8.777	0,95	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Pacific Gas & Electric Co. 3,150 % fällig am 01.01.2026	1.000	964	0,11	6,000 % fällig am 01.08.2054	10.600	10.626	1,16	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	569.983	5.680	0,62
3,300 % fällig am 01.12.2027	1.500	1.399	0,15	6,500 % fällig am 01.08.2054	1.900	1.933	0,21	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)	5.163	71	0,01
3,400 % fällig am 15.08.2024	100	100	0,01	97,451	10,60			Summe Investmentfonds	\$ 5.751	0,63	
3,450 % fällig am 01.07.2025	100	98	0,01	<b>US-SCHATZobligationen</b>							
3,500 % fällig am 15.06.2025	1.700	1.663	0,18	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c) 2,125 % fällig am 15.04.2029	10.116	10.130	1,10				
4,950 % fällig am 08.06.2025	2.000	1.983	0,22	2,375 % fällig am 15.01.2025	1.663	1.648	0,18				
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				3,875 % fällig am 15.04.2029	24.410	26.375	2,87				
4,125 % fällig am 15.05.2027	1.200	1.158	0,13			38.153	4,15				
Pinnacle West Capital Corp. 6,191 % fällig am 10.06.2026	1.500	1.500	0,16	<b>NON-AGENCY-MBS</b>							
Public Service Enterprise Group, Inc. 5,875 % fällig am 15.10.2028	1.400	1.433	0,16	GSR Mortgage Loan Trust 5,057 % fällig am 25.09.2035	2	1	0,00				
San Diego Gas & Electric Co. 2,500 % fällig am 15.05.2026	226	215	0,02	Jubilee Place BV 4,519 % fällig am 17.09.2060	€ 3.920	4.218	0,46				
Sempra 3,300 % fällig am 01.04.2025	2.100	2.063	0,22	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 6,027 % fällig am 25.11.2034	\$ 2	2	0,00				
Southern California Edison Co. 0,975 % fällig am 01.08.2024	800	797	0,09	6,251 % fällig am 25.09.2034	216	208	0,02				
4,200 % fällig am 01.06.2025	2.200	2.172	0,24	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 6,283 % fällig am 25.01.2033	3	3	0,00				
5,300 % fällig am 01.03.2028	1.500	1.503	0,16	6,403 % fällig am 25.01.2047	157	137	0,02				
5,350 % fällig am 01.03.2026	800	799	0,09			4.569	0,50				
5,850 % fällig am 01.11.2027	100	102	0,01	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>							
Southern Power Co. 0,900 % fällig am 15.01.2026	3.000	2.797	0,30	Bumper NL BV 4,268 % fällig am 22.03.2035	€ 4.000	4.302	0,47				
Southern Water Services Finance Ltd. 1,625 % fällig am 30.03.2027	£ 1.500	1.633	0,18	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 6,080 % fällig am 25.12.2035	\$ 223	216	0,02				
Spire, Inc. 5,300 % fällig am 01.03.2026	\$ 2.000	1.996	0,22			4.518	0,49				
System Energy Resources, Inc. 2,140 % fällig am 09.12.2025	1.150	1.088	0,12	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
				Australia Government International Bond 2,750 % fällig am 21.11.2028	AUD 41.600	26.335	2,87				
				Belgium Government International Bond 0,800 % fällig am 22.06.2028	€ 2.500	2.479	0,27				

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

## PENSIONS GESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>			% des Nettover- mögens
							Pensions- geschäfte, zum Wert	Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>		
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 527	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (538)	\$ 527	\$ 527	0,06	
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (538)	\$ 527	\$ 527	0,06	

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2024	8	\$ 10	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	149	(74)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	278	140	0,02
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	222	(192)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	96	(84)	(0,01)
				\$ (200)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (200)	(0,02)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus SE	1,000 %	20.06.2029	€ 1.500	\$ 1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2024	\$ 1.300	(15)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	200	(2)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	1.200	32	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2024	1.500	41	0,01
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	1.300	3	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	1.200	66	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	3.700	11	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	400	3	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	80	(6)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	95	3	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2028	€ 500	4	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2028	400	11	0,00
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 300	(4)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 2.200	19	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	500	15	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	\$ 200	6	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	1.800	34	0,01
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	500	10	0,00
				\$ 232	0,03

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 100	\$ 1	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	600	4	0,00
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000	20.12.2028	2.700	27	0,00
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	43.000	(51)	(0,01)
iTraxx Crossover 41 5-Year Index	5,000	20.06.2029	€ 500	(8)	0,00
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	1,000	20.06.2029	7.500	(31)	0,00
				\$ (58)	(0,01)

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		4,000 %	18.09.2029	£ 6.600	\$ (23)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		3,750	20.06.2028	\$ 29.000	140	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS		4,500	18.07.2024	19.000	(19)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,815 %	04.01.2027	BRL 21.400	\$ (150)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,832	04.01.2027	19.500	(135)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,835	04.01.2027	33.900	(234)	(0,03)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Year BRL-CDI	9,842	04.01.2027	4.800	(33)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	18.12.2025	CAD 23.100	(52)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.09.2025	34.300	378	0,04
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	13.500	140	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 1.700	(20)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	4.400	(294)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	3.200	(192)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	36.100	(592)	(0,06)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026	20.600	(155)	(0,02)
					<b>\$ (1.241)</b>	<b>(0,14)</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (1.067)</b>	<b>(0,12)</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprä- mien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 100	\$ (3)	\$ 3	\$ 0	0,00
GST	AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	800	(9)	22	13	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	700	(16)	18	2	0,00
					<b>\$ (28)</b>	<b>\$ 43</b>	<b>\$ 15</b>	<b>0,00</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AZD	07.2024	AUD	47.037	\$ 31.339	\$ 0	\$ (75)	(0,01)
	07.2024	NZD	521	319	2	2	0,00
	08.2024	\$	319	NZD 521	0	(2)	0,00
BOA	07.2024	€	231.278	\$ 251.101	3.226	0	3,226
	07.2024	SGD	27	20	0	0	0,00
	07.2024	\$	20	SGD 27	0	0	0,00
BPS	08.2024	SGD	27	20	0	0	0,00
	07.2024	€	4.704	5.093	51	0	51
	07.2024	£	38.767	49.521	516	0	516
BRC	07.2024	IDR	34.994.088	2.136	0	(3)	(3)
	07.2024	KRW	4.652.644	3.376	0	(2)	(2)
	07.2024	TWD	66.716	2.062	6	0	6
	07.2024	\$	36.539	AUD 54.838	85	0	85
	07.2024		600	€ 558	0	(2)	(2)
	07.2024		250	IDR 4.096.598	0	0	0
	07.2024		335	INR 28.032	1	0	1
	07.2024		1.746	SGD 2.368	1	0	1
	08.2024	AUD	54.838	\$ 36.570	0	(84)	(84)
	08.2024	SGD	2.364	1.746	0	(1)	(1)
BRC	10.2024	CNH	16.562	2.303	15	0	15
	07.2024	MXN	362	20	0	0	0,00
	07.2024	SGD	2.368	1.753	6	0	6
	07.2024	\$	76	NOK 800	0	(1)	(1)
	07.2024		3.748	PLN 14.972	0	(24)	(24)
	07.2024		383	TRY 13.273	14	0	14
	08.2024		995	34.685	6	0	6
09.2024	MXN	131.559	\$ 7.023	0	(86)	(86)	

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	09.2024	\$ 2.082	MXN 39.633	\$ 60	\$ 0	\$ 60	0,01
	07.2024	AUD 2.239	\$ 1.491	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	€ 1.482	\$ 1.614	26	0	26	0,00
	07.2024	\$ 2.485	€ 2.316	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	368	TRY 12.409	2	0	2	0,00
DUB	09.2024	1.285	INR 107.412	2	(1)	1	0,00
	10.2024	CNH 40.369	\$ 5.607	31	0	31	0,00
	07.2024	AUD 3.639	2.408	0	(22)	(22)	0,00
	08.2024	\$ 1.734	BRL 9.230	0	(76)	(76)	(0,01)
	07.2024	NZD 1.002	\$ 611	1	0	1	0,00
FAR	07.2024	\$ 1.193	MXN 21.295	0	(30)	(30)	0,00
	08.2024	611	NZD 1.002	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	€ 1.108	\$ 1.200	12	0	12	0,00
	07.2024	KRW 427.268	310	0	0	0	0,00
	07.2024	TWD 15.356	475	2	0	2	0,00
JPM	07.2024	\$ 1.193	MXN 21.302	0	(30)	(30)	0,00
	08.2024	306	TRY 10.574	2	0	2	0,00
	07.2024	CAD 5.455	\$ 3.970	0	(17)	(17)	0,00
	07.2024	ILS 185	50	1	0	1	0,00
	07.2024	KRW 426.132	309	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	TWD 22.117	684	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 3.652	CHF 3.277	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	2.526	€ 2.361	4	0	4	0,00
	07.2024	2.182	IDR 35.387.744	0	(19)	(19)	0,00
	07.2024	141	INR 11.803	1	0	1	0,00
MBC	07.2024	803	TRY 27.328	22	0	22	0,00
	08.2024	CHF 3.265	\$ 3.652	5	0	5	0,00
	08.2024	\$ 1.977	TRY 69.065	28	0	28	0,00
	09.2024	175	INR 14.651	0	0	0	0,00
	07.2024	AUD 1.923	\$ 1.278	0	(7)	(7)	0,00
MYI	07.2024	CAD 13.113	9.630	47	0	47	0,01
	07.2024	€ 6.844	7.393	58	0	58	0,01
	07.2024	NOK 622	58	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 13.570	CAD 18.579	8	0	8	0,00
	07.2024	2.006	£ 1.573	0	(18)	(18)	0,00
RBC	07.2024	176	INR 14.754	1	0	1	0,00
	08.2024	CAD 18.567	\$ 13.570	0	(9)	(9)	0,00
	08.2024	\$ 58	NOK 622	0	0	0	0,00
	07.2024	CHF 3.279	\$ 3.664	15	0	15	0,00
	07.2024	€ 183	195	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2024	£ 86	109	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 178	17	0	0	0	0,00
	07.2024	TWD 24.372	753	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 326	€ 304	0	0	0	0,00
	07.2024	21	£ 17	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	4.898	INR 409.957	19	0	19	0,00
	07.2024	1.400	NZD 2.282	0	(9)	(9)	0,00
	08.2024	17	NOK 178	0	0	0	0,00
	09.2024	117	INR 9.779	0	0	0	0,00
	09.2024	885	MXN 16.643	14	0	14	0,00
RYL	07.2024	€ 2.046	\$ 2.222	30	0	30	0,00
	07.2024	\$ 47.166	£ 37.194	0	(149)	(149)	(0,02)
	08.2024	£ 37.194	\$ 47.174	148	0	148	0,02
	07.2024	\$ 948	€ 886	2	0	2	0,00
	07.2024	€ 333	\$ 358	1	0	1	0,00
BRC	07.2024	IDR 164.120	10	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 2.140.729	1.554	0	0	0	0,00
	07.2024	TWD 50.992	1.576	5	0	5	0,00
	07.2024	\$ 258.930	€ 241.674	85	0	85	0,01
	07.2024	7	MXN 132	0	0	0	0,00
BOA	07.2024	3.755	ZAR 69.199	30	0	30	0,00
	08.2024	€ 241.674	\$ 259.310	1	(82)	(82)	(0,01)
	09.2024	\$ 793	INR 66.387	1	0	1	0,00
	07.2024	NZD 759	\$ 465	2	0	2	0,00
	08.2024	\$ 465	NZD 759	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 4.598	\$ (765)	\$ 3.833	0,42

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 13	\$ 14	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 208.481	€ 192.027	0	(2.676)	(2.676)	(0,29)
BPS	07.2024	€ 180.713	\$ 193.313	19	(386)	(367)	(0,04)
	07.2024	\$ 196.792	€ 181.777	0	(1.973)	(1.973)	(0,22)
BRC	08.2024	192.337	179.559	387	0	387	0,04
	07.2024	€ 346	\$ 370	0	(1)	(1)	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	07.2024	\$ 185.908	€ 171.676	\$ 0	\$ (1.914)	\$ (1.914)	(0,21)
CBK	07.2024	€ 185	\$ 199	1	0	1	0,00
GLM	07.2024	\$ 120	€ 111	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2024	62	58	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	€ 183.182	\$ 195.883	5	(448)	(443)	(0,05)
	07.2024	\$ 72	€ 67	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 195.785	\$ 182.829	449	0	449	0,05
MYI	07.2024	€ 108	\$ 115	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	\$ 187	€ 173	0	(2)	(2)	0,00
RYL	07.2024	222	208	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	€ 182.933	\$ 195.994	0	(64)	(64)	(0,01)
	08.2024	\$ 196.174	€ 182.832	62	0	62	0,01
SSB	07.2024	1.501	1.384	0	(18)	(18)	0,00
UAG	08.2024	196	183	0	0	0	0,00
				\$ 923	\$ (7.483)	\$ (6.560)	(0,72)

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	07.2024	£ 6.530	\$ 8.257	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2024	\$ 15.908	£ 12.484	0	(127)	(127)	(0,01)
	08.2024	8.259	6.530	0	(3)	(3)	0,00
BRC	07.2024	71	55	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2024	£ 19	\$ 24	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 517	£ 406	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	£ 1	\$ 2	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	\$ 8.216	£ 6.439	0	(77)	(77)	(0,01)
MBC	07.2024	£ 6.639	\$ 8.399	7	0	7	0,00
	07.2024	\$ 190	£ 149	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	8.397	6.636	0	(7)	(7)	0,00
RBC	07.2024	£ 6.634	\$ 8.413	27	0	27	0,00
	08.2024	\$ 8.414	£ 6.634	0	(26)	(26)	0,00
RYL	07.2024	368	287	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 37	\$ (249)	\$ (212)	(0,02)

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BRC	07.2024	\$ 865	NOK 9.105	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
CBK	07.2024	863	9.097	0	(9)	(9)	0,00
MBC	07.2024	NOK 6.597	\$ 619	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 605	NOK 6.438	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	NOK 8.240	\$ 773	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 800	NOK 8.434	0	(8)	(8)	0,00
	08.2024	773	8.233	1	0	1	0,00
RYL	07.2024	NOK 2.316	\$ 217	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1	\$ (29)	\$ (28)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklasse Institutional SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
CBK	07.2024	\$ 10.124	SEK 107.488	\$ 25	\$ 0	\$ 25	0,00
DUB	07.2024	SEK 107.614	\$ 10.168	6	0	6	0,00
	08.2024	\$ 10.168	SEK 107.449	0	(6)	(6)	0,00
MBC	07.2024	9.824	103.167	0	(82)	(82)	(0,01)
MYI	07.2024	SEK 108.018	\$ 10.227	27	0	27	0,00
	08.2024	\$ 10.227	SEK 107.851	0	(27)	(27)	0,00
RYL	07.2024	9.809	103.141	0	(70)	(70)	(0,01)
				\$ 58	\$ (185)	\$ (127)	(0,02)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (3.079) (0,34)

Summe Anlagen

\$ 984.356 107,11

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (65.315) (7,11)

Nettovermogen

\$ 919.041 100,00

## ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 28.304 USD (31. Dezember 2023: 6.858 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 4.780 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 8.808 USD (31. Dezember 2023: 9.560 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.040 USD (31. Dezember 2023: 1.630 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 982.101	\$ 323	\$ 982.424
Investmentfonds	5.751	0	0	5.751
Pensionsgeschäfte	0	527	0	527
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(64)	(4.282)	0	(4.346)
<b>Summen</b>	<b>\$ 5.687</b>	<b>\$ 978.346</b>	<b>\$ 323</b>	<b>\$ 984.356</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.023.969	\$ 116	\$ 1.024.085
Investmentfonds	16.247	0	0	16.247
Pensionsgeschäfte	0	678	0	678
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	96	2.924	0	3.020
<b>Summen</b>	<b>\$ 16.343</b>	<b>\$ 1.027.571</b>	<b>\$ 116</b>	<b>\$ 1.044.030</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkei- ten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,570 %	26.06.2024	03.07.2024	\$ (16.560)	\$ (16.573)	(1,80)
BPS	5,420	27.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(3.085)	(3.085)	(0,34)
SOG	5,590	27.06.2024	11.07.2024	(8.031)	(8.036)	(0,87)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (27.694)</b>	<b>(3,01)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (75)	\$ 0	\$ (75)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	550	(600)	(50)	140	0	140
BPS	(1.497)	1.630	133	399	(1.610)	(1.211)
BRC	(1.951)	2.410	459	(182)	370	188
CBK	67	(280)	(213)	151	(260)	(109)
DUB	(175)	0	(175)	286	(260)	26
FAR	(30)	0	(30)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(15)	0	(15)	(1.215)	1260	45
GST	13	0	13	8	0	8
JPM	24	0	24	7	0	7
MBC	3	(80)	(77)	(98)	0	(98)
MYI	32	0	32	37	(10)	27
RBC	28	0	28	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(73)	0	(73)	(7)	0	(7)
SCX	38	0	38	405	(590)	(185)
SSB	(18)	0	(18)	62	0	62
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	59	0	59
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	812	(1.850)	(1.038)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	74,47	75,46
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	29,77	29,48
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,66	0,33
Investmentfonds	0,63	1,67
Pensionsgeschäfte	0,06	0,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	(0,11)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,12)	0,33
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,34)	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(3,01)	(0,72)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,50)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,03	0,02
Unternehmensanleihen und Wechsel	82,50	83,56
Kommunalanleihen und Wechsel	0,13	0,12
US-Regierungsbehörden	10,60	8,58
US-Schatzobligationen	4,15	3,50
Non-Agency-MBS	0,50	0,04
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,49	0,59
Staatsemissionen	8,50	8,55
Stammaktien	k. A.	0,00
Optionsscheine	k. A.	0,00
Kurzfristige Instrumente	0,00	0,31
Investmentfonds	0,63	1,67
Pensionsgeschäfte	0,06	0,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,02)	(0,11)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,01)	0,05
Zinsswaps	(0,14)	0,25
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,42	(0,33)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,76)	0,42
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,11)	(7,32)
Nettovermögen	100,00	100,00









## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	
								Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover-mögens
BOS	5,390 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 16.500	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	\$ (16.478)	\$ 16.500	\$ 16.507	0,72
CEW	4,720	24.06.2024	02.07.2024	CAD 30.000	Province of Quebec 1,500 % fällig am 01.09.2031	(22.206)	21.924	21.944	0,95
	4,720	25.06.2024	03.07.2024	50.000	Province of Ontario 2,600 % fällig am 02.06.2027	(37.356)	36.541	36.569	1,60
	4,720	28.06.2024	08.07.2024	40.000	Province of Ontario 1,900 % fällig am 02.12.2051	(22.520)	29.232	29.244	1,27
					Province of Quebec 4,250 % fällig am 01.12.2043	(7.177)			
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	\$ 1.557	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(1.588)	1.557	1.557	0,07
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (107.325)	\$ 105.754	\$ 105.821	4,61

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	22	\$ 144	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	23	105	0,00
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	29	213	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	22	118	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	20	118	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	21	89	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	26	184	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	17	83	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	56	(103)	(0,01)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	232	(50)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	1.088	603	0,03
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	72	60	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	141	(121)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	478	(294)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	82	(49)	0,00
				\$ 1.100	0,05

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 109,000	26.07.2024	10	\$ (3)	\$ (4)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	112,000	26.07.2024	10	(3)	(1)	0,00
				\$ (6)	\$ (5)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 1.095	0,05

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 7.600	\$ 177	0,01
Airbus Finance BV	1,000	20.06.2026	3.100	(37)	0,00
Airbus Finance BV	1,000	20.06.2028	200	0	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2025	\$ 700	22	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.500	(10)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	1.500	(5)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	600	13	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	2.600	(180)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	100	1	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	100	4	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	200	12	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	€ 4.700	46	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	€ 2.400	293	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2027	1.100	121	0,01

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Verizon Communications, Inc.	1,000 %	20.12.2024	\$ 2.200	\$ 2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	3.000	(30)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	400	(4)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	3.400	66	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	900	18	0,00
				\$ 509	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000 %	20.12.2024	\$ 510	\$ 23	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	1.196	35	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	9.108	365	0,02
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	800	57	0,01
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	500	25	0,00
CDX.EM-40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	3.000	68	0,01
CDX.EM-41 5-Year Index	1,000	20.06.2029	1.700	8	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	5.723	(169)	(0,01)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	2.231	32	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	490	23	0,00
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	297	19	0,00
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	15.345	959	0,04
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000	20.06.2029	30.000	(126)	(0,01)
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	2.100	(3)	0,00
				\$ 1.316	0,06

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,060 %	21.02.2052	£ 300	\$ (185)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,096	14.02.2052	600	(365)	(0,02)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101	21.02.2052	300	(182)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	600	(354)	(0,02)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,700	28.03.2034	1.400	39	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	1.800	105	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	84.800	(926)	(0,04)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	¥ 8.473.000	1.075	0,05
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	550.000	(32)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	1.467.200	352	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	702.000	428	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,700	18.09.2029	1.433.000	(5)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	130.000	95	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	18.09.2034	738.000	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	\$ 88.900	5.413	0,24
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	10.869	(1.021)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,928	06.05.2026	2.200	173	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,940	08.06.2026	2.900	219	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	3.600	193	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	4.070	328	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	20.713	4.424	0,19
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,030	17.06.2026	3.600	265	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,235	12.05.2028	1.100	134	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	4.400	490	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	22.690	(2.408)	(0,11)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.12.2050	12.600	4.685	0,20
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	8.700	2.681	0,12
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,317	16.12.2050	400	(175)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	6.700	563	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	1.400	258	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	900	165	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	3.600	(300)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,418	20.01.2027	1.300	(106)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	2.500	(203)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,438	22.01.2051	9.000	(3.848)	(0,17)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	6.300	514	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	2.000	361	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	7.919	(1.109)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	1.200	129	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	17.06.2050	7.700	4.355	0,19
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	800	(96)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,570	12.01.2027	1.400	(109)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	2.800	(210)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,580	13.01.2051	9.300	(3.820)	(0,17)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	17.200	890	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	15.02.2027	26.800	(1.978)	(0,09)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,625 %	06.01.2030	\$ 300	\$ 46	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	1.300	(149)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	25.000	(1.769)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	1.600	(250)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2025	38.000	167	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	3.538	151	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.01.2030	4.600	655	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.608	86	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	28.100	6.139	0,27
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	600	(91)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	2.100	(150)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	1.100	434	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	2.300	(162)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	300	(112)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	300	(109)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,910	17.10.2049	400	152	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,988	09.02.2032	1.100	156	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	2.100	38	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	10.12.2029	21.000	2.649	0,11
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	11.170	193	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	12.02.2030	2.500	332	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	10.03.2030	1.200	138	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	17.930	844	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,008	09.02.2032	1.900	270	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,250	12.03.2050	15.700	4.688	0,20
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	12.300	625	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	21.900	657	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	1.400	138	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,436	08.06.2032	6.800	651	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	43.700	1.295	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	5.430	422	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,451	08.06.2032	8.700	825	0,04
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,468	27.07.2028	1.500	(100)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,537	24.07.2053	400	(67)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,550	21.07.2053	400	(67)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,675	24.07.2028	1.500	(87)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,690	04.04.2025	2.100	(37)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,697	04.04.2025	12.300	(213)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,700	21.07.2028	1.500	(86)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,721	10.04.2025	4.100	(71)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,765	27.07.2024	6.900	(148)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,790	10.04.2025	3.300	(54)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	3.800	(73)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	15.500	(828)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	3.700	(69)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	9.600	(186)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	3.900	(71)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	4.400	(80)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	19.06.2026	12.700	931	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	85.750	4.386	0,19
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	7.110	445	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	270	(14)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	3.900	(70)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	21.07.2024	6.900	(129)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	1.400	(72)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	2.000	(150)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,052	24.07.2024	6.900	(127)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	1.200	(142)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	3.800	(62)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	3.900	(63)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	3.900	(61)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	3.900	(60)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	43.820	1.463	0,06
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	2.000	(104)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	500	30	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	2.000	(91)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	12.07.2053	2.800	(231)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	3.200	(140)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	2.100	(91)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	7.600	(291)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	2.100	(88)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	3.900	(157)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2026	6.720	154	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	45.820	1.294	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	29.710	433	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	8.100	(247)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	2.500	48	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	19.500	(735)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,545	31.10.2030	4.100	131	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,550	31.10.2030	8.300	262	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,555	05.03.2054	1.300	(42)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,572	31.10.2030	9.000	273	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Varibler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,582 %	31.10.2030	\$ 16.400	\$ 488	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,594	09.01.2034	2.800	105	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,600	17.01.2034	1.400	58	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,601	31.10.2030	8.300	238	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,602	31.10.2030	27.100	773	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,606	31.10.2030	8.400	238	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	1.100	44	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,623	31.10.2030	9.000	246	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,648	08.01.2034	2.700	102	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	7.200	(103)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	6.000	(88)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	10.07.2033	4.600	(175)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.03.2034	3.400	(89)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,664	31.10.2030	7.300	182	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,665	24.01.2034	2.600	(70)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,670	08.01.2034	2.900	104	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,677	31.10.2030	5.900	143	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	1.300	45	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,685	24.01.2034	2.600	(65)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,687	31.10.2030	7.600	179	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,691	31.10.2030	11.600	271	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	66.350	1.911	0,08
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,710	05.03.2034	3.300	(71)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,721	31.10.2030	7.300	157	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,722	31.10.2030	7.300	157	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,725	07.02.2034	1.500	(30)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,727	31.10.2030	7.300	155	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	1.400	(42)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,732	31.10.2030	4.900	103	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	31.10.2030	7.300	151	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	1.600	(46)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	23.01.2034	1.300	(27)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,738	23.01.2034	800	(17)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,739	31.10.2030	7.300	150	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,749	31.10.2030	7.300	145	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	7.200	(95)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	6.100	(83)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	51.850	1.221	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	119.910	1.201	0,05
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	29.730	131	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	109.200	3.941	0,17
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2031	16.260	104	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	12.07.2033	4.000	(117)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	1.300	38	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	7.160	63	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	200	(2)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,783	07.02.2034	1.300	(20)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	2.000	(33)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	1.200	(27)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	1.300	31	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	2.600	54	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,860	21.02.2034	6.200	(56)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	30.08.2033	2.400	(34)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	10.04.2034	3.100	(14)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	15.04.2034	1.600	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	22.02.2029	9.100	(88)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	2.900	38	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,970	27.02.2029	3.100	(25)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	4.900	(9)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	2.600	17	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,078	29.04.2034	3.300	34	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	17.04.2034	3.100	32	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,085	22.04.2034	3.100	36	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,090	30.04.2034	3.300	37	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,130	03.05.2034	3.200	47	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	2.400	22	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	2.400	26	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,200	18.10.2033	2.000	26	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	2.400	36	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	1.300	21	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2029	2.100	63	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2031	4.210	150	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	2.600	(28)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	1.300	23	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	1.200	35	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	1.300	44	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	2.600	92	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	65.120	59	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	144.940	(504)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,874	02.01.2026	BRL 8.000	(47)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,899	02.01.2026	4.000	(23)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,939	02.01.2026	6.300	(35)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,998 %	04.01.2027	BRL	12.000	\$ (96)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,037	04.01.2027		2.800	(22)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,041	04.01.2027		11.300	(89)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,052	02.01.2026		13.900	(73)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,072	04.01.2027		6.980	(42)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,085	02.01.2026		13.700	(70)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,090	04.01.2027		21.200	(163)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,098	04.01.2027		21.120	(124)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,105	02.01.2026		13.600	(69)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,138	04.01.2027		5.300	(40)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,165	04.01.2027		10.710	(60)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,170	04.01.2027		17.870	(100)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,183	04.01.2027		32.100	(179)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,203	04.01.2027		25.010	(138)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,210	04.01.2027		3.600	(20)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,256	04.01.2027		24.990	(133)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,328	04.01.2027		35.470	(179)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,157	02.01.2025		100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,177	02.01.2025		100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,250	04.01.2027		200	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,275	04.01.2027		100	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,290	04.01.2027		100	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,367	02.01.2025		100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,746	04.01.2027		200	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,901	04.01.2027		500	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,018	02.01.2025		300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,047	04.01.2027		57.400	(71)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,098	02.01.2025		500	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,158	02.01.2025		300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,163	02.01.2025		300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,178	02.01.2025		500	0	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,750	19.06.2029	NZD	14.100	25	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,360	07.08.2028	ZAR	37.400	24	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,380	04.08.2028		35.400	24	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	31.07.2028		24.200	18	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	07.08.2028		5.500	4	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	31.07.2028		6.500	5	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	04.08.2028		9.000	7	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,420	31.07.2028		24.200	19	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,421	04.08.2028		12.400	9	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,426	01.08.2028		9.800	8	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	01.08.2028		16.500	14	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	02.08.2028		16.700	14	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,543	04.08.2028		9.100	9	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,550	03.08.2028		19.800	20	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	AUD	12.400	(583)	(0,03)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033		6.500	27	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034		16.100	94	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	18.09.2034		6.800	(81)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	€	2.500	1.056	0,05
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,294	30.06.2026		100	7	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025		200	12	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025		300	12	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024		200	5	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050		600	271	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024		2.400	(29)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027		14.200	(948)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027		4.800	(334)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052		27.100	1.415	0,06
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027		9.800	(589)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027		4.700	(281)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	21.09.2027		3.500	(128)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054		38.300	1.056	0,05
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033		4.900	(22)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,670	03.04.2034		1.400	28	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029		16.400	(287)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	05.03.2034		2.200	(17)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034		68.100	(1.209)	(0,05)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029		2.100	30	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	04.03.2034		2.200	(15)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	16.04.2029		3.300	(21)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029		3.200	(17)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,818	26.06.2029		3.400	13	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029		6.800	(19)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028		3.000	(37)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033		2.400	(44)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033		1.600	(32)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028		3.700	(52)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029		2.700	13	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033		2.100	(56)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033		1.600	(53)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033		1.200	(47)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148 %	20.11.2033	€ 1.900	\$ (77)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	1.600	(42)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033	1.900	(93)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	1.500	(45)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	08.11.2028	3.100	(92)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	21.08.2033	1.600	92	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	1.000	(53)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	2.000	(110)	(0,01)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028	2.900	124	0,01	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,300	16.06.2028	MXN 23.100	(47)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,444	25.07.2028	53.000	(126)	(0,01)	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,471	26.07.2028	26.700	(62)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,512	24.07.2028	40.100	(90)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,550	27.07.2028	13.500	(29)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,556	27.07.2028	80.500	(173)	(0,01)	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,600	31.07.2028	24.400	(49)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,620	28.07.2028	14.500	(29)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,636	28.07.2028	29.000	(58)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,640	28.07.2028	5.800	(12)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,650	28.07.2028	14.700	(29)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,660	28.07.2028	14.500	(28)	0,00	
Erhalt <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIIE	8,673	31.05.2029	4.200	8	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,680	31.05.2029	6.000	12	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,681	31.05.2029	7.700	15	0,00	
Erhalt <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIIE	8,683	31.05.2029	2.800	6	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,720	07.03.2029	2.500	5	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,725	07.03.2029	6.200	12	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,730	07.03.2029	3.800	7	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,760	01.03.2029	10.100	17	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,770	01.03.2029	5.100	9	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,780	01.03.2029	4.900	8	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,810	29.05.2031	5.200	10	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,073	03.06.2027	17.100	22	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,260	03.06.2027	10.100	10	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,340	03.06.2027	19.000	17	0,00	
Zahlung	UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 900	(144)	(0,01)	
Zahlung	UKRPI	4,020	15.10.2031	1.200	(183)	(0,01)	
Zahlung	UKRPI	4,055	15.09.2031	800	(126)	(0,01)	
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	1.700	(237)	(0,01)	
Zahlung	UKRPI	4,140	15.10.2031	2.300	(313)	(0,01)	
						\$ 41.795	1,82
						\$ 43.620	1,90

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnahmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettver- mögens
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110 %	26.07.2032	1.100	\$ 178	\$ 103	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	1.600	259	419	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	15.900	119	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	15.900	119	360	0,02
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,590	19.07.2024	11.300	156	0	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,590	19.07.2024	11.300	156	414	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,170	19.07.2032	1.200	190	114	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,170	19.07.2032	1.400	222	357	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	1.200	158	58	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	1.400	185	326	0,01
							\$ 1.742	\$ 2.151	0,09

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	Call - OTC USD versus MXN	MXN 18,150	06.02.2025	2.174	\$ (99)	\$ (136)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	18,100	11.02.2025	868	(40)	(56)	0,02
	Call - OTC USD versus MXN	18,150	13.02.2025	2.170	(97)	(138)	(0,01)
MYI	Call - OTC USD versus MXN	18,230	29.01.2025	2.186	(105)	(129)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	18,250	30.01.2025	2.186	(105)	(129)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	18,150	10.02.2025	2.185	(98)	(138)	(0,01)
					\$ (544)	\$ (726)	(0,03)

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	3.200	\$ (14)	\$ (4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	3.200	(14)	0	0,00
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700	04.07.2024	3.400	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	3.400	(5)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,700	05.07.2024	2.100	(8)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	2.100	(8)	(1)	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	2.300	(9)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	2.300	(9)	(11)	0,00
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689	15.07.2024	7.100	(15)	(3)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	7.100	(15)	(17)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	7.200	(30)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	7.200	(27)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	7.200	(26)	(13)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	4.900	(17)	(8)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	7.200	(27)	(46)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	7.200	(26)	(47)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	7.200	(30)	(46)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	4.900	(17)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	3.800	(14)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	18.07.2024	2.300	(8)	(2)	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	3.800	(14)	(15)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	18.07.2024	2.300	(8)	(10)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	3.600	(9)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	3.600	(13)	(10)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	3.400	(14)	(11)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	3.600	(13)	(20)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	3.600	(9)	(16)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	3.400	(14)	(4)	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	17.07.2024	4.000	(7)	(3)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	22.07.2024	4.100	(7)	(4)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	4.000	(6)	(6)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	22.07.2024	4.100	(7)	(9)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,970	17.07.2024	4.000	(7)	(6)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	4.000	(6)	(3)	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	2.200	(7)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	2.200	(7)	(10)	0,00
						\$ (472)	\$ (364)	(0,02)	

#### ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026 %	23.07.2025	15.900	\$ (139)	\$ (359)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	31.800	(127)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	15.900	(139)	(3)	0,00
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	11.300	(200)	(432)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	11.300	(200)	(19)	0,00
						\$ (805)	\$ (813)	(0,03)

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054			\$ 97,969	08.07.2024	1.700	\$ (6) \$ (1) 0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ (12)	\$ 12	\$ 0	0,00	
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	500	(45)	39	(6)	0,00	
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	900	(41)	40	(1)	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	640	(82)	83	1	0,00	
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(14)	12	(2)	0,00	
DUB	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	100	(5)	5	0	0,00	
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	500	(18)	16	(2)	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	300	(27)	23	(4)	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(11)	12	1	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	700	(79)	80	1	0,00	
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	700	(27)	24	(3)	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	800	(71)	61	(10)	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	300	(2)	3	1	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(3)	6	3	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.400	(62)	58	(4)	0,00	
						\$ (499)	\$ 474	\$ (25)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
GST	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500 %	16.12.2072	\$ 62.300	\$ 92	\$ (754)	\$ (662)	(0,02)	
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	15.300	(74)	(41)	(115)	(0,01)	
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	25.375	(78)	12	(66)	0,00	
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	25.375	(193)	69	(124)	(0,01)	
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	(2)	0	(2)	0,00	
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	25.500	86	(357)	(271)	(0,01)	
						\$ (169)	\$ (1.071)	\$ (1.240)	(0,05)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2024	AUD	14.065	\$ 9.371	\$ (22)	\$ (22)	0,00	
	07.2024	NZD	2.892	1.771	9	9	0,00	
	07.2024	\$	312	NZD 509	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024		1.771	2.892	0	(9)	(9)	0,00
	10.2024	CNH	30.707	\$ 4.288	47	0	47	0,00
	10.2024	\$	2.436	CNH 17.427	0	(29)	(29)	0,00
BOA	07.2024	CHF	42	\$ 47	0	0	0	0,00
	07.2024	CNY	746	105	1	0	1	0,00
	07.2024	€	396.192	430.123	5.504	0	5.504	0,24
	07.2024	KRW	6.749.571	4.934	32	0	32	0,00
	07.2024	SGD	109	80	0	0	0	0,00
	07.2024	\$	19.540	€ 17.937	0	(316)	(316)	(0,01)
	07.2024		1.597	£ 1.259	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024		900	IDR 14.750.550	2	0	2	0,00
	07.2024		2.548	NZD 4.153	0	(18)	(18)	0,00
	07.2024		1.791	SGD 2.417	0	(7)	(7)	0,00
	08.2024	SGD	109	\$ 81	0	0	0	0,00
	08.2024	TRY	946	27	0	0	0	0,00
	08.2024	\$	260	TRY 9.121	3	0	3	0,00
	02.2025		874	MXN 15.951	0	(31)	(31)	0,00
BPS	07.2024	€	21.173	\$ 22.655	0	(37)	(37)	0,00
	07.2024	£	252.270	322.251	3.357	0	3.357	0,15
	07.2024	IDR	26.912.676	1.648	4	0	4	0,00
	07.2024	KRW	6.698.999	4.881	15	0	15	0,00
	07.2024	\$	9.876	AUD 14.822	23	0	23	0,00
	07.2024		50	BRL 268	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024		22.647	€ 21.173	46	0	46	0,00
	07.2024		252	ILS 933	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024		34.565	¥ 5.403.405	0	(974)	(974)	(0,04)
	07.2024		2.459	NZD 4.002	0	(20)	(20)	0,00
	07.2024		2.200	PLN 8.813	0	(8)	(8)	0,00
	07.2024		6.205	SGD 8.415	5	0	5	0,00
	07.2024		696	ZAR 12.655	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	AUD	14.822	\$ 9.885	0	(23)	(23)	0,00
	08.2024	€	21.173	22.680	0	(46)	(46)	0,00
	08.2024	SGD	8.403	6.205	0	(5)	(5)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
	08.2024	\$	TRY	\$	\$	\$	0,00
	09.2024	CNH	\$				0,00
	09.2024	INR			(2)	(2)	0,00
	09.2024	TWD			0	41	0,00
	09.2024	\$	INR		0	3	0,00
	10.2024	CNH	\$		0	37	0,00
BRC	05.2029	KWD			0	96	0,00
	07.2024	AUD			(2)	(2)	0,00
	07.2024	CAD			(2)	(2)	0,00
	07.2024	KRW			0	3	0,00
	07.2024	MXN			(9)	(9)	0,00
	07.2024	NOK			0	0	0,00
	07.2024	SGD			0	3	0,00
	07.2024	THB			0	0	0,00
	07.2024	\$	£		(9)	(9)	0,00
	07.2024		PLN		(188)	(188)	(0,01)
	07.2024		TRY		0	155	0,01
	08.2024		£		0	1	0,00
	08.2024		TRY		0	33	0,00
	09.2024	MXN	\$		(284)	(284)	(0,01)
	09.2024	\$	TRY		0	106	0,00
	11.2024				0	64	0,00
CBK	02.2025		MXN		(37)	(37)	0,00
	07.2024	AUD	\$		(3)	(3)	0,00
	07.2024	BRL			0	435	0,02
	07.2024	CAD			(24)	33	0,00
	07.2024	CHF			(22)	(22)	0,00
	07.2024	CNH			0	41	0,00
	07.2024	€			(4)	10	0,00
	07.2024	£			0	15	0,00
	07.2024	NZD			0	0	0,00
	07.2024	\$	£		(25)	(25)	0,00
	07.2024		TRY		0	5	0,00
	08.2024		BRL		(441)	(441)	(0,02)
	09.2024	PEN	\$		0	40	0,00
	09.2024	TWD			0	16	0,00
	09.2024	\$	INR		(4)	4	0,00
DUB	01.2025		MXN		(30)	(30)	0,00
	07.2024	KRW	\$		0	2	0,00
	08.2024	\$	BRL		(307)	(307)	(0,01)
	09.2024	INR	\$		(8)	(8)	0,00
	09.2024	TWD			0	13	0,00
	02.2025	MXN			0	89	0,00
	02.2025	\$	MXN		(50)	(50)	0,00
GLM	03.2025		TRY		0	296	0,01
	07.2024	BRL	\$		0	3	0,00
	07.2024	IDR			0	0	0,00
	07.2024	MXN			(14)	(14)	0,00
	07.2024	\$	ILS		(10)	(10)	0,00
	07.2024		KRW		0	0	0,00
	07.2024		TRY		0	39	0,00
	07.2024		ZAR		0	0	0,00
	08.2024		BRL		(84)	(84)	0,00
	08.2024		TRY		0	23	0,00
	09.2024	MXN	\$		(4)	(4)	0,00
	09.2024	\$	TRY		0	64	0,00
	10.2024		CNH		(25)	(25)	0,00
MBC	07.2024	CAD	\$		(27)	28	0,00
	07.2024	CHF			(7)	(7)	0,00
	07.2024	€			0	55	0,00
	07.2024	£			0	128	0,01
	07.2024	IDR			0	0	0,00
	07.2024	¥			0	65	0,00
	07.2024	KRW			(12)	(12)	0,00
	07.2024	SGD			0	0	0,00
	07.2024	\$	CAD		0	7	0,00
	07.2024		CNY		(73)	(73)	0,00
	07.2024		€		0	998	0,04
	07.2024		£		(5)	(5)	0,00
	07.2024		NOK		0	0	0,00
	07.2024		PLN		(8)	(8)	0,00
	07.2024		SGD		0	0	0,00
	08.2024	CAD	\$		(8)	(8)	0,00
	08.2024	€			(998)	(998)	(0,04)
	08.2024	NOK			0	0	0,00
	08.2024	\$	¥		(64)	(64)	0,00
	08.2024		TRY		0	2	0,00
	09.2024	TWD	\$		0	1	0,00
MYI	02.2025	\$	MXN		(37)	(37)	0,00
	07.2024	€	\$		0	0	0,00
	07.2024	KRW			0	0	0,00
	07.2024	SGD			0	3	0,00
	07.2024	\$	BRL		(1.693)	(1.693)	(0,07)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
	07.2024	\$ 713	£ 564	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	09.2024	TWD 52.044	\$ 1.622	15	0	15	0,00
	09.2024	\$ 881	INR 73.674	1	0	1	0,00
	09.2024	170	MXN 3.094	0	(2)	(2)	0,00
	01.2025	MXN 15.142	\$ 831	30	0	30	0,00
	02.2025	31.811	1.748	67	0	67	0,00
RBC	07.2024	\$ 328.746	£ 259.243	0	(1.037)	(1.037)	(0,05)
	08.2024	£ 259.243	\$ 328.802	1.033	0	1.033	0,05
SCX	07.2024	CNY 40.000	5.625	77	0	77	0,00
	07.2024	KRW 3.399.393	2.493	24	0	24	0,00
	07.2024	SGD 8.184	6.074	35	0	35	0,00
	07.2024	\$ 22	MXN 403	0	0	0	0,00
	07.2024	184	ZAR 3.388	1	0	1	0,00
	09.2024	CNH 17.519	\$ 2.442	28	0	28	0,00
	09.2024	TWD 169.871	5.269	22	0	22	0,00
	09.2024	\$ 10.714	INR 896.708	16	0	16	0,00
UAG	07.2024	CHF 9.526	\$ 10.542	0	(59)	(59)	0,00
	07.2024	ILS 3.255	878	14	0	14	0,00
	07.2024	\$ 13.491	CHF 12.105	0	(21)	(21)	0,00
	08.2024	CHF 12.060	\$ 13.491	20	0	20	0,00
				\$ 13.546	\$ (7.202)	\$ 6.344	0,27

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	07.2024	\$ 23.751	CHF 21.364	\$ 24	\$ 0	\$ 24	0,00
CBK	07.2024	2.035	1.852	26	0	26	0,00
MBC	07.2024	19.919	17.941	46	0	46	0,00
SCX	07.2024	787	706	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07.2024	CHF 21.629	\$ 24.107	37	0	37	0,00
	07.2024	\$ 23.484	CHF 21.222	132	0	132	0,01
	08.2024	24.107	21.549	0	(36)	(36)	0,00
				\$ 265	\$ (37)	\$ 228	0,01

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	07.2024	€ 8	\$ 9	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 336.578	€ 310.013	0	(4.322)	(4.322)	(0,19)
BPS	07.2024	€ 293.720	\$ 314.173	8	(630)	(622)	(0,03)
	07.2024	\$ 325.052	€ 300.238	0	(3.272)	(3.272)	(0,14)
	08.2024	€ 119	\$ 128	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 313.723	€ 292.881	630	0	630	0,03
BRC	07.2024	296.663	273.963	2	(3.045)	(3.043)	(0,13)
CBK	07.2024	€ 664	\$ 712	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 425	€ 394	0	(3)	(3)	0,00
GLM	07.2024	34	31	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	€ 295.227	\$ 315.687	0	(723)	(723)	(0,03)
	07.2024	\$ 371	€ 346	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	316.122	295.203	724	0	724	0,03
SCX	07.2024	€ 295.366	\$ 316.455	0	(104)	(104)	0,00
	08.2024	\$ 316.920	€ 295.366	100	0	100	0,00
				\$ 1.465	\$ (12.100)	\$ (10.635)	(0,46)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BPS	07.2024	£ 112.242	\$ 141.931	\$ 46	\$ 0	\$ 46	0,00
	07.2024	\$ 281.786	£ 221.126	0	(2.260)	(2.260)	(0,10)
	08.2024	141.954	112.242	0	(43)	(43)	0,00
	07.2024	7	5	0	0	0	0,00
BRC	07.2024	£ 470	\$ 598	4	0	4	0,00
CBK	07.2024	\$ 3.664	£ 2.881	0	(22)	(22)	0,00
	08.2024	13	10	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	146.722	114.988	0	(1.366)	(1.366)	(0,06)
MBC	07.2024	£ 113.173	\$ 143.187	125	0	125	0,01
	08.2024	\$ 143.211	£ 113.173	0	(123)	(123)	(0,01)
RBC	07.2024	£ 113.115	\$ 143.441	452	0	452	0,02
	08.2024	\$ 143.466	£ 113.115	0	(451)	(451)	(0,02)
				\$ 627	\$ (4.265)	\$ (3.638)	(0,16)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2024	SGD 12.782	\$ 9.418	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	0,00		
	07.2024	\$ 9.374	SGD 12.653	0	(38)	(38)	0,00		
	08.2024	9.440	12.794	14	0	14	0,00		
BPS	07.2024	SGD 12.767	\$ 9.413	0	(7)	(7)	0,00		
	08.2024	\$ 9.413	SGD 12.748	7	0	7	0,00		
BRC	07.2024	SGD 15	\$ 11	0	0	0	0,00		
CBK	07.2024	\$ 276	SGD 372	0	(1)	(1)	0,00		
GLM	07.2024	104	140	0	(1)	(1)	0,00		
MBC	07.2024	SGD 52	\$ 39	0	0	0	0,00		
	07.2024	\$ 76	SGD 103	0	0	0	0,00		
SCX	07.2024	9.353	12.603	0	(54)	(54)	(0,01)		
UAG	07.2024	8.575	11.583	0	(29)	(29)	0,00		
						<b>\$ 21</b>	<b>\$ (144)</b>	<b>\$ (123)</b>	<b>(0,01)</b>
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						<b>\$ (8.842)</b>	<b>(0,39)</b>		
Summe Anlagen						<b>\$ 3.729.868</b>	<b>162,42</b>		
Sonstige Aktiva und Passiva						<b>\$ (1.433.430)</b>	<b>(62,42)</b>		
Nettovermögen						<b>\$ 2.296.438</b>	<b>100,00</b>		

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.  
(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.  
(c) Nullkuponwertpapier.  
(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
(e) Mit dem Fonds verbunden.  
(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,21 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
AMSURG Corp.	02.11.2023 - 06.11.2023	\$ 1.905	\$ 2.257	0,10
Intelsat Emergence S.A.	05.09.2018 - 23.02.2022	3.227	1.695	0,08
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	166	695	0,03
Westmoreland Mining LLC	26.03.2019	0	0	0,00
Westmoreland Mining LLC	07.03.2023	1	1	0,00
		<b>\$ 5.299</b>	<b>\$ 4.648</b>	<b>0,21</b>

Barmittel in Höhe von 1.228 USD (31. Dezember 2023: 1.587 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 46.434 USD (31. Dezember 2023: 42.633 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 11.967 USD (31. Dezember 2023: 2.797 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 295	\$ 3.351.131	\$ 7.320	\$ 3.358.746
Investmentfonds	229.495	0	0	229.495
Pensionsgeschäfte	0	105.754	0	105.754
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(152)	36.025	0	35.873
Summen	<b>\$ 229.638</b>	<b>\$ 3.492.910</b>	<b>\$ 7.320</b>	<b>\$ 3.729.868</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 516	\$ 2.665.094	\$ 26.471	\$ 2.692.081
Investmentfonds	199.001	0	0	199.001
Pensionsgeschäfte	0	345.484	0	345.484
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(252)	28.909	0	28.657
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(5.624)	0	(5.624)
Summen	<b>\$ 199.265</b>	<b>\$ 3.033.863</b>	<b>\$ 26.471</b>	<b>\$ 3.259.599</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (6)	\$ 0	\$ (6)	\$ (68)	\$ 0	\$ (68)
BOA	824	(1.054)	(230)	199	0	199
BPS	(2.926)	2.958	32	(200)	(1.560)	(1.760)
BRC	(3.213)	3.798	585	(343)	90	(253)
CBK	63	0	63	144	(290)	(146)
DUB	(1.661)	1.661	0	(832)	530	(302)
GLM	287	0	287	1.092	(760)	332
GST	(666)	517	(149)	(427)	554	127
MBC	120	(224)	(104)	(312)	260	(52)
MEI	(115)	261	146	(60)	280	220
MYC	272	320	592	313	583	896
MYI	(1.975)	1.652	(323)	891	(810)	81
NGF	k. A.	k. A.	k. A.	(341)	500	159
RBC	(3)	0	(3)	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(31)	0	(31)	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(1)	0	(1)	(121)	0	(121)
SCX	144	0	144	1.085	(1.600)	(515)
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	1.131	(980)	151
UAG	58	(252)	(194)	1.030	(2.580)	(1.550)
ULO	(13)	0	(13)	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	53,04	44,20
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	86,21	87,13
Sonstige übertragbare Wertpapiere	7,01	1,26
Investmentfonds	9,99	9,80
Pensionsgeschäfte	4,61	17,02
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,05	(0,34)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,90	1,60
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,39)	0,16
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,28)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,45	1,67
Unternehmensanleihen und Wechsel	27,89	20,46
Wandelanleihen & Wechsel	k. A.	0,03
US-Regierungsbehörden	66,23	59,41
US-Schatzobligationen	5,72	9,00
Non-Agency-MBS	24,74	22,57
Forderungsbesicherte Wertpapiere	16,24	13,88
Staatsemissionen	3,77	2,94
Stammaktien	0,22	0,25
Optionsscheine	0,00	0,00
Real Estate Investment Trusts	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	k. A.	2,38
Investmentfonds	9,99	9,80
Pensionsgeschäfte	4,61	17,02
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,05	(0,34)
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,06	0,15
Zinsswaps	1,82	1,42
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,09	0,08
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,03)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,04)
Zinsswaps	(0,03)	(0,03)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)

<b>Anlagen zum Marktwert</b>	<b>30. Jun. 2024 (%)</b>	<b>31. Dez. 2023 (%)</b>
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,05)	(0,03)
Devisenterminkontrakte	0,27	(0,31)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,62)	0,50
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,28)
Sonstige Aktiva und Passiva	(62,42)	(60,55)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
American Airlines, Inc. 10,336 % fällig am 20.04.2028	\$ 880	\$ 910	0,13	CTP NV 0,625 % fällig am 27.09.2026	€ 1.500	\$ 1.497	0,21	Santander Holdings USA, Inc. 3,244 % fällig am 05.10.2026	\$ 100	\$ 95	0,01
Broadcom, Inc. TBD % fällig am 14.08.2026	1.500	1.492	0,20	1,500 % fällig am 27.09.2031	2.500	2.196	0,30	Santander UK Group Holdings PLC 3,625 % fällig am 14.01.2026	£ 300	371	0,05
IRB Holding Corp. 8,179 % fällig am 15.12.2027	3.315	3.318	0,45	Deutsche Bank AG 2,625 % fällig am 16.12.2024	£ 3.000	3.741	0,51	3,823 % fällig am 03.11.2028	\$ 300	284	0,04
LifePoint Health, Inc. 9,329 % fällig am 17.05.2031	300	301	0,04	DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	€ 2.100	2.080	0,29	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	€ 1.100	1.107	0,15
10,056 % fällig am 16.11.2028	1.136	1.144	0,16	Everglades Re Ltd. 15,855 % fällig am 13.05.2031	\$ 250	249	0,03	Sofina S.A. 1,000 % fällig am 23.09.2028	2.500	2.359	0,32
MPH Acquisition Holdings LLC 9,859 % fällig am 01.09.2028	3.793	3.167	0,43	16,855 % fällig am 13.05.2031	250	249	0,03	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 2,550 % fällig am 10.03.2025	\$ 2.400	2.352	0,32
		10.332	1,41	18,105 % fällig am 13.05.2031	250	249	0,03	3,629 % fällig am 06.04.2026	€ 2.600	2.787	0,38
				Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % fällig am 29.04.2030	700	668	0,09	Sun Communities Operating LP 4,200 % fällig am 15.04.2032	\$ 2.500	2.243	0,31
				Federation des Caisses Desjardins du Quebec 5,874 % fällig am 30.11.2026	€ 1.000	1.268	0,17	TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	£ 1.000	1.084	0,15
				Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 2.900	3.105	0,43	5,250 % fällig am 29.05.2026	500	625	0,09
				3,375 % fällig am 13.11.2025	\$ 600	581	0,08	UBS AG 0,250 % fällig am 01.09.2028	€ 300	282	0,04
				Goldman Sachs Group, Inc. 3,691 % fällig am 05.06.2028	100	96	0,01	UBS Group AG 1,000 % fällig am 24.06.2027	500	507	0,07
				4,223 % fällig am 01.05.2029	2.500	2.407	0,33	3,750 % fällig am 26.03.2025	\$ 150	148	0,02
				HSBC Holdings PLC 5,750 % fällig am 20.12.2027	€ 100	127	0,02	4,194 % fällig am 01.04.2031	800	747	0,10
				6,000 % fällig am 29.03.2040	200	246	0,03	4,550 % fällig am 17.04.2026	700	688	0,09
				Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027	€ 1.700	1.872	0,26	VICI Properties LP 4,375 % fällig am 15.05.2025	1.300	1.284	0,18
				(g)(i)				Volkswagen Financial Services NV 1,875 % fällig am 03.12.2024	£ 2.000	2.492	0,34
				JPMorgan Chase & Co. 1,963 % fällig am 23.03.2030	1.000	993	0,14	Volkswagen Leasing GmbH 3,625 % fällig am 11.10.2026	€ 1.000	1.071	0,15
				Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	1.800	1.839	0,25	Wells Fargo & Co. 4,808 % fällig am 25.07.2028	\$ 2.000	1.973	0,27
				LeasePlan Corp. NV 2,875 % fällig am 24.10.2024	\$ 1.200	1.189	0,16			117.488	16,09
				Legal & General Group PLC 5,625 % fällig am 24.03.2031	€ 600	676	0,09	<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
				(g)(i)				Aeroporti di Roma SpA 1,750 % fällig am 30.07.2031	€ 600	558	0,08
				Lloyds Banking Group PLC 2,250 % fällig am 16.10.2024	900	1.127	0,16	Air Canada 3,875 % fällig am 15.08.2026	\$ 1.200	1.143	0,16
				3,750 % fällig am 18.03.2028	\$ 1.000	957	0,13	Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029	1.524	1.496	0,20
				4,375 % fällig am 22.03.2028	400	388	0,05	Altice France S.A. 5,500 % fällig am 15.10.2029	2.100	1.387	0,19
				4,716 % fällig am 11.08.2026	500	494	0,07	American Airlines Pass-Through Trust 3,150 % fällig am 15.08.2033	548	490	0,07
				Logicor Financing SARL 0,625 % fällig am 17.11.2025	€ 1.300	1.325	0,18	3,250 % fällig am 15.04.2030	16	15	0,00
				1,500 % fällig am 13.07.2026	1.000	1.011	0,14	3,375 % fällig am 01.11.2028	935	884	0,12
				3,250 % fällig am 13.11.2028	700	712	0,10	3,650 % fällig am 15.08.2030	663	626	0,09
				Longleaf Pine Re Ltd. 22,855 % fällig am 27.05.2031	\$ 400	397	0,05	3,700 % fällig am 01.04.2028	202	193	0,03
				Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,339 % fällig am 19.07.2024	€ 1.600	1.712	0,24	American Medical Systems Europe BV 1,375 % fällig am 08.03.2028	€ 2.000	1.991	0,27
				5,242 % fällig am 19.04.2029	\$ 600	602	0,08	Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026	\$ 2.100	1.997	0,27
				Mizuho Financial Group, Inc. 3,477 % fällig am 12.04.2026	3.050	2.953	0,41	British Airways Pass-Through Trust 3,300 % fällig am 15.06.2034	81	73	0,01
				NatWest Group PLC 4,892 % fällig am 18.05.2029	700	685	0,09	4,250 % fällig am 15.05.2034	289	272	0,04
				8,000 % fällig am 10.08.2025	300	302	0,04	Broadcom, Inc. 3,469 % fällig am 15.04.2034	200	171	0,02
				(g)(i)				Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 1.300	1.303	0,18
				NE Property BV 2,000 % fällig am 20.01.2030	€ 2.000	1.865	0,26	1,000 % fällig am 31.07.2031	2.100	1.863	0,25
				Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,450 % fällig am 15.09.2028	\$ 800	695	0,10	Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK) 3,000 % fällig am 31.12.2026	\$ 557	458	0,06
				Palm RE Ltd. 14,855 % fällig am 09.06.2031	250	247	0,03	(b)			
				Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC 0,000 % fällig am 05.04.2032	1.048	685	0,09	DAE Funding LLC 3,375 % fällig am 20.03.2028	1.900	1.748	0,24
				Peugeot Invest 1,875 % fällig am 30.10.2026	€ 3.800	3.857	0,53	Delta Air Lines, Inc. 7,000 % fällig am 01.05.2025	800	806	0,11
				Polestar Re Ltd. 18,605 % fällig am 07.01.2027	\$ 700	712	0,10	Discovery Communications LLC 2,500 % fällig am 20.09.2024	£ 100	125	0,02
				Purple Re Ltd. 14,355 % fällig am 06.06.2031	300	299	0,04	Enbridge, Inc. 5,700 % fällig am 08.03.2033	\$ 2.000	2.016	0,28
				Rexford Industrial Realty LP 2,150 % fällig am 01.09.2031	21	17	0,00	Exela Intermediate LLC (11,500 % PIK) 11,500 % fällig am 15.04.2026 (b)	190	29	0,00
				Sagax AB 1,125 % fällig am 30.01.2027	€ 1.700	1.689	0,23	GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 18.01.2033	£ 300	391	0,05
				Sagax Euro MTN NL BV 0,750 % fällig am 26.01.2028	600	572	0,08				
				1,000 % fällig am 17.05.2029	1.000	928	0,13				





## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Segovia European CLO DAC 4,777 % fällig am 20.07.2032 €	6.889	\$ 7.346	1,01	Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026 €	3.300	\$ 3.592	0,49	TER Finance Jersey Ltd. 7,020 % fällig am 02.01.2025 (d)(e)	\$ 500	\$ 482	0,07
SG Mortgage Securities Trust 5,670 % fällig am 25.10.2036 \$	3.600	2.555	0,35	Japan Finance Organization for Municipalities 0,050 % fällig am 12.02.2027	1.500	1.477	0,20			856	0,12
Sierra Madre Funding Ltd. 5,822 % fällig am 07.09.2039	1.892	1.209	0,17	Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028 \$	1.700	1.698	0,23	Summe kurzfristige Instrumente		856	0,12
Sound Point CLO Ltd. 6,686 % fällig am 26.07.2031	901	903	0,12	Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 2.300	604	0,08	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 896.259	122,77	
6,739 % fällig am 18.04.2031	6.547	6.559	0,90	6,150 % fällig am 12.08.2032	4.600	1.159	0,16	<b>AKTIEN</b>			
Soundview Home Loan Trust 5,660 % fällig am 25.06.2037	2.102	1.422	0,19	6,950 % fällig am 12.08.2031	4.800	1.287	0,18	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
5,720 % fällig am 25.02.2037	975	276	0,04	Romania Government International Bond 1,750 % fällig am 13.07.2030 €	1.500	1.314	0,18	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)	385.356	3.903	0,53
5,960 % fällig am 25.10.2036	1.214	1.144	0,16	South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029 \$	2.000	1.834	0,25	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	1.197.507	11.616	1,59
Structured Asset Investment Loan Trust 6,435 % fällig am 25.01.2035	1.685	1.511	0,21	Turkey Government International Bond 6,350 % fällig am 10.08.2024	2.500	2.503	0,34	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (h)	306.226	3.052	0,42
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,615 % fällig am 25.09.2036	4.459	2.703	0,37		28.957	3,97				18.571	2,54
6,944 % fällig am 25.04.2035	22	22	0,00	<b>AKTIEN</b>				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust 5,685 % fällig am 25.05.2037	421	389	0,05	<b>ENERGIE</b>				<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)</b>			
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 6,060 % fällig am 25.04.2037	3.701	2.592	0,36	Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (c)(j)	617.385	67	0,01	543.400	54.370	7,45	
7,185 % fällig am 25.11.2035	78	77	0,01	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				Summe Investmentfonds	\$ 72.941	9,99	
	159.484	21,84		Nationwide Building Society 10,250 %	521	86	0,01	<b>STAMMAKTIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
Argentina Government International Bond 0,750 % fällig am 09.07.2030	1.422	799	0,11	Gateway Re Ltd. 5,355 % fällig am 23.12.2028 \$	400	374	0,05	<b>Summe</b>			
1,000 % fällig am 09.07.2029	150	87	0,01	<b>Summe</b>				\$ (59.310)	\$ 59.376	\$ 59.402	8,13
3,625 % fällig am 09.07.2035	2.504	1.056	0,15	<b>Summe</b>				\$ (59.310)	\$ 59.376	\$ 59.402	8,13
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.07.2024 (d)	BRL 1.000	180	0,03	<b>Summe</b>				\$ (59.310)	\$ 59.376	\$ 59.402	8,13
0,000 % fällig am 01.04.2025 (d)	68.200	11.367	1,56	<b>Summe</b>				\$ (59.310)	\$ 59.376	\$ 59.402	8,13

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover-mögens
BOS	5,390 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 58.800	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	\$ (58.722)	\$ 58.800	\$ 58.826	8,05
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	576	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(588)	576	576	0,08
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (59.310)	\$ 59.376	\$ 59.402	8,13

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	1	\$ 0	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	242	(260)	(0,04)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	132	(242)	(0,03)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	11	36	0,01
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	440	(220)	(0,03)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	305	155	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	963	(767)	(0,10)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	298	(305)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	1.239	(1.286)	(0,19)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	7	5	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (2.884)	(0,40)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2028	\$ 200	\$ 4	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	500	31	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.700	17	0,00
				\$ 52	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-41 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2028	\$ 10.989	\$ (64)	(0,01)

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000 %	18.09.2029	£ 9.300	\$ (53)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,550	14.09.2028	¥ 4.800.000	41	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	\$ 16.480	(956)	(0,13)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	5.000	674	0,09
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	19.09.2028	53.900	(646)	(0,09)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,725	19.09.2028	39.400	(476)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	29.700	4.408	0,60
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,827	03.07.2028	13.300	(1.484)	(0,20)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,842	19.09.2053	200	7	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,853	18.05.2032	37.780	(5.210)	(0,71)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,874	19.09.2053	8.800	276	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,999	03.07.2053	11.500	3.310	0,45
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	27.10.2028	31.000	(2.764)	(0,38)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	12.02.2030	9.900	1.315	0,18
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	10.03.2030	4.900	562	0,08
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,060	27.10.2053	6.200	1.821	0,25
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	4.700	(91)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	4.600	(83)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	4.600	(83)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	4.600	(75)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	4.600	(73)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	4.600	(71)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	1.200	(55)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	1.900	(79)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,545	31.10.2030	1.900	61	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,555	05.03.2054	800	(26)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,582	31.10.2030	18.100	539	0,07
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,592	31.10.2030	39.400	1.148	0,16
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,594	09.01.2034	1.000	38	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,600	17.01.2034	1.900	78	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,601	31.10.2030	3.700	106	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,602	31.10.2030	13.000	371	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,606	31.10.2030	8.300	235	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,623	31.10.2030	3.600	98	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	36.100	(519)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,664	31.10.2030	2.400	60	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,670	08.01.2034	1.400	50	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,677	31.10.2030	1.900	46	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	1.200	42	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,687	31.10.2030	8.100	191	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,691	31.10.2030	3.900	91	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,722	31.10.2030	8.000	172	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	31.10.2030	5.200	108	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,739	31.10.2030	2.800	57	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	24.600	(326)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	13.300	(180)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	25.200	119	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	700	14	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,860	21.02.2034	3.400	(31)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	10.04.2034	600	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	1.400	18	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,078	29.04.2034	2.000	21	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	17.04.2034	1.600	17	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,085	22.04.2034	1.600	19	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,090	30.04.2034	3.000	39	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,105	24.04.2034	1.800	23	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	22.04.2034	1.200	20	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	1.000	(11)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettöver- mögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,496 %	04.01.2027	BRL 34.600	\$ (53)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,566	04.01.2027	183.600	(174)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,691	04.01.2027	104.500	62	0,01
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	CAD 93.700	48	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 8.200	187	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	18.800	274	0,04
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	05.03.2034	1.800	(14)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	32.600	(471)	(0,07)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	16.04.2029	400	(3)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029	1.600	(8)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,818	26.06.2029	700	3	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029	1.800	(5)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,641	19.02.2029	PLN 27.500	(131)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,810	16.02.2029	36.800	(108)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,970	21.03.2029	20.500	(22)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,158	22.03.2027	28.300	(18)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,160	21.03.2027	28.300	(18)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,985	11.10.2027	29.300	(678)	(0,09)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,015	11.10.2027	53.100	(1.244)	(0,17)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,156	13.10.2027	54.000	(600)	(0,08)
					<b>\$ (73)</b>	<b>(0,01)</b>
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					<b>\$ (85)</b>	<b>(0,01)</b>

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,275	06.12.2024	100	\$ 12	\$ 26	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	06.12.2024	90	11	17	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,350	06.12.2024	19	2	4	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	06.12.2024	200	18	29	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	14.01.2025	200	16	25	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	23.01.2025	200	19	25	0,00
BRC	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	100	11	15	0,00
	Call - OTC USD versus JPY	¥ 153,500	05.07.2024	6.000	34	268	0,04
CBK	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,300	14.01.2025	200	21	37	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,450	14.02.2025	200	19	23	0,00
MBC	Call - OTC USD versus CNH	7,350	06.12.2024	200	19	37	0,01
	Call - OTC USD versus CNH	7,375	14.02.2025	200	20	27	0,01
SCX	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	80	8	12	0,00
					<b>\$ 210</b>	<b>\$ 545</b>	<b>0,08</b>

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,725 %	14.11.2024	12.700	\$ 0	\$ 6	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,749	13.11.2024	20.700	0	10	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,754	15.11.2024	8.900	0	5	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,765	18.11.2024	6.300	0	4	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	20.11.2024	9.000	0	6	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	17.12.2024	4.500	0	4	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,820	21.11.2024	9.000	0	6	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,850	22.11.2024	6.300	0	5	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	09.12.2024	11.700	0	13	0,01
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	13.12.2024	6.300	0	8	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,920	25.11.2024	10.000	0	10	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	29.11.2024	11.800	0	13	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	11.12.2024	9.000	0	11	0,00
							<b>\$ 0</b>	<b>\$ 101</b>	<b>0,01</b>

**VERKAUFSOPTIONEN****DEVISENOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Call - OTC USD versus JPY	¥ 157,250	05.07.2024	12.000	\$ (22)	\$ (263)	(0,04)

**ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,700 %	05.07.2024	600	\$ (2)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	600	(2)	0	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	1.600	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	1.600	(6)	(8)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,586	15.07.2024	1.300	(5)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,885	10.07.2024	1.200	(4)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,986	15.07.2024	1.300	(5)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,235	10.07.2024	1.200	(4)	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	1.300	(5)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	2.500	(10)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	1.000	(4)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	2.500	(10)	(16)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	1.300	(5)	(8)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	1.000	(4)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,300	14.11.2024	1.400	0	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	13.11.2024	2.300	0	(11)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	15.11.2024	1.000	0	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.11.2024	700	0	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,350	20.11.2024	1.000	0	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,353	17.12.2024	500	0	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,357	21.11.2024	1.000	0	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,360	22.11.2024	700	0	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,395	09.12.2024	1.300	0	(10)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,400	25.11.2024	1.100	0	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,425	13.12.2024	700	0	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,465	29.11.2024	1.300	0	(12)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,468	11.12.2024	1.000	0	(10)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	18.07.2024	800	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	18.07.2024	800	(3)	(3)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	1.700	(4)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	1.000	(4)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	1.400	(6)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	1.000	(4)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	1.700	(4)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	1.400	(6)	(2)	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	17.07.2024	1.000	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	22.07.2024	300	0	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	22.07.2024	300	0	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,970	17.07.2024	1.000	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	500	(1)	0	0,00
							\$ (112)	\$ (188)	(0,02)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 200	\$ (3)	\$ 4	\$ 1	0,00

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.200	\$ (9)	\$ 3	\$ (6)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	100	(4)	4	0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.500	(3)	(1)	(4)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	300	(10)	9	(1)	0,00
					\$ (26)	\$ 15	\$ (11)	0,00

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens		
AZD	07.2024	NZD	1.031	\$	631	\$	3	0,00	
	08.2024	\$	631	NZD	1.031	\$	0	0,00	
	10.2024		1.974	CNH	14.134		(3)	0,00	
BOA	07.2024	SGD	54	\$	40		(21)	0,00	
	07.2024	\$	1.234	€	1.147		0	0,00	
	07.2024		500	IDR	8.194.750		(5)	0,00	
	07.2024		1.349	NZD	2.199		0	0,00	
	07.2024		7.361	PLN	29.672		(9)	0,00	
	07.2024		40	SGD	54		0	0,00	
	08.2024	PEN	4.354	\$	1.137		0	0,00	
	08.2024	SGD	54		40		1	0,00	
	02.2025	CNH	2.707		379		0	0,00	
	07.2024	CAD	291		213		2	0,00	
BPS	07.2024	€	4.098		4.462		1	0,00	
	07.2024	£	33.096		42.277		70	0,01	
	07.2024	PLN	52.967		13.071		0	0,00	
	07.2024	TWD	132.830		4.105		440	0,06	
	07.2024	\$	1.551	AUD	2.327		0	0,00	
	07.2024		151	ILS	559		4	0,00	
	07.2024		667	INR	55.812		0	0,00	
	07.2024		1.422	NZD	2.315		(2)	0,00	
	07.2024		873	PLN	3.496		0	0,00	
	07.2024		3.405	SGD	4.618		(12)	0,00	
	08.2024	AUD	2.327	\$	1.552		(4)	0,00	
	08.2024	SGD	4.611		3.405		0	0,00	
	09.2024	TWD	1.088		34		(3)	0,00	
	09.2024	\$	157	CNH	1.126		0	0,00	
	01.2025	CNH	6.000	\$	840		(2)	0,00	
	07.2024	¥	36.900		234		6	0,00	
	07.2024	MXN	10.249		555		5	0,00	
	07.2024	PLN	264		67		(5)	0,00	
	07.2024	SGD	3.943		2.919		2	0,00	
	07.2024	\$	7.508	PLN	29.977		9	0,00	
BRC	07.2024		1.324	TRY	45.663		0	(0,01)	
	08.2024		2.073		71.887		35	0,01	
	09.2024	MXN	33.556	\$	1.769		0	0,00	
	09.2024	\$	3.731	MXN	69.913		13	0,00	
	09.2024		928	TRY	34.085		0	(45)	(0,01)
	11.2024		793		31.309		46	0,01	
	02.2025		379	CNH	2.705		40	0,01	
	08.2024	PEN	1.227	\$	321		0	(2)	0,00
	07.2024	AUD	6.852		4.535		1	0,00	
	07.2024	€	1.741		1.868		0	(41)	(0,01)
	07.2024	MXN	71.391		3.875		2	0,00	
	07.2024	THB	22.424		613		0	(21)	0,00
BSH CBK	07.2024	\$	2.515	BRL	13.704		1	0,00	
	07.2024		4.598	PLN	18.056		0	(48)	(0,01)
	07.2024		230	TRY	7.749		1	(108)	(0,01)
	08.2024	BRL	13.750	\$	2.515		48	1	0,00
	09.2024	TWD	558		17		0	0	0,00
	10.2024	CNH	80.370		11.164		62	0	0,00
	01.2025	\$	840	CNH	5.997		0	62	0,01
	07.2024	€	154.562	\$	168.342	2.689	0	(6)	0,00
	07.2024	NZD	1.981		1.208		0	0	0,00
	07.2024	\$	3.015	AUD	4.525		7	1	0,00
FAR	07.2024		231	¥	36.868		0	(2)	0,00
	08.2024	¥	36.696	\$	231		2	0	0,00
	08.2024	\$	1.208	NZD	1.981		0	(1)	0,00
	09.2024	PEN	12.753	\$	3.406		77	0	0,01
	07.2024	BRL	76.814		15.281	1.451	0	1.451	0,20
	07.2024	IDR	164.100		10		0	0	0,00
	07.2024	ILS	556		150		2	0	0,00
	07.2024	MYR	27		6		0	0	0,00
	07.2024	TWD	30.574		945		3	0	0,00
	07.2024	\$	11.664	BRL	63.100		0	(303)	(0,04)
GLM	07.2024		5.802	MXN	106.672		29	(9)	0,00
	07.2024		677	TRY	23.061		18	0	0,00
	07.2024		155	ZAR	2.835		0	0	0,00
	08.2024		5.411	BRL	27.761		0	(431)	(0,06)
	08.2024		1.145	TRY	39.529		7	0	0,00
	09.2024		490		17.383		3	0	0,00
	10.2024		2.339	BRL	12.837		0	(51)	(0,01)
	03.2025		275	TRY	13.160		35	0	0,00
	04.2025	BRL	68.200	\$	12.224	318	0	318	0,04
	07.2024	\$	7.497	CAD	10.264		4	0	0,00
	07.2024		4.149	£	3.253		0	(37)	(0,01)
	07.2024		351	INR	29.376		1	0	0,00
MBC	08.2024	CAD	10.258	\$	7.497		0	(5)	0,00
	12.2024	CNH	5.710		800		8	0,00	
	12.2024	\$	800	CNH	5.708		0	(9)	0,00
	07.2024	CAD	9.967	\$	7.253		0	(31)	0,00
MYI	07.2024								

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	07.2024	CHF 6.609	\$ 7.385	\$ 30	\$ 0	\$ 30	0,00
	07.2024	£ 9	11	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 15.212.535	11.050	5	0	5	0,00
	07.2024	SGD 675	500	2	0	2	0,00
	07.2024	TWD 92.559	2.861	9	0	9	0,00
	07.2024	\$ 471	€ 439	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	2.838	£ 2.244	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	10.032	INR 839.716	39	0	39	0,01
	07.2024	238	PLN 948	0	(2)	(2)	0,00
RBC	07.2024	37.844	£ 29.843	0	(119)	(119)	(0,02)
	08.2024	£ 29.843	\$ 37.850	119	0	119	0,02
SCX	07.2024	CNY 369	52	1	0	1	0,00
	07.2024	MXN 75	4	0	0	0	0,00
	07.2024	TWD 101.525	3.138	10	0	10	0,00
	07.2024	\$ 170.154	€ 158.815	56	0	56	0,01
	07.2024	7.458	ZAR 137.440	59	0	59	0,01
	08.2024	€ 158.815	\$ 170.404	0	(54)	(54)	(0,01)
	08.2024	PEN 4.003	1.048	3	0	3	0,00
	09.2024	TWD 953	30	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 74	CNH 529	0	(1)	(1)	0,00
TOR	07.2024	NZD 1.502	\$ 920	5	0	5	0,00
	08.2024	\$ 2.223	COP 8.915.946	0	(86)	(86)	(0,01)
	08.2024	920	NZD 1.502	0	(5)	(5)	0,00
UAG	07.2024	7.361	CHF 6.604	0	(11)	(11)	0,00
	08.2024	CHF 6.580	\$ 7.361	11	0	11	0,00
				\$ 5.874	\$ (1.656)	\$ 4.218	0,58

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2024	\$ 5.720	€ 5.269	\$ 0	\$ (74)	\$ (74)	(0,01)
BPS	07.2024	€ 4.981	\$ 5.328	1	(11)	(10)	0,00
	07.2024	\$ 5.414	€ 5.001	0	(54)	(54)	(0,01)
	08.2024	5.274	4.924	10	0	10	0,00
BRC	07.2024	5.175	4.779	0	(53)	(53)	(0,01)
CBK	07.2024	€ 77	\$ 83	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	5.029	5.378	0	(12)	(12)	0,00
	08.2024	\$ 5.299	€ 4.949	12	0	12	0,00
MYI	07.2024	€ 27	\$ 29	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	4.946	5.299	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	\$ 5.306	€ 4.946	2	0	2	0,00
SSB	07.2024	13	12	0	0	0	0,00
				\$ 25	\$ (206)	\$ (181)	(0,03)

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	07.2024	£ 155.257	\$ 196.324	\$ 64	\$ 0	\$ 64	0,01
	07.2024	\$ 592.604	£ 465.455	0	(4.223)	(4.223)	(0,58)
	08.2024	196.354	155.255	0	(60)	(60)	(0,01)
BRC	07.2024	13	10	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	£ 307	\$ 391	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 950	£ 747	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	6	5	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	£ 155.389	\$ 196.599	171	0	171	0,02
	08.2024	\$ 196.570	£ 155.340	0	(168)	(168)	(0,02)
RBC	07.2024	£ 155.259	\$ 196.884	621	0	621	0,08
	08.2024	\$ 196.918	£ 155.259	0	(619)	(619)	(0,08)
				\$ 860	\$ (5.076)	\$ (4.216)	(0,58)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 6	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2054	\$ 46.900	\$ (36.723)	(5,03)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (36.723)	(5,03)
Summe Anlagen		\$ 988.890	135,45
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (258.822)	(35,45)
Nettovermögen		\$ 730.068	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (j) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,01 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 67	\$ 67	0,01

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 15.094 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 15.390 USD (31. Dezember 2023: 23.168 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.554 USD (31. Dezember 2023: 4.454 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 893.992	\$ 2.267	\$ 896.259
Investmentfonds	72.941	0	0	72.941
Pensionsgeschäfte	0	59.376	0	59.376
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(686)	(2.277)	0	(2.963)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(36.723)	0	(36.723)
<b>Summen</b>	<b>\$ 72.255</b>	<b>\$ 914.368</b>	<b>\$ 2.267</b>	<b>\$ 988.890</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.047.125	\$ 205	\$ 1.047.330
Investmentfonds	16.610	54.188	0	70.798
Pensionsgeschäfte	0	2.805	0	2.805
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.303)	(11.051)	0	(12.354)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(41.577)	0	(41.577)
<b>Summen</b>	<b>\$ 15.307</b>	<b>\$ 1.051.490</b>	<b>\$ 205</b>	<b>\$ 1.067.002</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (21)	\$ 0	\$ (21)	\$ 61	\$ 0	\$ 61
BOA	(65)	0	(65)	286	(290)	(4)
BPS	(3.737)	3.350	(387)	156	0	156
BRC	52	0	52	(2.528)	3.690	1.162
BSH	1	0	1	(434)	410	(24)
CBK	(65)	0	(65)	564	(670)	(106)
FAR	2.759	(2.940)	(181)	(21)	0	(21)
GLM	1.041	(910)	131	(97)	250	153
GST	(5)	0	(5)	9	0	9
MBC	29	(270)	(241)	64	0	64
MYC	(25)	10	(15)	(68)	10	(58)
MYI	49	(10)	39	287	(260)	27
RBC	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(4)	0	(4)	219	(310)	(91)
SAL	(4)	94	90	(30)	94	64
SCX	86	0	86	1.659	(2.030)	(371)
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	1.258	(1.080)	178
TOR	(86)	100	14	163	0	163
UAG	(1)	0	(1)	1.221	(1.140)	81

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	58,92	62,81
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	61,11	70,04
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,74	0,12
Investmentfonds	9,99	8,99
Pensionsgeschäfte	8,13	0,36
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,40)	(1,37)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,01)	(0,55)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,00)	0,35
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,03)	(5,28)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(1,92)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,41	1,36
Unternehmensanleihen und Wechsel	26,23	27,83
Kommunalanleihen und Wechsel	1,08	0,99
US-Regierungsbehörden	47,79	48,04
US-Schatzobligationen	13,12	14,38
Non-Agency-MBS	7,19	10,43
Forderungsbesicherte Wertpapiere	21,84	24,51
Staatsemissionen	3,97	4,19
Stammaktien	0,01	0,01
Vorzugswertpapiere	0,01	0,01
Kurzfristige Instrumente	0,12	1,22
Investmentfonds	9,99	8,99
Pensionsgeschäfte	8,13	0,36
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,40)	(1,37)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,01)	(0,35)
Zinsswaps	(0,01)	(0,21)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,08	k. A.
Zinsswapoptionen	0,01	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,04)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,02)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,58	(0,27)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,61)	0,65
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,03)	(5,28)
Sonstige Aktiva und Passiva	(35,45)	(35,47)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities ESG Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 7,089 % - 7,095 % fällig am 08.11.2030	\$ 20	\$ 20	0,38	Pacific Life Global Funding 1,375 % fällig am 14.04.2026	\$ 19	\$ 18	0,34	Xylem, Inc. 1,950 % fällig am 30.01.2028	\$ 30	\$ 27	0,51
				Prologis International Funding S.A. 0,875 % fällig am 09.07.2029	€ 125	115	2,17			459	8,64
				Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % fällig am 09.09.2026	\$ 30	30	0,56	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
Aflac, Inc. 1,125 % fällig am 15.03.2026	19	18	0,34	SBA Communications Corp. 3,875 % fällig am 15.02.2027	18	17	0,32	AES Corp. 5,450 % fällig am 01.06.2028	20	20	0,38
Alexandria Real Estate Equities, Inc. 2,950 % fällig am 15.03.2034	14	11	0,21	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 5,500 % fällig am 09.03.2028	200	203	3,81	Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	14	12	0,23
American Tower Corp. 1,450 % fällig am 15.09.2026	36	33	0,62	Toronto-Dominion Bank 5,264 % fällig am 11.12.2026	20	20	0,38	Duke Energy Florida LLC 2,500 % fällig am 01.12.2029	54	48	0,90
Bank of America Corp. 2,456 % fällig am 22.10.2025	52	52	0,98	Volkswagen Leasing GmbH 3,625 % fällig am 11.10.2026	€ 30	32	0,60	Electricite de France S.A. 4,125 % fällig am 17.06.2031	€ 100	108	2,03
Citigroup, Inc. 6,054 % fällig am 25.01.2026	50	50	0,94	Wells Fargo & Co. 4,540 % fällig am 15.08.2026	\$ 50	49	0,92	New York State Electric & Gas Corp. 5,650 % fällig am 15.08.2028	\$ 30	31	0,58
Corebridge Financial, Inc. 3,850 % fällig am 05.04.2029	18	17	0,32	Weyerhaeuser Co. 4,750 % fällig am 15.05.2026	36	36	0,68	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	54	48	0,90
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 10.06.2026	€ 25	26	0,49			1.449	27,27	Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig am 18.09.2030	25	20	0,38
Equinix, Inc. 1,000 % fällig am 15.09.2025	\$ 28	27	0,51	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Vodafone Group PLC 5,125 % fällig am 04.06.2081	18	13	0,25
1,550 % fällig am 15.03.2028	30	26	0,49	Ball Corp. 2,875 % fällig am 15.08.2030	16	13	0,24			300	5,65
Equitable Financial Life Global Funding 1,300 % fällig am 12.07.2026	28	26	0,49	Elevance Health, Inc. 2,550 % fällig am 15.03.2031	28	24	0,45	<b>Summe Unternehmensanleihen und Wechsel</b>			
Europäische Investitionsbank 2,375 % fällig am 24.05.2027	67	63	1,19	FactSet Research Systems, Inc. 3,450 % fällig am 01.03.2032	18	16	0,30	<b>2.208 41,56</b>			
Goldman Sachs Group, Inc. 0,855 % fällig am 12.02.2026	30	29	0,55	Ford Motor Co. 6,100 % fällig am 19.08.2032	10	10	0,19	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
4,387 % fällig am 15.06.2027	49	48	0,90	HCA, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2032	28	25	0,47	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.07.2053	95	87	1,64
HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	16	15	0,28	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,750 % fällig am 01.05.2029	18	16	0,30	5,000 % fällig am 01.05.2053 - 01.10.2053	1.462	1.414	26,61
HSBC Holdings PLC 5,750 % fällig am 20.12.2027	€ 16	20	0,38	MSCI, Inc. 3,625 % fällig am 01.09.2030	22	20	0,38	5,500 % fällig am 01.08.2053	93	91	1,72
Hudson Pacific Properties LP 5,950 % fällig am 15.02.2028	\$ 10	9	0,17	NTT Finance Corp. 0,082 % fällig am 13.12.2025	€ 100	102	1,92	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2054	220	195	3,67
JPMorgan Chase & Co. 2,947 % fällig am 24.02.2028	52	49	0,92	Nucor Corp. 4,300 % fällig am 23.05.2027	\$ 10	10	0,19			1.787	33,64
6,070 % fällig am 22.10.2027	50	51	0,96	NXP BV 2,500 % fällig am 11.05.2031	50	42	0,79	<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
Kilroy Realty LP 2,650 % fällig am 15.11.2033	20	15	0,28	S&P Global, Inc. 4,750 % fällig am 01.08.2028	48	48	0,90	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (a) 0,625 % fällig am 15.07.2032	108	97	1,82
Manulife Financial Corp. 3,703 % fällig am 16.03.2032	26	24	0,45	VMware LLC 3,900 % fällig am 21.08.2027	18	17	0,32	1,125 % fällig am 15.01.2033	105	97	1,83
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3,741 % fällig am 07.03.2029	50	47	0,89	Walt Disney Co. 2,200 % fällig am 13.01.2028	52	47	0,89	1,375 % fällig am 15.07.2033	103	98	1,84
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027	€ 100	107	2,01	Warnermedia Holdings, Inc. 4,054 % fällig am 15.03.2029	28	26	0,49	U.S. Treasury Notes 5,000 % fällig am 30.09.2025 (b)	400	400	7,53
Morgan Stanley 6,407 % fällig am 01.11.2029	\$ 25	26	0,49	Western Digital Corp. 4,750 % fällig am 15.02.2026	16	16	0,30			692	13,02
NatWest Group PLC 4,067 % fällig am 06.09.2028	€ 100	108	2,03	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>				<b>\$ 4.837 91,05</b>			

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 911	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	\$ (929)	\$ 911	\$ 911	17,15
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (929)</b>	<b>\$ 911</b>	<b>\$ 911</b>	<b>17,15</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	2	\$ (1)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	1	(2)	(0,04)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	2	\$ (1)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	2	(1)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	2	(1)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	2	0	0,00
				\$ (6)	(0,12)

## VERKAUFSOPTIONEN

## FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 112,000	26.07.2024	1	\$ (1)	\$ 0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	109,000	26.07.2024	1	0	(1)	(0,01)
				\$ (1)	\$ (1)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate						\$ (7) (0,13)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000 %	18.09.2029	£ 100	\$ (1)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,550	14.09.2028	¥ 30,000	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,582	31.10.2030	\$ 100	3	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,592	31.10.2030	300	9	0,17
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,602	31.10.2030	100	3	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,606	31.10.2030	100	3	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,687	31.10.2030	100	3	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,722	31.10.2030	100	2	0,04
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	200	1	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,768	04.01.2027	BRL 1,400	(5)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,496	04.01.2027	200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,691	04.01.2027	800	1	0,02
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	CAD 500	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 50	1	0,02
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	225	(3)	(0,06)
					\$ 17	0,32
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 17 0,32

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## OPTIONSKAUF

## DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BRC	Call - OTC USD versus JPY	¥ 153,500	05.07.2024	50	\$ 0	\$ 2	0,04

## VERKAUFSOPTIONEN

## DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BRC	Call - OTC USD versus JPY	¥ 157,250	05.07.2024	100	\$ 0	\$ (2)	(0,04)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## DEISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 559	\$ 607	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,15
BRC	07.2024	107	115	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 17	AUD 25	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
CBK	07.2024	BRL 232	\$ 43	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,02
	07.2024	€ 101	108	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 21	27	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 475	26	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 44	BRL 231	0	(3)	(3)	(0,06)
	07.2024	26	MXN 477	0	0	0	0,00
MBC	10.2024	43	BRL 234	0	(1)	(1)	(0,02)
	07.2024	¥ 469	\$ 3	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 27	£ 21	0	0	0	0,00
MYI	08.2024	£ 21	\$ 27	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 4	4	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	\$ 826	€ 771	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 771	\$ 827	0	0	0	0,00
				\$ 9	\$ (4)	\$ 5	0,09

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Institutional EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	07.2024	€ 0	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 93	€ 86	0	(1)	(1)	(0,02)
BRC	07.2024	€ 88	81	0	(1)	(1)	(0,02)
MBC	07.2024	€ 82	\$ 87	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 88	€ 82	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	€ 82	\$ 88	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 85	€ 78	0	(1)	(1)	(0,02)
SSB	08.2024	88	82	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 81	\$ 87	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 87	€ 81	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	(0,06)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
CBK	07.2024	£ 74	\$ 93	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 89	£ 70	0	0	0	0,00
	08.2024	93	74	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	£ 72	\$ 91	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 93	£ 73	0	(1)	(1)	(0,01)
SCX	08.2024	91	72	0	0	0	0,00
	07.2024	93	73	0	(1)	(1)	(0,02)
				\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	(0,03)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 0 0,00

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.08.2054	\$ 100	\$ (99)	(1,86)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (99)	(1,86)
Summe Anlagen		\$ 5.659	106,53
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (347)	(6,53)
Nettovermögen		\$ 5.312	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 400 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 98 USD (31. Dezember 2023: 69 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 4.837	\$ 0	\$ 4.837
Pensionsgeschäfte	0	911	0	911
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(4)	14	0	10
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(99)	0	(99)
<b>Summen</b>	<b>\$ (4)</b>	<b>\$ 5.663</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 5.659</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.199	\$ 0	\$ 5.199
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(8)	(22)	0	(30)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(100)	0	(100)
<b>Summen</b>	<b>\$ (8)</b>	<b>\$ 5.077</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 5.069</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettover- mögens
BOS	5,480 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ (405)	\$ (405)	(7,62)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (405)</b>	<b>(7,62)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 7	\$ 0	\$ 7	\$ 1	\$ 0	\$ 1
BRC	(1)	0	(1)	2	0	2
CBK	(3)	0	(3)	1	0	1
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
MBC	(1)	0	(1)	(2)	0	(2)
MYI	0	0	0	1	0	1
SCX	(2)	0	(2)	0	0	0
MBC	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	46,06	52,20
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	44,99	47,38
Pensionsgeschäfte	17,15	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,13)	(1,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,32	0,35
Freiverkehrsfinanzderivate	0,00	0,10
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,86)	(1,92)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(7,62)	k. A.

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,38	0,38
Unternehmensanleihen und Wechsel	41,56	39,09
US-Regierungsbehörden	33,64	37,13
US-Schatzobligationen	13,02	13,35
Forderungsbesicherte Wertpapiere	1,85	2,08
Staatsemissionen	0,60	k. A.
Kurzfristige Instrumente	k. A.	7,55
Pensionsgeschäfte	17,15	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,12)	(1,02)
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,32	0,35
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,04	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,04)	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,09	0,02
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,09)	0,08
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,86)	(1,92)
Sonstige Aktiva und Passiva	(6,53)	2,91
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KANADA</b>											
<b>STAMMAKTIE</b>											
Enbridge, Inc.	62.200	\$ 2.213	1,97	ONEOK, Inc.	63.330	\$ 5.165	4,59	5,371 % fällig am 06.08.2024 (b)(c)	\$ 4.900	\$ 4.874	4,33
Parkland Corp. (e)	34.600	970	0,86	Targa Resources Corp.	27.500	3.542	3,15	5,381 % fällig am 01.08.2024 (b)(c)	1.700	1.692	1,50
TC Energy Corp.	84.600	3.206	2,85	Williams Cos., Inc.	124.900	5.308	4,72	5,381 % fällig am 22.10.2024 (b)(c)	1.400	1.377	1,22
Summe Kanada		6.389	5,68			37.162	33,04	5,386 % fällig am 01.08.2024 (b)(c)	1.100	1.095	0,97
<b>USA</b>											
<b>STAMMAKTIE</b>											
<b>ENERGIE</b>											
Antero Midstream Corp.	129.400	1.907	1,70	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Cheniere Energy, Inc.	14.033	2.453	2,18								
Chesapeake Energy Corp.	31.100	2.556	2,27	Vital Energy, Inc.				5,392 % fällig am 15.10.2024 (b)(c)	1.800	1.773	1,58
DTE Midstream LLC	57.700	4.098	3,64	9,875 % fällig am 01.02.2032	\$ 2.350	2.559	2,28	5,393 % fällig am 13.08.2024 (b)(c)	1.700	1.689	1,50
EnLink Midstream LLC	322.200	4.434	3,94	7,875 % fällig am 15.04.2032	100	102	0,09	5,402 % fällig am 03.09.2024 (b)(c)	6.500	6.440	5,73
EQT Corp.	67.100	2.481	2,21	Summe USA		39.823	35,41	5,403 % fällig am 10.09.2024 (b)(c)	2.600	2.573	2,29
Kinder Morgan, Inc.	262.600	5.218	4,64	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
				<b>U.S. TREASURY BILLS</b>							
				5,357 % fällig am 30.07.2024 (a)(b)(c)	2.400	2.390	2,13	<b>Summe kurzfristige Instrumente</b>			
				5,362 % fällig am 26.09.2024 (b)(c)	23.400	23.106	20,54				
				<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>							
				<b>\$ 99.505 88,47</b>							
				<b>AKTIEN</b>							
				<b>INVESTMENTFONDS</b>							
				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>							
				PIMCO Select Funds plc							
				- PIMCO US Dollar							
				Short-Term Floating NAV Fund (d)							
					1.093.920	10.901	9,69	<b>Summe Investmentfonds</b>			
				<b>\$10.901 9,69</b>							

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(k)</sup>	% des Nettover-mögens
SSB	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 1.122	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	\$ (1.144)	\$ 1.122	\$ 1.122	1,00
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.144)	\$ 1.122	\$ 1.122	1,00

(k) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES**

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettover-mögens
FAR	Erhalt	AMZX Index	521	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 1.108	14.08.2024	\$ 0	\$ 45	\$ 45	0,04
JPM	Erhalt	AMNAX Index	6.229	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.557	21.08.2024	0	127	127	0,11
	Erhalt	AMZX Index	6.264	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	13.316	16.10.2024	0	535	535	0,48
							\$ 0	\$ 707	\$ 707	0,63

**TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE**

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettover-mögens
BOA	Erhalt	Energy Transfer LP	243.020	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 3.808	16.10.2024	\$ 0	\$ 117	\$ 117	0,10
	Erhalt	MPLX LP	204.200	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	8.307	13.11.2024	0	354	354	0,32
	Erhalt	Plains All American Pipeline LP	62.756	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.067	13.11.2024	0	49	49	0,04
	Erhalt	Energy Transfer LP	224.369	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.516	08.01.2025	0	108	108	0,10
	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	259.470	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	7.395	08.01.2025	0	93	93	0,08
	Erhalt	Western Gas Partners LP	36.461	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.361	08.01.2025	0	82	82	0,07
CBK	Erhalt	Energy Transfer LP	169.884	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.662	16.10.2024	0	81	81	0,07
MYI	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	25.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	713	16.10.2024	0	9	9	0,01
	Erhalt	Western Gas Partners LP	151.021	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.636	16.10.2024	0	340	340	0,30
	Erhalt	Plains All American Pipeline LP	426.400	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	7.253	08.01.2025	0	331	331	0,30
							\$ 0	\$ 1.564	\$ 1.564	1,39

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Forts.)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2024	\$ 113	£ 89	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
MBC	07.2024	CAD 6.563	\$ 4.820	25	0	25	0,02
	07.2024	£ 89	113	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 7.059	CAD 9.666	4	0	4	0,00
	08.2024	CAD 9.659	\$ 7.059	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	\$ 113	£ 89	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	CAD 36	\$ 26	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 184	197	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 42	€ 39	0	0	0	0,00
SSB	07.2024	CAD 1.427	\$ 1.044	1	0	1	0,00
TOR	07.2024	1.633	1.188	0	(6)	(6)	(0,01)
				\$ 30	\$ (11)	\$ 19	0,01

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Institutional EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 440	\$ 473	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2024	\$ 16.837	€ 15.508	0	(217)	(217)	(0,19)
BPS	07.2024	€ 14.449	\$ 15.455	0	(31)	(31)	(0,03)
	07.2024	\$ 16.238	€ 14.966	0	(166)	(166)	(0,15)
	08.2024	15.398	14.375	31	0	31	0,03
CBK	07.2024	€ 296	\$ 317	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 5	€ 5	0	0	0	0,00
FAR	07.2024	16.261	14.930	0	(261)	(261)	(0,23)
GLM	07.2024	€ 7	\$ 7	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	\$ 158	€ 147	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	€ 15.288	\$ 16.349	1	(37)	(36)	(0,03)
	07.2024	\$ 6	€ 5	0	0	0	0,00
	08.2024	16.274	15.198	38	0	38	0,03
	07.2024	22	20	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	€ 36	\$ 38	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	\$ 933	€ 872	2	0	2	0,00
SCX	07.2024	€ 15.148	\$ 16.229	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	\$ 4	€ 4	0	0	0	0,00
	08.2024	16.253	15.148	5	0	5	0,00
SSB	07.2024	€ 825	\$ 895	11	0	11	0,01
UAG	08.2024	34	37	0	0	0	0,00
				\$ 90	\$ (717)	\$ (627)	(0,56)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 549	\$ 695	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 1.396	£ 1.096	0	(11)	(11)	(0,01)
	08.2024	674	533	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	£ 38	\$ 49	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 72	£ 57	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	708	555	0	(7)	(7)	(0,01)
MBC	07.2024	£ 562	\$ 712	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 4	£ 3	0	0	0	0,00
	08.2024	712	562	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07.2024	£ 560	\$ 710	2	0	2	0,01
	08.2024	\$ 711	£ 560	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 3	\$ (21)	\$ (18)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 1.645	1,46
Summe Anlagen						\$ 113.173	100,62
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (695)	(0,62)
Nettovermögen						\$ 112.478	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: null):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Parkland Corp.	23.04.2024 – 24.04.2024	\$ 1.079	\$ 970	0,86

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 475 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2023: 970 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. Als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 43.551	\$ 55.954	\$ 0	\$ 99.505
Investmentfonds	10.901	0	0	10.901
Pensionsgeschäfte	0	1.122	0	1.122
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	1.645	0	1.645
<b>Summen</b>	<b>\$ 54.452</b>	<b>\$ 58.721</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 113.173</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 42.027	\$ 46.018	\$ 0	\$ 88.045
Investmentfonds	9.668	0	0	9.668
Pensionsgeschäfte	0	631	0	631
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	(32)	0	(32)
<b>Summen</b>	<b>\$ 51.695</b>	<b>\$ 46.617</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 98.312</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 588	\$ (390)	\$ 198	\$ (111)	\$ 475	\$ 364
BPS	(177)	0	(177)	6	0	6
CBK	80	0	80	(24)	0	(24)
DUB	(7)	0	(7)	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(216)	0	(216)	(3)	0	(3)
JPM	662	(540)	122	(69)	410	341
MBC	27	0	27	71	0	71
MYI	680	(520)	160	24	560	584
RYL	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	5	0	5
SSB	12	0	12	4	0	4
TOR	(6)	0	(6)	65	0	65

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	81,69	74,81
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	6,78	14,58
Investmentfonds	9,69	9,82
Pensionsgeschäfte	1,00	0,64
Freiverkehrsfinanzderivate	1,46	(0,03)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kanada	5,68	k. A.
USA	35,41	42,67
Kurzfristige Instrumente	47,38	46,72
Investmentfonds	9,69	9,82
Pensionsgeschäfte	1,00	0,64
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	0,63	(0,07)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	1,39	(0,18)
Devisenterminkontrakte	0,01	(0,01)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,57)	0,23
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,62)	0,18
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				4,385 % fällig am 01.04.2033	\$ 718	\$ 698	0,06	2,452 % fällig am 15.12.2031 (a)	\$ 41	\$ 4	0,00
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,440 % fällig am 01.06.2033	1.573	1.535	0,13	2,500 % fällig am 15.11.2027 - 15.10.2052 (a)	101.889	14.010	1,15
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				4,490 % fällig am 01.04.2033	300	294	0,02	2,920 % fällig am 01.09.2036	1.301	1.057	0,09
<b>SLM Student Loan Trust</b>				4,500 % fällig am 25.06.2029 - 25.09.2046 (a)	3.481	494	0,04	3,000 % fällig am 15.03.2027 - 15.10.2052 (a)	130.596	20.329	1,67
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				4,500 % fällig am 01.11.2032 - 01.04.2059	5.918	5.691	0,47	3,000 % fällig am 15.12.2046 - 15.04.2049 (a)	856	120	0,01
<b>Times Square Hotel Trust</b>				4,580 % fällig am 01.08.2033	1.000	986	0,08	3,188 % fällig am 15.12.2027 (a)	287	11	0,00
<b>8,528 % fällig am 01.08.2026</b>				\$ 66	\$ 65	0,01	3,283 % fällig am 25.12.2036	6.573	5.273	0,43	
<b>Summe Unternehmensanleihen und Wechsel</b>						587	0,05	3,500 % fällig am 15.03.2029 - 15.10.2052 (a)	67.236	11.929	0,98
<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,000 % fällig am 25.09.2035 (a)	169	26	0,00	3,500 % fällig am 01.01.2038 - 01.12.2046	824	756	0,06
<b>Detroit, Michigan General Obligation Bonds, Series 2014</b>				5,034 % fällig am 01.08.2049	382	389	0,03	3,554 % fällig am 25.09.2024	6.100	5.972	0,49
<b>4,000 % fällig am 01.04.2044</b>				2.000	1.576	0,13	4,000 % fällig am 15.10.2041 - 25.08.2050 (a)	22.917	4.961	0,41	
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				5,270 % fällig am 01.08.2032	3.866	3.975	0,33	4,000 % fällig am 01.03.2046 - 01.04.2048	9.337	8.787	0,72
<b>Fannie Mae</b>				5,410 % fällig am 01.04.2029	2.220	2.268	0,19	4,190 % fällig am 01.05.2030	2.500	2.399	0,20
<b>0,000 % fällig am 25.03.2033 - 25.03.2047</b>				3.269	2.129	0,18	4,500 % fällig am 15.02.2037 - 25.10.2051 (a)	5.302	1.134	0,09	
<b>0,000 % fällig am 25.05.2033 - 25.05.2048 (b)(d)</b>				3.691	2.779	0,23	4,500 % fällig am 15.11.2040 - 01.02.2048	1.105	1.068	0,09	
<b>0,000 % fällig am 25.06.2043 - 25.02.2052 (a)</b>				139.272	1.679	0,14	4,660 % fällig am 25.01.2031	2.200	2.172	0,18	
<b>0,061 % fällig am 25.01.2051 (a)</b>				14.651	652	0,05	5,000 % fällig am 15.08.2035 - 25.05.2048 (a)	1.569	253	0,02	
<b>0,109 % fällig am 25.12.2050 (a)</b>				8.480	315	0,03	5,000 % fällig am 01.03.2049	2.359	2.329	0,19	
<b>0,200 % fällig am 25.02.2043 (a)</b>				2.120	14	0,00	6,036 % fällig am 15.03.2050	488	489	0,04	
<b>0,215 % fällig am 25.08.2033</b>				222	200	0,02	6,224 % fällig am 15.12.2050	490	486	0,04	
<b>0,232 % fällig am 25.09.2046 (a)</b>				8.171	454	0,04	6,226 % fällig am 15.04.2049	491	482	0,04	
<b>0,281 % fällig am 25.08.2033</b>				64	58	0,00	6,308 % fällig am 15.08.2048	1.655	1.666	0,14	
<b>0,383 % fällig am 25.03.2045 (a)</b>				2.025	101	0,01	<b>Ginnie Mae</b>				
<b>0,490 % fällig am 25.06.2052 (a)</b>				4.076	230	0,02	<b>0,000 % fällig am 20.08.2033 - 20.01.2044 (b)(d)</b>				
<b>0,500 % fällig am 25.04.2044 (a)</b>				1.341	123	0,01	<b>0,000 % fällig am 20.09.2040 - 20.08.2047 (a)</b>				
<b>0,550 % fällig am 25.05.2046 - 25.01.2050 (a)</b>				17.939	2.069	0,17	<b>0,000 % fällig am 20.11.2045</b>				
<b>0,575 % fällig am 25.03.2060 (a)</b>				4.976	231	0,02	<b>0,097 % fällig am 20.09.2043 (a)</b>				
<b>0,600 % fällig am 25.10.2042 - 25.07.2059 (a)</b>				10.678	1.155	0,09	<b>0,267 % fällig am 20.09.2045 (a)</b>				
<b>0,602 % fällig am 25.04.2047 (a)</b>				4.346	242	0,02	<b>0,607 % fällig am 16.04.2040 - 16.08.2042 (a)</b>				
<b>0,650 % fällig am 25.06.2037 - 25.07.2050 (a)</b>				17.166	1.872	0,15	<b>0,647 % fällig am 20.01.2035 - 20.08.2049 (a)</b>				
<b>0,700 % fällig am 25.02.2046 - 25.09.2048 (a)</b>				7.709	864	0,07	<b>0,747 % fällig am 20.03.2035 - 20.09.2048 (a)</b>				
<b>0,711 % fällig am 25.07.2045 (a)</b>				3.538	154	0,01	<b>0,797 % fällig am 20.07.2044 (a)</b>				
<b>0,725 % fällig am 25.11.2047 (a)</b>				12.702	532	0,04	<b>0,957 % fällig am 16.01.2038 (a)</b>				
<b>0,750 % fällig am 25.11.2047 - 25.06.2048 (a)</b>				26.688	2.991	0,25	<b>1,007 % fällig am 16.02.2040 (a)</b>				
<b>0,776 % fällig am 25.02.2062 (a)</b>				7.578	410	0,03	<b>1,247 % fällig am 20.05.2041 (a)</b>				
<b>0,800 % fällig am 25.04.2043 (a)</b>				1.702	96	0,01	<b>2,500 % fällig am 20.09.2027 (a)</b>				
<b>0,850 % fällig am 25.05.2030 (a)</b>				1.078	47	0,00	<b>2,500 % fällig am 20.09.2051</b>				
<b>1,080 % fällig am 25.01.2041 (a)</b>				472	58	0,00	<b>3,000 % fällig am 20.12.2047 - 20.10.2051</b>				
<b>1,150 % fällig am 25.09.2040 - 25.09.2042 (a)</b>				2.529	222	0,02	<b>3,000 % fällig am 20.12.2049 (a)</b>				
<b>1,200 % fällig am 25.05.2034 (a)</b>				28	0	0,00	<b>3,250 % fällig am 20.01.2047</b>				
<b>1,350 % fällig am 25.12.2032 (a)</b>				395	34	0,00	<b>3,500 % fällig am 20.09.2029 - 20.09.2046 (a)</b>				
<b>1,500 % fällig am 25.04.2037 - 25.01.2052 (a)</b>				57.009	3.168	0,26	<b>3,500 % fällig am 20.03.2042 - 20.01.2052</b>				
<b>1,650 % fällig am 25.11.2033 - 25.10.2034 (a)</b>				517	26	0,00	<b>4,000 % fällig am 15.04.2047 - 15.08.2048</b>				
<b>1,750 % fällig am 25.10.2042 (a)</b>				377	48	0,00	<b>4,500 % fällig am 20.07.2040 - 20.02.2049</b>				
<b>2,000 % fällig am 25.07.2037 - 25.06.2052 (a)</b>				79.720	9.759	0,80	<b>4,500 % fällig am 20.05.2043 - 20.09.2047 (a)</b>				
<b>2,150 % fällig am 25.11.2033 (a)</b>				36	3	0,00	<b>5,000 % fällig am 20.06.2040 - 20.11.2048</b>				
<b>2,500 % fällig am 25.12.2027 - 25.10.2052 (a)</b>				185.307	26.492	2,18	<b>5,000 % fällig am 20.09.2040 (a)</b>				
<b>3,000 % fällig am 25.11.2027 - 25.10.2052 (a)</b>				189.428	31.046	2,55	<b>5,633 % fällig am 20.01.2068 - 20.09.2073</b>				
<b>3,000 % fällig am 01.02.2057 - 01.07.2060</b>				21.710	18.230	1,50	<b>5,890 % fällig am 20.03.2058</b>				
<b>3,500 % fällig am 25.02.2028 - 25.04.2053 (a)</b>				25.756	4.122	0,34	<b>5,917 % fällig am 20.04.2065</b>				
<b>3,510 % fällig am 01.03.2029</b>				1.085	1.031	0,08	<b>6,000 % fällig am 20.02.2047</b>				
<b>3,870 % fällig am 01.07.2027</b>				1.600	1.534	0,13	<b>6,037 % fällig am 20.05.2069</b>				
<b>4,000 % fällig am 25.04.2032 (a)</b>				341	31	0,00	<b>6,087 % fällig am 20.02.2070</b>				
<b>4,000 % fällig am 25.10.2040 - 25.06.2050 (a)</b>				18.745	3.036	0,25	<b>Ginnie Mae</b>				
<b>4,000 % fällig am 25.05.2050</b>				2.080	1.657	0,14	<b>6,200 % fällig am 01.08.2074 (c)</b>				
<b>4,032 % fällig am 25.05.2051 (a)</b>				2.572	398	0,03	<b>6,230 % fällig am 20.06.2074 (c)</b>				
<b>4,140 % fällig am 01.04.2028</b>				677	661	0,05	<b>6,233 % fällig am 20.07.2073 - 20.01.2074</b>				
<b>4,374 % fällig am 01.02.2028</b>				2.000	1.956	0,16	<b>6,263 % fällig am 20.01.2074</b>				
							<b>6,283 % fällig am 20.09.2073</b>				
							<b>43.967</b>				
							<b>5.489</b>				
							<b>0,45</b>				
							<b>213</b>				
							<b>203</b>				
							<b>0,02</b>				





## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>		
								\$	% des Nettover-mögens	
BOS	5,220 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 2.800	U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.11.2041	\$ (2.851)	\$ 2.800	\$ 2.801	0,23	
	5,390	28.06.2024	01.07.2024	10.200	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	(10.186)	10.200	10.205	0,84	
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	1.185	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(1.209)	1.185	1.185	0,10	
Summe Pensionsgeschäfte							\$ (14.246)	\$ 14.185	\$ 14.191	1,17

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	1.093	\$ 507	0,04
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2026	1.093	58	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	815	(522)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	124	(104)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	479	(712)	(0,06)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	27	(17)	0,00
				\$ (790)	(0,07)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (790)	(0,07)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	18.09.2054	£ 400	\$ 23	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	2.300	(30)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,827	03.07.2028	\$ 39.385	(4.382)	(0,36)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,790	07.05.2029	14.800	571	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	3.100	(201)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,043	07.08.2028	14.800	(755)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	400	9	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	07.02.2034	76.000	2.836	0,23
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	13.02.2034	24.700	901	0,08
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.02.2034	61.000	2.113	0,17
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	01.03.2034	35.500	1.237	0,10
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	06.03.2034	35.500	1.257	0,10
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2034	8.700	824	0,07
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2034	4.700	(77)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,510	08.03.2033	100	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,545	31.10.2030	400	13	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,547	31.10.2030	1.000	32	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,550	31.10.2030	900	28	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,572	31.10.2030	900	27	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,582	31.10.2030	1.500	45	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,595	31.10.2030	1.100	32	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,601	31.10.2030	2.000	57	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,602	31.10.2030	2.000	57	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,606	31.10.2030	900	25	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,623	31.10.2030	900	25	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,638	31.05.2028	800	17	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,655	31.05.2028	1.500	30	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,664	31.10.2030	500	12	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,677	31.10.2030	400	10	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,687	31.10.2030	800	19	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,689	31.10.2030	1.200	28	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,691	31.10.2030	900	21	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,705	10.01.2031	1.200	(36)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,721	31.10.2030	500	11	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,722	31.10.2030	500	11	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,727	31.10.2030	500	11	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,732	31.10.2030	400	8	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	31.10.2030	500	10	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,739	31.10.2030	500	10	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,740	10.07.2030	1.500	(43)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,749 %	31.10.2030	\$ 500	\$ 10	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2028	100	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	52.800	(540)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	1.800	61	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	11.000	(159)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	14.500	482	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	3.800	19	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	28.700	(296)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	15.000	186	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,807	31.05.2028	500	7	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,916	10.06.2031	40.900	87	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	10.04.2029	23.600	(149)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	2.400	15	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,320	10.10.2030	800	9	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,000	30.05.2025	79.100	4	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,000	18.06.2025	33.500	(27)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	€ 2.400	1.013	0,08
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	22.000	(366)	(0,03)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	13.600	337	0,03
					<b>\$ 5.478</b>	<b>0,45</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 5.478</b>	<b>0,45</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500 %	13.01.2025	28.000	\$ 189	\$ 35	0,00
BPS	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	17.10.2025	21.500	43	19	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,483	25.11.2024	20.900	132	157	0,01
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,483	25.11.2024	20.900	132	99	0,01
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,348	06.12.2024	20.000	150	126	0,01
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,000	22.04.2025	8.000	73	67	0,01
BRC	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,250	17.03.2025	8.000	44	14	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	27.12.2024	28.400	119	30	0,00
CBK	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	13.900	79	128	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	25.09.2025	80.700	133	125	0,01
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750	31.10.2024	19.900	17	33	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	02.09.2025	25.000	47	37	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	16.12.2024	39.000	46	8	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	03.11.2025	21.100	36	20	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	6,000	02.09.2025	25.000	19	11	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,500	21.02.2025	4.800	44	11	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.08.2024	5.100	104	10	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	25.03.2025	16.300	329	226	0,02
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,200	19.08.2024	5.100	104	19	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	20.05.2025	24.300	702	487	0,04
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,250	29.11.2024	31.200	745	329	0,03
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	03.01.2025	22.000	130	25	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	28.01.2025	1.400	8	2	0,00
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	20.000	107	185	0,02
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	10.10.2024	34.700	21	24	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,250	19.08.2024	32.800	66	4	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,300	13.03.2025	17.000	31	10	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	10.11.2025	11.500	90	106	0,01
	Put - OTC 6-Month Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	03.09.2024	50.000	25	45	0,00
	Put - OTC 6-Month Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,660	03.09.2024	50.000	4	1	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,500	10.03.2025	12.200	83	31	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,365	19.08.2024	5.500	102	6	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,265	19.08.2024	5.500	102	16	0,00
JPM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,250	03.03.2025	44.000	70	26	0,00
	Put - OTC 6-Month Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	23.08.2024	165.500	132	155	0,01
	Put - OTC 6-Month Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	23.08.2024	165.500	29	10	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,500	28.02.2025	2.700	27	6	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,000	16.04.2025	13.300	151	109	0,01
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	16.12.2024	14.600	61	13	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	13.01.2025	21.500	116	27	0,00
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	16.12.2024	16.800	28	14	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	25.03.2025	79.100	97	86	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,250	24.10.2024	34.000	28	10	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	21.01.2025	49.500	54	13	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	7,000	08.05.2025	40.700	7	2	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	21.03.2025	16.500	152	69	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,313 %	08.06.2026	20.000	\$ 411	\$ 448	0,04
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,372	05.12.2024	10.000	73	65	0,01
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,530	03.12.2024	20.000	135	174	0,01
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,313	08.06.2026	20.000	411	421	0,04
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,372	05.12.2024	10.000	73	65	0,01
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,530	03.12.2024	20.000	135	90	0,01
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,500	22.08.2025	17.000	211	102	0,01
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,000	16.04.2025	5.800	59	47	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,000	22.04.2025	6.600	66	55	0,01
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	03.01.2025	9.600	45	11	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	30.01.2025	14.000	67	21	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	6,000	17.10.2025	21.500	147	75	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,920	27.02.2025	12.200	509	433	0,04
							\$ 7.350	\$ 4.993	0,41

### ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
DUB	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,033 %	26.01.2027	255.000	\$ 3.060	\$ 1.425	0,12

<sup>(1)</sup> Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
BOA	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2054	\$ 98,109	06.08.2024	22.500	\$ 60	\$ 9	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2054	98,516	06.08.2024	16.000	32	10	0,00
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2054	98,094	06.08.2024	16.000	42	6	0,00
MSC	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2054	98,508	06.08.2024	8.000	16	5	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2054	98,656	06.08.2024	16.000	33	12	0,00
					\$ 183	\$ 42	0,00

### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
BOA	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,443 %	06.08.2024	17.900	\$ (48)	\$ (14)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,550	06.08.2024	17.900	(60)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,000	13.01.2025	14.000	(105)	(8)	0,00
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,500	02.09.2025	50.000	(57)	(40)	(0,01)
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	25.03.2025	16.300	(185)	(104)	(0,01)
GLM	Put - OTC 6-Month Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,330	03.09.2024	100.000	(15)	(19)	0,00
JPM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,551	06.08.2024	12.700	(43)	(5)	0,00
	Put - OTC 6-Month Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,250	23.08.2024	331.000	(124)	(95)	(0,01)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	27.02.2025	46.400	(506)	(405)	(0,03)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,438	06.08.2024	12.000	(33)	(10)	0,00
							\$ (1.176)	\$ (708)	(0,06)

### ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
DUB	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,021 %	26.01.2027	255.000	\$ (1.158)	\$ (486)	(0,04)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,027	26.01.2027	255.000	(1.887)	(844)	(0,07)
						\$ (3.045)	\$ (1.330)	(0,11)

<sup>(1)</sup> Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	\$ 97,313	08.07.2024	75.000	\$ (261)	\$ (88)	(0,01)
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	94,969	08.07.2024	1.000	(4)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,266	08.07.2024	1.500	(3)	(2)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,719	08.07.2024	1.000	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,969	08.07.2024	1.000	(3)	0	0,00
MSC	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	95,781	08.07.2024	12.500	(25)	(12)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,250	08.07.2024	1.500	(3)	(2)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	96,617	08.07.2024	6.000	(11)	(21)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	96,789	08.07.2024	5.000	(9)	(21)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,969	08.07.2024	1.000	(3)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	98,109	08.07.2024	10.500	(30)	(2)	0,00
					\$ (354)	\$ (149)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	€ 10.584	\$ 11.390	\$ 46	\$ 0	\$ 46	0,00
	07.2024	£ 72.923	93.133	951	0	951	0,08
	07.2024	\$ 4.915	€ 4.595	10	0	10	0,00
	07.2024	€ 98.598	£ 77.973	0	(32)	(32)	0,00
	08.2024	€ 4.595	\$ 4.922	0	(10)	(10)	0,00
CBK	08.2024	£ 77.973	98.614	30	0	30	0,00
	07.2024	€ 932	999	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 470	601	6	0	6	0,00
FAR	07.2024	\$ 7.557	£ 5.934	0	(55)	(55)	0,00
	07.2024	€ 57.296	\$ 62.404	997	0	997	0,08
MBC	07.2024	1.941	2.106	26	0	26	0,00
	07.2024	£ 10.514	13.386	95	0	95	0,01
MYI	07.2024	€ 57	61	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 75	£ 59	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	€ 4.595	\$ 4.917	0	(8)	(8)	0,00
SCX	07.2024	\$ 75.805	€ 70.753	25	0	25	0,00
	08.2024	€ 70.753	\$ 75.916	0	(24)	(24)	0,00
				\$ 2.186	\$ (129)	\$ 2.057	0,17

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 6.227	CAD 8.478	\$ 0	\$ (31)	\$ (31)	0,00
CBK	07.2024	CAD 14.050	\$ 10.268	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 10.269	CAD 13.988	0	(47)	(47)	0,00
GLM	08.2024	10.268	14.041	0	0	0	0,00
	07.2024	257	351	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	CAD 28.411	\$ 20.752	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	\$ 14.431	CAD 19.649	0	(71)	(71)	(0,01)
	08.2024	20.752	28.392	12	0	12	0,00
				\$ 12	\$ (160)	\$ (148)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 639	CHF 575	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
CBK	07.2024	63	57	1	0	1	0,00
JPM	07.2024	CHF 670	\$ 747	1	0	1	0,00
	08.2024	\$ 747	CHF 668	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2024	19	17	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	CHF 5	\$ 5	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	\$ 733	CHF 662	4	0	4	0,00
UAG	07.2024	CHF 670	\$ 747	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 724	CHF 654	4	0	4	0,00
	08.2024	747	667	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 12	\$ (3)	\$ 9	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 27	\$ 29	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 125.143	€ 115.265	0	(1.607)	(1.607)	(0,13)
BPS	07.2024	€ 118.371	\$ 126.623	9	(250)	(241)	(0,02)
	07.2024	\$ 110.934	€ 102.470	0	(1.112)	(1.112)	(0,09)
	08.2024	124.549	116.274	249	0	249	0,02
BRC	07.2024	11.327	10.586	18	0	18	0,00
CBK	07.2024	€ 33	\$ 35	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2.738	€ 2.514	0	(44)	(44)	(0,01)
FAR	07.2024	122.006	112.019	0	(1.950)	(1.950)	(0,16)
GLM	07.2024	€ 97	\$ 105	1	0	1	0,00
JPM	07.2024	\$ 1.738	€ 1.624	3	0	3	0,00
MBC	07.2024	€ 116.570	\$ 124.648	0	(286)	(286)	(0,02)
	07.2024	\$ 5.574	€ 5.185	0	(17)	(17)	0,00
	08.2024	124.830	116.570	285	0	285	0,02
RBC	07.2024	32	30	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	310	290	1	0	1	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SCX	07.2024	€ 113.401	\$ 121.499	\$ 2	\$ (40)	\$ (38)	0,00
	08.2024	\$ 121.212	€ 112.968	38	0	38	0,00
SSB	07.2024	€ 3.647	\$ 3.908	1	(1)	0	0,00
	07.2024	\$ 2.319	€ 2.163	0	(1)	(1)	0,00
UAG	08.2024	3.819	3.560	1	0	1	0,00
	08.2024	€ 39	\$ 42	0	0	0	0,00
				\$ 608	\$ (5.308)	\$ (4.700)	(0,39)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 6.162	\$ 7.792	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2024	\$ 15.192	£ 11.922	0	(121)	(121)	(0,01)
	08.2024	7.793	6.162	0	(2)	(2)	0,00
BRC	07.2024	179	140	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2024	£ 62	\$ 79	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 422	£ 333	0	(2)	(2)	0,00
DUB	07.2024	7.779	6.096	0	(72)	(72)	(0,01)
MBC	07.2024	£ 6.355	\$ 8.043	9	0	9	0,00
	08.2024	\$ 7.792	£ 6.157	0	(7)	(7)	0,00
RBC	07.2024	£ 6.154	\$ 7.804	25	0	25	0,01
	08.2024	\$ 7.806	£ 6.154	0	(25)	(25)	0,00
RYL	07.2024	311	243	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 37	\$ (235)	\$ (198)	(0,01)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 1.293	0,11

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2039	\$ 22.800	\$ (20.039)	(1,65)
2,500 % fällig am 01.08.2054	105.500	(86.250)	(7,09)
3,000 % fällig am 01.07.2039	500	(463)	(0,04)
3,000 % fällig am 01.08.2054	113.850	(96.951)	(7,97)
3,500 % fällig am 01.08.2054	84.400	(74.720)	(6,14)
4,000 % fällig am 01.07.2039	7.800	(7.500)	(0,62)
5,500 % fällig am 01.07.2054	18.400	(18.149)	(1,49)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (304.072)	(25,00)
Summe Anlagen		\$ 1.953.658	160,62
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (737.351)	(60,62)
Nettovermögen		\$ 1.216.307	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- Reines Kapitalwertpapier.
- Wertpapier per Emissionstermin.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- Mit dem Fonds verbunden.
- Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 8.548 USD (31. Dezember 2023: 59.020 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 821 USD) wurde zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 1.837 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte geliefert.

Barmittel in Höhe von 15.016 USD (31. Dezember 2023: 6,307 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.190 USD (31. Dezember 2023: 460 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.218.531	\$ 19.029	\$ 2.237.560
Investmentfonds	4	0	0	4
Pensionsgeschäfte	0	14.185	0	14.185
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	5.981	0	5.981
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(304.072)	0	(304.072)
<b>Summen</b>	<b>\$ 4</b>	<b>\$ 1.934.625</b>	<b>\$ 19.029</b>	<b>\$ 1.953.658</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.894.376	\$ 7.833	\$ 1.902.209
Investmentfonds	4	0	0	4
Pensionsgeschäfte	0	68.968	0	68.968
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	3.083	0	3.083
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(432.300)	0	(432.300)
<b>Summen</b>	<b>\$ 4</b>	<b>\$ 1.534.127</b>	<b>\$ 7.833</b>	<b>\$ 1.541.964</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettöver- mögens
BOS	5,460 %	13.06.2024	15.07.2024	\$ (8.305)	\$ (8.328)	(0,68)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (8.328)</b>	<b>(0,68)</b>

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (1.701)	\$ 2.120	\$ 419	\$ (36)	\$ 0	\$ (36)
BPS	238	(10)	228	775	(600)	175
BRC	60	0	60	273	(370)	(97)
CBK	113	(300)	(187)	1.187	(1.300)	(113)
DUB	1.097	(1.170)	(73)	2.679	(2.490)	189
FAR	(953)	1.060	107	5	0	5
GLM	410	(420)	(10)	1.202	(1.050)	152
JPM	252	0	252	438	(340)	98
MBC	34	0	34	14	0	14
MSC	3	0	3	(70)	0	(70)
MYC	1.786	(1.760)	26	1.305	(1.250)	55
MYI	0	10	10	539	(1.070)	(531)
RYL	(11)	0	(11)	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(44)	0	(44)	(490)	460	(30)
SCX	1	0	1	50	0	50
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	49	0	49
TOR	4	0	4	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	4	0	4	798	(1.320)	(522)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	21,02	12,84
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	159,67	192,75
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,27	k. A.
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	1,17	7,45
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,07)	(0,35)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,45	(0,26)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,11	0,94
Leerverkaufte Wertpapiere	(25,00)	(46,72)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,68)	(60,04)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,09)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	0,05	0,07
Kommunalanleihen und Wechsel	0,13	k. A.
US-Regierungsbehörden	135,78	161,34
US-Schatzobligationen	0,62	0,80
Non-Agency-MBS	18,14	21,71
Forderungsbesicherte Wertpapiere	20,18	21,67
Kurzfristige Instrumente	9,06	k. A.
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	1,17	7,45
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,07)	(0,35)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,45	(0,26)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,41	0,88
Zinscaps	0,12	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,06)	(0,05)
Zinscaps	(0,11)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	(0,07)
Devisenterminkontrakte	0,17	(0,10)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,41)	0,28
Leerverkaufte Wertpapiere	(25,00)	(46,72)
Sonstige Aktiva und Passiva	(60,62)	(66,65)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>









Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover-mögens
	4,720 %	25.06.2024	03.07.2024	CAD 40.000	Province of Ontario 2,600 % fällig am 02.06.2027	\$ (29.851)	\$ 29.232	\$ 29.255	0,80
	4,720	27.06.2024	05.07.2024	160.000	Province of Ontario 3,500 % fällig am 02.06.2043	(7.920)	116.930	116.990	3,21
					Province of Quebec 2,850 % fällig am 01.12.2053	(110.444)			
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	\$ 12.432	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(12.681)	12.432	12.432	0,34
GSC	5,400	28.06.2024	01.07.2024	161.400	Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.11.2052	(166.836)	161.400	161.473	4,43
JPS	5,430	28.06.2024	01.07.2024	200.000	U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.08.2025	(204.146)	200.000	200.091	5,50
MFK	5,430	28.06.2024	01.07.2024	200.000	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052	(200.157)	200.000	200.091	5,50
SAL	5,400	28.06.2024	01.07.2024	70.000	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 31.05.2026	(71.400)	70.000	70.032	1,92
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.361.436)	\$ 1.333.842	\$ 1.334.478	36,64

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

#### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2024	565	\$ 8	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2024	6.237	1.210	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	6	(11)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	3	(10)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	318	33	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	52	(4)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	756	(112)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	52	(45)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	6	(2)	0,00
				\$ 1.067	0,03
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 1.067	0,03

#### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 2.500	\$ (13)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	1.100	(3)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	700	15	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	800	(5)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2028	300	1	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.700	15	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	3.700	33	0,00
				\$ 43	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000 %	20.12.2028	\$ 30.800	\$ (24)	0,00
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	884.700	(568)	(0,02)
				\$ (592)	(0,02)

#### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750 %	15.06.2032	\$ 28.900	\$ 586	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,875	07.02.2050	300	157	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.01.2050	900	484	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	20.03.2050	1.900	1.012	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	3.200	398	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	7.100	284	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	12.300	297	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.09.2025	3.500	46	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500 %	20.12.2030	\$ 37.700	\$ 1.252	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	1.200	78	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	29.300	(223)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2028	21.900	530	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2028	56.200	89	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	47.930	1.202	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	4.800	(49)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2029	35.900	27	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2033	9.900	354	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.06.2026	62.500	200	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	104.500	1.478	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	20.06.2025	304.000	2.728	0,09
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026	€ 24.200	162	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,417	11.07.2052	\$ 5.700	213	0,01
					<b>\$ 11.305</b>	<b>0,32</b>
					<b>\$ 10.756</b>	<b>0,30</b>

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- sprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettover- mögens	
BOA	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	6.678	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 77.889	08.01.2025	\$ 0	\$ 1.313	\$ 1.313	0,04	
BPS	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	13.128	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	156.795	25.06.2025	0	(558)	(558)	(0,02)	
CBK	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	4.143	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	47.623	10.07.2024	0	1.504	1.504	0,04	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	677	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	7.782	08.01.2025	0	246	246	0,01	
JPM	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	14.061	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	161.627	17.07.2024	0	5.088	5.088	0,14	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	5.404	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	63.838	11.09.2024	0	326	326	0,01	
RBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	340	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.908	10.07.2024	0	123	123	0,00	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	12.647	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	145.373	17.07.2024	0	4.585	4.585	0,13	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	395	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	4.540	24.07.2024	0	143	143	0,00	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	6.679	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	77.901	04.09.2024	0	1.314	1.314	0,04	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	5.226	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	60.071	16.10.2024	0	1.896	1.896	0,05	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	30.131	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	346.347	06.11.2024	0	10.911	10.911	0,30	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	10.727	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	123.304	13.11.2024	0	3.893	3.893	0,11	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	21.307	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	254.481	08.01.2025	0	(905)	(905)	(0,03)	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	5.593	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	64.290	22.01.2025	0	2.028	2.028	0,06	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	8.342	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	95.889	19.02.2025	0	3.022	3.022	0,08	
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	14.041	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	167.304	25.06.2025	0	(270)	(270)	(0,01)	
TOR	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	167	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.920	25.09.2024	0	59	59	0,00	
UAG	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	1.532	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	17.610	21.08.2024	0	555	555	0,02	
								<b>\$ 0</b>	<b>\$ 35.273</b>	<b>\$ 35.273</b>	<b>0,97</b>

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	\$ 20	NZD 33	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	NZD 33	\$ 20	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	07.2024	€ 5.896	€ 6.394	75	0	75	0,00
	07.2024	\$ 1.492	€ 1.375	0	(18)	(18)	0,00
BPS	07.2024	CAD 12.556	\$ 9.177	6	(5)	1	0,00
	07.2024	€ 3.051	€ 3.294	24	0	24	0,00
	07.2024	£ 93.821	119.843	1.244	0	1.244	0,04
	07.2024	¥ 7.030.000	47.043	3.301	0	3.301	0,09
	07.2024	\$ 2.292	CAD 3.143	5	0	5	0,00
BRC	07.2024	CAD 389	\$ 283	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	DKK 16.285	€ 2.371	30	0	30	0,00
	07.2024	¥ 6.810.000	45.614	3.279	0	3.279	0,09
	09.2024	\$ 13	MXN 235	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	CAD 181.262	\$ 132.417	45	(101)	(56)	0,00
	07.2024	£ 14.482	18.420	113	0	113	0,00
	07.2024	\$ 6.946	£ 5.439	0	(70)	(70)	0,00
FAR	07.2024	CAD 80.083	\$ 58.455	0	(74)	(74)	0,00
	07.2024	€ 321.228	349.867	5.592	0	5.592	0,15
	07.2024	NZD 144	89	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 38	NZD 63	0	0	0	0,00
GLM	08.2024	NZD 63	\$ 38	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 16.415	€ 15.296	0	(22)	(22)	0,00
	07.2024	44	ZAR 803	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	3.527	DKK 24.577	5	0	5	0,00
	07.2024	83	ZAR 1.521	1	0	1	0,00
MBC	08.2024	DKK 24.534	\$ 3.527	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	CAD 249	183	1	0	1	0,00
	07.2024	€ 1.264	1.376	21	0	21	0,00
	07.2024	£ 3.557	4.528	32	0	32	0,00
	07.2024	\$ 643	CAD 881	0	0	0	0,00
MYI	08.2024	CAD 880	\$ 643	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 7.938	8.510	4	(2)	2	0,00
	07.2024	\$ 7.552	CAD 10.333	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	2.417	DKK 16.868	8	0	8	0,00
	07.2024	203	€ 189	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK 16.838	2.417	0	(7)	(7)	0,00
RBC	07.2024	\$ 134.952	£ 106.421	0	(427)	(427)	(0,01)
	08.2024	£ 106.421	\$ 134.976	424	0	424	0,01
SCX	07.2024	\$ 345.240	€ 322.227	112	(5)	107	0,00
	08.2024	€ 320.192	\$ 343.558	0	(108)	(108)	0,00
SSB	07.2024	CAD 25	18	0	0	0	0,00
	09.2024	¥ 3.950.000	25.556	765	0	765	0,02
TOR	07.2024	\$ 29	NZD 48	0	0	0	0,00
	08.2024	NZD 48	\$ 29	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	DKK 25.209	3.661	38	0	38	0,00
	08.2024	€ 429	459	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 15.126	\$ (848)	\$ 14.278	0,39

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 79.274	€ 73.018	\$ 0	\$ (1.016)	\$ (1.016)	(0,03)
BPS	07.2024	€ 70.483	\$ 75.389	1	(152)	(151)	0,00
	07.2024	\$ 58.499	€ 54.027	0	(596)	(596)	(0,02)
	08.2024	75.473	70.459	152	0	152	0,00
BRC	07.2024	€ 1.056	\$ 1.130	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2024	403	439	7	0	7	0,00
FAR	07.2024	\$ 77.802	€ 71.433	0	(1.242)	(1.242)	(0,03)
GLM	07.2024	1.932	1.785	0	(19)	(19)	0,00
JPM	07.2024	325	304	1	0	1	0,00
MBC	07.2024	€ 70.650	\$ 75.546	0	(173)	(173)	0,00
	07.2024	\$ 6.726	€ 6.266	0	(11)	(11)	0,00
	08.2024	75.554	70.554	172	0	172	0,00
MYI	07.2024	€ 218	\$ 234	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	1	1	0	0	0	0,00
RYL	07.2024	\$ 171	€ 160	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	€ 70.608	\$ 75.650	0	(25)	(25)	0,00
	08.2024	\$ 75.751	€ 70.599	24	0	24	0,00
SSB	07.2024	6.971	6.426	0	(84)	(84)	0,00
UAG	08.2024	513	479	1	0	1	0,00
				\$ 358	\$ (3.320)	\$ (2.962)	(0,08)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 46.589 1,28

Summe Anlagen

\$ 3.616.130 99,33

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 24.401 0,67

Nettovermögen

\$ 3.640.531 100,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.  
 (b) Wertpapier per Emissionstermin.  
 (c) Nullkuponwertpapier.  
 (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
 (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
 (f) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 542 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 112.778 USD (31. Dezember 2023: 49,516 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2023: 7.390 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 8.134	\$ 1.883.962	\$ 830	\$ 1.892.926
Investmentfonds	330.950	0	0	330.950
Pensionsgeschäfte	0	1.333.842	0	1.333.842
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.187	57.225	0	58.412
<b>Summen</b>	<b>\$ 340.271</b>	<b>\$ 3.275.029</b>	<b>\$ 830</b>	<b>\$ 3.616.130</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.317.011	\$ 1.550	\$ 1.318.561
Investmentfonds	179.118	0	0	179.118
Pensionsgeschäfte	0	544.588	0	544.588
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	18.758	(10.059)	0	8.699
<b>Summen</b>	<b>\$ 197.876</b>	<b>\$ 1.851.540</b>	<b>\$ 1.550</b>	<b>\$ 2.050.966</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 354	\$ (390)	\$ (36)	\$ (100)	\$ 0	\$ (100)
BPS	3.422	(3.840)	(418)	(5)	0	(5)
BRC	3.305	(3.220)	85	(3.973)	5.190	1.217
CBK	1.744	(2.060)	(316)	(332)	(1.910)	(2.242)
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
FAR	4.277	(13.280)	(9.003)	(1.104)	(10.880)	(11.984)
GLM	(41)	0	(41)	(17)	0	(17)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
JPM	5.416	(6.270)	(854)	(1.521)	(12.380)	(13.901)
MBC	42	0	42	(2.072)	2.200	128
MYI	2	(20)	(18)	441	(890)	(449)
RBC	26.737	(32.880)	(6.143)	(3.302)	(33.130)	(36.432)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	187	(300)	(113)
SCX	(2)	0	(2)	4	0	4
SSB	681	(620)	61	(93)	0	(93)
TOR	59	0	59	(8)	0	(8)
UAG	593	(560)	33	(447)	(370)	(817)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	23,78	41,60
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	26,31	25,43
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,90	0,15
Investmentfonds	9,09	9,12
Pensionsgeschäfte	36,64	27,74
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,03	0,92
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,30	0,15
Freiverkehrsfinanzderivate	1,28	(0,63)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	11,33	12,17
US-Regierungsbehörden	10,83	6,81
US-Schatzobligationen	6,49	5,87
Non-Agency-MBS	6,77	14,75
Forderungsbesicherte Wertpapiere	12,74	21,83
Staatsemissionen	0,32	0,61
Kurzfristige Instrumente	3,51	5,14
Investmentfonds	9,09	9,12
Pensionsgeschäfte	36,64	27,74
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,03	0,92
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,02)	0,08
Zinsswaps	0,32	0,07
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	0,97	(0,30)
Devisenterminkontrakte	0,39	(0,40)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,08)	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	0,67	(4,48)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>												
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>												
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>												
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	\$ 43	\$ 39	0,32	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 5,807 % fällig am 25.05.2037	\$ 10	\$ 8	0,06	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 5,670 % fällig am 25.10.2036	\$ 15	\$ 15	0,12	
Goldman Sachs Group, Inc. 7,222 % fällig am 15.03.2028	100	102	0,84	Chase Mortgage Finance Trust 5,312 % fällig am 25.07.2037	2	1	0,01	Jubilee CLO DAC 4,516 % fällig am 15.04.2030	€ 40	43	0,36	
JPMorgan Chase & Co. 5,040 % fällig am 23.01.2028	100	100	0,83	Countrywide Alternative Loan Trust 5,500 % fällig am 25.11.2035	12	8	0,06	Marzio Finance SRL 4,472 % fällig am 28.09.2049	100	7	0,88	
Morgan Stanley Bank N.A. 4,952 % fällig am 14.01.2028	100	99	0,82	5,915 % fällig am 25.11.2035	32	16	0,13	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 6,315 % fällig am 25.03.2034	\$ 49	49	0,41	
Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,750 % fällig am 09.03.2028	50	45	0,37	6,153 % fällig am 25.12.2035	21	19	0,16	Oak Hill European Credit Partners DAC 4,627 % fällig am 20.01.2032	€ 69	73	0,60	
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2052	DKK 283	32	0,26	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 5,920 % fällig am 25.05.2035	72	59	0,49	Pretium Mortgage Credit Partners LLC 5,240 % fällig am 27.09.2060	\$ 79	79	0,65	
		417	3,44	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 5,864 % fällig am 25.11.2034	8	7	0,06			1.589	13,11	
				CSAIL Commercial Mortgage Trust 3,504 % fällig am 15.06.2057	100	98	0,81	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
				GSR Mortgage Loan Trust 4,375 % fällig am 25.11.2035	14	12	0,10	Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031 (c)				
				Mortgage Equity Conversion Asset Trust 5,570 % fällig am 25.02.2042	39	39	0,32			163	7	0,06
				Shamrock Residential DAC 4,448 % fällig am 24.01.2061	€ 70	75	0,62	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				
				Stratton Mortgage Funding PLC 0,000 % fällig am 25.06.2049	€ 250	316	2,61	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				
				6,134 % fällig am 28.06.2050	95	120	0,99	(0,026) % fällig am 01.07.2024 (a)(b)				
				Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,953 % fällig am 19.07.2035	\$ 19	18	0,15	¥ 20.000 124 1,03				
				6,080 % fällig am 25.09.2045	10	8	0,07	(0,015) % fällig am 01.07.2024 (a)(b)				
				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,740 % fällig am 25.01.2036	11	9	0,07	10.000 62 0,51				
				5,810 % fällig am 25.03.2035	37	32	0,26	(0,008) % fällig am 24.09.2024 (a)(b)				
						913	7,53	30.000 187 1,54				
								0,004 % fällig am 17.09.2024 (a)(b)				
								30.000 187 1,54				
								0,005 % fällig am 16.07.2024 (a)(b)				
								20.000 124 1,02				
								0,013 % fällig am 09.09.2024 (a)(b)				
								10.000 62 0,51				
								0,036 % fällig am 26.08.2024 (a)(b)				
								30.000 187 1,54				
								0,038 % fällig am 19.08.2024 (a)(b)				
								33.000 205 1,69				
								1.138 9,38				
								<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				
								5,391 % fällig am 18.07.2024 (a)(b)				
								\$ 700 698 5,76				
								Summe kurzfristige Instrumente				
								1.836 15,14				
								Summe Übertragbare Wertpapiere				
								\$ 7.743 63,87				
								<b>AKTIEN</b>				
								<b>INVESTMENTFONDS</b>				
								<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
								PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d) 78.093				
								778 6,42				
								<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>				
								PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)				
								3.800 380 3,14				
								Summe Investmentfonds				
								\$ 1.158 9,56				

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover-mögens
BPS	5,340 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 2.300	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.07.2026	\$ (2.345)	\$ 2.300	\$ 2.301	18,97
GSC	5,400	28.06.2024	01.07.2024	1.100	Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.11.2052	(1.137)	1.100	1.100	9,07
SSB	2,600	28.06.2024	01.07.2024	132	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 28.02.2027	(135)	132	132	1,09
<b>Total Repurchase Agreements</b>						<b>\$ (3.617)</b>	<b>\$ 3.532</b>	<b>\$ 3.533</b>	<b>29,13</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2024	7	\$ 3	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	9	1	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	10	2	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	13	6	0,05
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	6	2	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	1	1	0,01
				\$ 15	0,12

## VERKAUFSOPTIONEN

## FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	109,000	26.07.2024	1	0	(1)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	112,000	26.07.2024	1	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (1)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate						\$ 14 0,12

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000 %	20.06.2029	\$ 200	\$ (1)	(0,01)
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	6.800	(6)	(0,05)
				\$ (7)	(0,06)

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000 %	21.03.2034	¥ 20.000	\$ (1)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,407	21.07.2024	\$ 200	4	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,740	15.02.2027	100	1	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2027	300	(4)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	100	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	100	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,277	21.07.2031	200	(2)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	200	(2)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	700	(8)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	100	(2)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	160	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	900	(8)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	200	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	200	1	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	31.05.2028	300	6	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,655	31.05.2028	200	4	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,662	31.05.2028	400	8	0,07
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	800	(2)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	200	1	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	400	14	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	16.04.2034	100	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.03.2026	300	2	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,000	20.06.2026	600	8	0,07
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	400	(3)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,177	20.03.2026	CAD 400	0	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	AUD 200	4	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 60	3	0,02
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	160	(3)	(0,03)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,818	26.06.2029	100	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	100	(1)	(0,01)
					\$ 16	0,13
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 9 0,07

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Forts.)

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000 %	17.07.2024	500	\$ 0	\$ 0	0,00
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,750	13.01.2025	600	1	1	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	17.10.2024	500	0	1	0,01
							\$ 1	\$ 2	0,02

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	100	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	100	0	0	0,00
							\$ (1)	\$ 0	0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	62	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 713	02.10.2024	\$ 0	\$ 22	\$ 22	0,19
BRC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	123	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.414	02.10.2024	0	45	45	0,37
CBK	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	77	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	885	08.01.2025	0	28	28	0,23
RBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	246	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.828	06.11.2024	0	89	89	0,73
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	345	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.966	19.02.2025	0	125	125	1,02
							\$ 0	\$ 309	\$ 309	2,54

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD	115	\$ 77	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	NZD	25	16	0	0	0,00
	07.2024	\$	77	AUD 115	0	0	0,00
	08.2024	AUD	115	\$ 77	0	0	0,00
	08.2024	\$	16	NZD 25	0	0	0,00
BOA	10.2024	CNH	378	\$ 53	1	1	0,01
	07.2024	€	594	645	8	8	0,07
	07.2024	KRW	82.778	60	0	0	0,00
	07.2024	\$	57	SGD 77	0	0	0,00
	08.2024	¥	33.000	\$ 215	8	8	0,07
BRC	08.2024	SGD	77	57	0	0	0,00
	07.2024	DKK	93	14	0	0	0,00
	07.2024	€	99	106	0	0	0,00
	07.2024	¥	30.000	201	16	16	0,12
	07.2024	\$	49	PLN 194	0	(1)	(0,01)
CBK	09.2024	CNH	276	\$ 38	1	1	0,00
	09.2024	¥	30.000	194	5	5	0,04
	09.2024	MXN	2	0	0	0	0,00
	07.2024	BRL	151	29	2	2	0,02
	07.2024	CHF	8	9	0	0	0,00
	07.2024	€	24	26	0	0	0,00
	07.2024	¥	600	4	0	0	0,00
07.2024	MXN	239	13	0	0	0,00	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 38	BRL 209	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	(0,01)
	07.2024	45	£ 35	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	8	ILS 30	0	0	0	0,00
	07.2024	9	PLN 35	0	0	0	0,00
	08.2024	BRL 210	\$ 38	1	0	1	0,01
	09.2024	MXN 190	10	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 1.092	34	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 95	INR 7.957	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	KRW 43.631	\$ 32	0	0	0	0,00
	08.2024	BRL 10	2	0	0	0	0,00
	10.2024	CNH 65	9	0	0	0	0,00
GLM	07.2024	€ 5	5	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 14	10	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 38	ZAR 703	0	0	0	0,00
	08.2024	44	BRL 223	0	(4)	(4)	(0,03)
	09.2024	30	TRY 1.064	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	€ 19	\$ 20	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 20.000	134	11	0	11	0,08
	07.2024	KRW 93.828	68	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 63	47	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 118	CHF 106	0	0	0	0,00
	07.2024	20	DKK 141	0	0	0	0,00
	07.2024	46	NZD 74	0	0	0	0,00
	07.2024	23	PLN 91	0	0	0	0,00
	07.2024	72	ZAR 1.332	1	0	1	0,00
	08.2024	CHF 106	\$ 118	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK 140	20	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 30	NZD 49	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 2.340	\$ 73	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 13	INR 1.085	0	0	0	0,00
	09.2024	76	MXN 1.376	0	(3)	(3)	(0,01)
	10.2024	CNH 355	\$ 50	1	0	1	0,00
MBC	07.2024	CAD 165	122	1	0	1	0,01
	07.2024	CHF 13	14	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 249	317	2	0	2	0,02
	07.2024	\$ 121	CAD 166	0	0	0	0,00
	07.2024	5	PLN 21	0	0	0	0,00
	08.2024	CAD 165	\$ 121	0	0	0	0,00
	09.2024	¥ 10.000	65	2	0	2	0,02
MYI	07.2024	BRL 59	11	1	0	1	0,01
	07.2024	€ 250	268	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 14	DKK 96	0	0	0	0,00
	07.2024	8	IDR 131.999	0	0	0	0,00
	07.2024	36	PLN 142	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2024	5	ZAR 89	0	0	0	0,00
	07.2024	ZAR 89	\$ 5	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK 96	14	0	0	0	0,00
	08.2024	¥ 30.000	194	6	0	6	0,05
	08.2024	\$ 5	ZAR 89	0	0	0	0,00
	09.2024	¥ 30.000	\$ 191	2	0	2	0,02
	09.2024	TWD 795	25	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 15	INR 1.285	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	£ 92	\$ 117	1	0	1	0,01
	07.2024	\$ 388	£ 306	0	(1)	(1)	(0,01)
	08.2024	£ 306	\$ 388	1	0	1	0,01
SCX	07.2024	KRW 33.072	24	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 956	€ 892	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 892	\$ 957	0	0	0	0,00
	09.2024	CNH 265	37	1	0	1	0,00
	09.2024	TWD 1.485	46	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 59	INR 4.918	0	0	0	0,00
SSB	09.2024	TWD 258	\$ 8	0	0	0	0,00
UAG	07.2024	CHF 85	94	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	DKK 144	21	0	0	0	0,00
	07.2024	ILS 32	9	0	0	0	0,00
				\$ 72	\$ (13)	\$ 59	0,49

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 370 3,05

Summe Anlagen

\$ 12.826 105,80

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (703) (5,80)

Nettovermögen

\$ 12.123 100,00

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Nullkuponwertpapier.  
(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
(d) Mit dem Fonds verbunden.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Forts.)

Barmittel in Höhe von 526 USD (31. Dezember 2023: 389 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 7.721	\$ 22	\$ 7.743
Investmentfonds	1.158	0	0	1.158
Pensionsgeschäfte	0	3.532	0	3.532
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	3	390	0	393
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.161</b>	<b>\$ 11.643</b>	<b>\$ 22</b>	<b>\$ 12.826</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 9.230	\$ 24	\$ 9.254
Investmentfonds	663	379	0	1.042
Pensionsgeschäfte	0	1.095	0	1.095
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	38	(66)	0	(28)
<b>Summen</b>	<b>\$ 701</b>	<b>\$ 10.638</b>	<b>\$ 24</b>	<b>\$ 11.363</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 1	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	38	0	38	(5)	0	(5)
BRC	66	(60)	6	(23)	(30)	(53)
CBK	29	0	29	(2)	0	(2)
GLM	(4)	0	(4)	(8)	0	(8)
JPM	10	0	10	(9)	0	(9)
MBC	5	0	5	(36)	0	(36)
MYC	2	0	2	(2)	0	(2)
MYI	8	0	8	(1)	0	(1)
RBC	215	(20)	195	(27)	(260)	(287)
SCX	1	0	1	2	0	2
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	3	0	3
UAG	(1)	0	(1)	1	0	1

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	22,45	46,60
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	38,82	36,21
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	2,60	k. A.
Investmentfonds	9,56	9,32
Pensionsgeschäfte	29,13	9,80
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,12	0,81
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,07	(0,10)
Freiverkehrsfinanzderivate	3,05	(0,96)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	3,84	4,71
US-Regierungsbehörden	17,74	14,54
US-Schatzobligationen	6,45	6,17
Non-Agency-MBS	7,53	6,28
Forderungsbesicherte Wertpapiere	13,11	15,08
Staatsemissionen	0,06	0,07

<b>Anlagen zum Marktwert</b>	<b>30. Jun. 2024 (%)</b>	<b>31. Dez. 2023 (%)</b>
Kurzfristige Instrumente	15,14	35,96
Investmentfonds	9,56	9,32
Pensionsgeschäfte	29,13	9,80
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,12	0,81
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,06)	0,22
Zinsswaps	0,13	(0,32)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,02	k. A.
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	0,00	(0,02)
Total Return Swaps auf Indizes	2,54	(0,38)
Devisenterminkontrakte	0,49	(0,57)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	k. A.	0,01
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(5,80)	(1,68)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Altice France S.A. 10,829 % fällig am 15.08.2028	\$ 400	\$ 295	0,07	4,892 % fällig am 18.05.2029	\$ 500	\$ 489	0,11	5,875 % fällig am 15.04.2029	3.869	3.884	0,86
Envision Healthcare Corp. 14,311 % fällig am 20.07.2026	955	955	0,21	5,076 % fällig am 27.01.2030	1.400	1.376	0,30	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 15.08.2029	900	\$ 820	0,18
Lealand Finance Co. BV 8,444 % fällig am 30.06.2027	26	14	0,00	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	Venture Global LNG, Inc. 9,500 % fällig am 01.02.2029	1.650	1.808	0,40
Lealand Finance Co. BV (6,444 % bar und 3,000 % PIK) 9,444 % fällig am 31.12.2027 (b)	156	74	0,02	Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	9,875 % fällig am 01.02.2032	550	599	0,13
Poseidon Bidco SASU 8,722 % fällig am 13.03.2030	€ 800	808	0,18	Santander UK Group Holdings PLC 7,482 % fällig am 29.08.2029	€ 260	350	0,08	Windstream Escrow LLC 7,750 % fällig am 15.08.2028	1.753	1.653	0,36
Press Ganey Holdings, Inc. 8,845 % fällig am 30.04.2031	\$ 39	39	0,01	Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034	\$ 1.800	1.858	0,41				
SCUR-Alpha 1503 GmbH 10,830 % fällig am 29.03.2030	988	936	0,21	Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % Bargeld oder 6,000 % PIK) 5,000 % fällig am 30.09.2026 (b)	8	1	0,00	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
Syniverse Holdings, Inc. 12,335 % fällig am 13.05.2027	99	97	0,02	Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK) 5,250 % fällig am 30.09.2027 (b)	8	1	0,00	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029	5.100	2.754	0,61
U.S. Renal Care, Inc. 10,444 % fällig am 20.06.2028	162	142	0,03	Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK) 5,500 % fällig am 30.09.2027 (b)	16	1	0,00	Pacific Gas & Electric Co. 2,950 % fällig am 01.03.2026	1.154	1.105	0,24
Windstream Services LLC 11,679 % fällig am 21.09.2027	20	20	0,00	Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % bar oder 6,750 % PIK) 5,750 % fällig am 30.09.2028 (b)	23	2	0,00	3,250 % fällig am 01.06.2031	2.460	2.116	0,46
		3.380	0,75	Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK) 6,000 % fällig am 30.09.2029 (b)	23	2	0,00	3,300 % fällig am 15.03.2027	324	307	0,07
				Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK) 6,250 % fällig am 30.09.2030 (b)	11	1	0,00	3,400 % fällig am 15.08.2024	403	402	0,09
				UBS Group AG 5,959 % fällig am 12.01.2034	3.458	3.512	0,78	3,750 % fällig am 01.07.2028	1.102	1.035	0,23
				Unique Pub Finance Co. PLC 5,659 % fällig am 30.06.2027	€ 544	683	0,15	4,200 % fällig am 01.03.2029	1.000	947	0,21
				Voyager Aviation Holdings LLC 8,500 % fällig am 09.05.2026 ^	\$ 18	2	0,00	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	173	176	0,04
				Wells Fargo & Co. 6,303 % fällig am 23.10.2029	400	415	0,09	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		53.186	11,74
				6,491 % fällig am 23.10.2034	200	213	0,05	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
						23.659	5,22	Sunac China Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 30.09.2032	13	1	0,00
								<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022			
								0,000 % fällig am 01.11.2043	428	262	0,06
								Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010			
								6,630 % fällig am 01.02.2035	25	26	0,01
								7,350 % fällig am 01.07.2035	13	14	0,00
								Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
								6,125 % fällig am 01.07.2040 ^	200	95	0,02
										397	0,09
								<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
								Fannie Mae			
								0,550 % fällig am 25.11.2049 (a)	100	12	0,00
								2,200 % fällig am 25.07.2033 (a)	33	3	0,00
								Freddie Mac			
								1,102 % fällig am 15.06.2042 (a)	36	4	0,00
								Ginnie Mae			
								4,500 % fällig am 20.07.2040 - 20.07.2043	9.126	8.902	1,97
								5,500 % fällig am 20.07.2053 - 20.08.2053	0	0	0,00
								Ginnie Mae, TBA			
								3,000 % fällig am 01.07.2054 - 01.08.2054	2.700	2.354	0,52
								3,500 % fällig am 01.07.2054 - 01.08.2054	3.600	3.234	0,71
								4,000 % fällig am 01.07.2054	2.300	2.126	0,47
								4,500 % fällig am 01.08.2054	4.600	4.376	0,97
								5,000 % fällig am 01.08.2054	800	779	0,17
								5,500 % fällig am 01.07.2054	1.300	1.290	0,29
								Uniform Mortgage-Backed Security			
								3,000 % fällig am 01.03.2050 - 01.05.2052	1.343	1.148	0,25
								3,500 % fällig am 01.04.2048 - 01.02.2050	476	429	0,09
								4,000 % fällig am 01.08.2039 - 01.05.2047	1.087	1.021	0,23
								Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
								3,000 % fällig am 01.07.2039 - 01.08.2054	10.400	9.076	2,00
								3,500 % fällig am 01.07.2054	12.150	10.755	2,38
								4,000 % fällig am 01.07.2054	34.700	31.755	7,01
								4,500 % fällig am 01.08.2054	14.500	13.675	3,02
								5,000 % fällig am 01.07.2054 - 01.08.2054	39.225	37.908	8,37
								5,500 % fällig am 01.08.2054	22.425	22.116	4,88
								6,000 % fällig am 01.08.2054	34.025	34.109	7,53





BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BAUSTOFFE</b>											
AP Moller - Maersk A/S 'B'	114	\$ 198	0,04	BHP Group Ltd.	37.804	\$ 1.082	0,24	Boston Properties, Inc.	9.382	578	0,13
Astra International Tbk PT	596.800	162	0,04	BlueScope Steel Ltd.	13.015	177	0,04	Camden Property Trust	7.234	789	0,17
BAE Systems PLC	89.776	1.495	0,33	Evrax PLC (c)	72.869	0	0,00	CareTrust REIT, Inc.	17.328	435	0,10
Brambles Ltd.	40.479	391	0,09	Fortescue Ltd.	50.629	722	0,16	Crown Castle, Inc.	11.114	1.086	0,24
Brenntag SE	2.316	156	0,03	Grupo Mexico S.A.B. de C.V. 'B'	89.500	482	0,11	Digital Realty Trust, Inc.	10.505	1.597	0,35
Cie de Saint-Gobain S.A.	13.560	1.055	0,23	Heidelberg Materials AG	3.785	391	0,09	EPR Properties	24.856	1.043	0,23
Cummins, Inc.	4.089	1.132	0,25	Holcim AG	15.427	1.363	0,30	Equity Residential	12.619	875	0,19
GEA Group AG	4.413	184	0,04	Mondi PLC	13.098	251	0,05	Gaming and Leisure Properties, Inc.	34.538	1.561	0,35
Kawasaki Kisen Kaisha Ltd. (c)	11.100	162	0,04	Nucor Corp.	4.372	691	0,15	Healthcare Realty Trust, Inc.	40.313	664	0,15
Marubeni Corp. (c)	42.100	781	0,17	Rio Tinto Ltd.	3.930	312	0,07	Healthpeak Properties, Inc.	37.428	734	0,16
Masco Corp.	4.777	319	0,07	Rio Tinto PLC	22.949	1.506	0,33	Highwoods Properties, Inc.	48.902	1.285	0,28
Mitsui & Co. Ltd. (c)	27.000	616	0,14	Steel Dynamics, Inc.	4.427	573	0,13	Kilroy Realty Corp.	19.326	602	0,13
Mitsui OSK Lines Ltd. (c)	10.200	307	0,07	Vale S.A.	93.700	1.050	0,23	Mid-America Apartment Communities, Inc.	4.440	633	0,14
Nippon Yusen KK (c)	13.500	394	0,09			8.600	1,90	National Storage Affiliates Trust	20.322	838	0,19
Owens Corning (c)	2.601	452	0,10	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				Omega Healthcare Investors, Inc.	27.713	949	0,21
SKF AB 'B'	9.865	198	0,04	CLP Holdings Ltd.	48.500	392	0,08	Park Hotels & Resorts, Inc.	97.248	1.457	0,32
Toyota Tsusho Corp. (c)	19.200	375	0,08	Endesa S.A.	9.004	169	0,04	Public Storage	2.241	645	0,14
		9.353	2,07	Enel SpA (c)	240.796	1.672	0,37	Realty Income Corp. Regency Centers Corp.	14.718	777	0,17
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				Engie S.A.	18.260	262	0,06	RLJ Lodging Trust	63.079	607	0,13
Apple, Inc.	5.220	1.099	0,24	Fortum Oyj (c)	13.071	191	0,04	Simon Property Group, Inc.	10.229	1.553	0,34
ASE Technology Holding Co. Ltd. (c)	89.000	461	0,10	Iberdrola S.A. (c)	13.543	176	0,04	Uniti Group, Inc.	1.773	5	0,00
Cisco Systems, Inc. (c)	37.719	1.792	0,40	Power Grid Corp. of India Ltd. (c)	139.013	551	0,12	VICI Properties, Inc.	117.955	3.379	0,75
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. (c)	133.000	876	0,19			3.413	0,75	WP Carey, Inc.	11.894	655	0,15
Lite-On Technology Corp.	52.000	169	0,04	<b>OPTIONSSCHEINE</b>					24.512	5,41	
MediaTek, Inc. (c)	45.000	1.938	0,43	Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17.02.2027	1.128	3	0,00	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 654.332	144,48	
Microsoft Corp. (c)	2.751	1.230	0,27	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
NetApp, Inc. (c)	6.042	778	0,17	Nationwide Building Society 10,250 %	5.720	945	0,21	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Novatek Microelectronics Corp. (c)	17.000	317	0,07	Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 %	141.500	970	0,21	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	53.568	534	0,12
NVIDIA Corp.	1.810	224	0,05	Samsung Electronics Co. Ltd. 0,000 %	3.899	179	0,04	Summe Investmentfonds	\$ 534	0,12	
Pegatron Corp.	59.000	190	0,04	Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	93	0	0,00				
QUALCOMM, Inc.	7.135	1.421	0,32			2.094	0,46	<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>			
Quanta Computer, Inc.	81.000	774	0,17	Apple Hospitality REIT, Inc.	74.421	\$ 1.082	0,24				
Realtek Semiconductor Corp. (c)	14.000	235	0,05								
Skyworks Solutions, Inc.	4.797	511	0,11								
United Microelectronics Corp. (c)	100.000	173	0,04								
		12.188	2,69								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnu- ngs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 942	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (961)	\$ 942	\$ 942	0,21
SSB	2,600	28.06.2024	01.07.2024	223	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	(228)	223	223	0,05
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (1.189)</b>	<b>\$ 1.165</b>	<b>\$ 1.165</b>	<b>0,26</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	7	\$ 46	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	8	36	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	10	74	0,02
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	9	48	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	7	41	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	9	38	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	10	71	0,02

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	6	\$ 29	0,01
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	103	0	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	43	(79)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	102	66	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	345	288	0,06
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	11	4	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	192	(100)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	126	(77)	(0,02)
				\$ 485	0,11

### VERKAUFSoPTIONEN

#### FUTURES-ÄHNLICHE OPTIONEN AUF BÖRSENGEHADELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 109,000	26.07.2024	1	\$ 0	\$ (1)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	112,000	26.07.2024	1	(1)	0	0,00
				\$ (1)	\$ (1)	0,00

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 484 0,11

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2028	\$ 1.700	\$ 45	0,01
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2024	700	1	0,00
				\$ 46	0,01

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000 %	20.12.2024	\$ 510	\$ 23	0,01
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	2.208	64	0,01
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	4.508	174	0,04
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	600	42	0,01
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	300	15	0,00
CDX.EM-40 5-Year Index	1,000	20.12.2028	1.900	45	0,01
CDX.EM-41 5-Year Index	1,000	20.06.2029	1.300	7	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	1.843	(57)	(0,01)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	873	13	0,00
CDX.HY-41 5-Year Index	5,000	20.12.2028	1.089	72	0,01
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000	20.06.2029	3.200	(13)	0,00
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	500	(1)	0,00
				\$ 384	0,08

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,700 %	28.03.2034	£ 100	\$ 3	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	6.300	163	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	27.100	(328)	(0,07)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320	20.10.2033	100	4	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	¥ 2.430.000	479	0,11
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,020	20.09.2028	2.950.000	498	0,11
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	160.000	(9)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	248.400	54	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	121.000	79	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	37.000	27	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	\$ 32.900	2.103	0,46
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	26.200	(2.336)	(0,52)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	15.12.2024	53.300	(1.423)	(0,31)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	13.442	(1.598)	(0,35)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	16.200	2.049	0,45
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	0,940	08.06.2026	2.000	151	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	15.700	(1.203)	(0,27)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	1.200	64	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	2.770	(294)	(0,07)

Zahlung/ Erhalt	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex					
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000 %	16.12.2030	\$ 1.766	\$ 322	0,07
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,235	12.05.2028	700	85	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	34.300	3.391	0,75
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2027	12.000	(1.607)	(0,36)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.12.2028	3.900	(560)	(0,12)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	47.620	5.598	1,24
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	5.950	(685)	(0,15)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	4.300	(1.248)	(0,28)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	3.400	290	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	800	147	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	500	92	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	1.400	(117)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,405	07.09.2031	1.300	235	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	1.000	(81)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,443	18.01.2027	1.100	(88)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	2.400	196	0,04
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	1.200	217	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,491	21.01.2051	900	(377)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	7.130	(987)	(0,22)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	578	72	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	05.10.2031	600	(106)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	600	(104)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,535	22.10.2031	400	(69)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,545	26.10.2031	400	(69)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,550	20.01.2027	15.100	(1.152)	(0,26)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,570	11.01.2027	800	(62)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	900	(68)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,590	09.02.2051	7.200	(2.905)	(0,64)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	6.600	342	0,07
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,625	16.01.2050	3.100	1.251	0,28
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,625	03.02.2050	3.900	1.576	0,35
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	9.600	(679)	(0,15)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,700	12.01.2029	2.100	(233)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,740	16.12.2026	1.100	84	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	26.000	493	0,11
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	1.209	53	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.878	124	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.840	(195)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	22.01.2050	7.600	2.940	0,65
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,768	02.02.2032	300	(48)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	700	276	0,06
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	2.200	(322)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	1.100	(156)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,875	07.02.2050	400	145	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,895	18.10.2049	700	270	0,06
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,910	17.10.2049	700	267	0,06
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	1.100	(77)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	1.250	23	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	5.740	162	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	18.02.2032	900	(125)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	9.130	391	0,09
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.01.2050	1.400	487	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	6.500	(2.735)	(0,60)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,250	11.12.2049	7.100	2.151	0,47
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,250	12.03.2050	3.400	1.011	0,22
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	4.600	234	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	7.900	237	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	15.900	471	0,10
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,500	18.12.2024	6.000	425	0,09
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,500	20.12.2024	10.900	(92)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,688	04.04.2025	600	(10)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,690	04.04.2025	300	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,697	04.04.2025	1.200	(21)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,721	10.04.2025	600	(10)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,781	09.04.2025	1.000	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,841	31.10.2024	600	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,850	30.08.2027	1.000	(59)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,910	14.11.2024	600	(11)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,920	17.10.2024	1.700	(33)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	1.000	(52)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,973	27.10.2024	600	(11)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,993	13.10.2024	600	(11)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	19.06.2026	32.300	2.161	0,48
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	2.090	52	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	2.800	168	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	160	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,018	24.10.2024	500	(9)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	500	(26)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	500	(30)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	700	(53)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	200	(24)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,088	07.11.2024	600	(10)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,100 %	09.09.2029	\$ 500	\$ (29)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,140	25.10.2024	500	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,190	25.10.2024	500	(8)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,225	25.10.2024	500	(8)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	1.280	14	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	300	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,300	14.06.2033	1.000	(46)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	600	(23)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	200	12	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	400	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,370	12.07.2053	200	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	200	(9)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	300	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	300	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	300	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	600	(24)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	600	(19)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	900	(22)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	200	3	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	990	(16)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	29.660	795	0,17
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	600	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	860	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	200	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,555	05.03.2054	100	(3)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,594	09.01.2034	200	8	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,600	17.01.2034	200	8	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	400	16	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,620	31.01.2034	100	(3)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,648	08.01.2034	200	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	22.11.2024	1.100	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	1.100	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	10.07.2033	400	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.03.2034	200	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,655	24.01.2034	100	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,665	24.01.2034	200	(5)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,670	08.01.2034	200	7	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	100	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,685	24.01.2034	200	(5)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	16.970	489	0,11
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,700	05.03.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,710	05.03.2034	200	(4)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,725	07.02.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,730	03.08.2033	200	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	07.08.2033	200	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,735	23.01.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,738	23.01.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	21.11.2024	1.100	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	11.12.2024	1.100	(15)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	13.12.2027	900	25	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	1.080	(12)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	14.200	468	0,10
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2031	16.910	(71)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	12.07.2033	400	(12)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	100	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	4.200	33	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.12.2034	120	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,760	23.08.2033	500	(13)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,783	07.02.2034	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	600	(10)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	05.09.2028	800	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	100	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	30.08.2033	200	(4)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	100	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,830	12.10.2053	100	1	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,842	26.12.2033	100	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	200	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,860	21.02.2034	400	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,870	17.10.2053	100	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,880	16.10.2053	100	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	30.08.2033	600	(9)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	10.04.2034	200	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,900	15.04.2034	100	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,940	22.02.2029	700	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	13.09.2033	600	(6)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	19.12.2033	200	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,950	16.04.2034	200	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,970	27.02.2029	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	04.10.2033	500	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,030	15.12.2033	200	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,078	29.04.2034	200	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	17.04.2034	200	2	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080 %	05.06.2034	\$ 200	\$ (1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,085	22.04.2034	200	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,090	30.04.2034	700	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,105	24.04.2034	400	5	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,130	03.05.2034	200	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	12.10.2033	200	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,150	22.04.2034	200	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,155	02.10.2033	400	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,165	27.09.2033	600	6	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,170	03.10.2033	400	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,175	10.10.2033	200	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,200	18.10.2033	200	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,220	20.10.2033	200	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,230	23.10.2033	100	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2029	620	18	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	20.03.2031	730	25	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,250	22.11.2033	200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,255	23.10.2033	100	2	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,393	25.10.2033	100	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,435	01.11.2033	100	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	31.10.2033	100	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,450	01.11.2033	300	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	65.460	(222)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	37.050	(129)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,874	02.01.2026	BRL 1.200	(7)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,899	02.01.2026	600	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,939	02.01.2026	1.100	(6)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,998	04.01.2027	1.900	(15)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,037	04.01.2027	500	(4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,041	04.01.2027	1.500	(12)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,052	02.01.2026	1.800	(9)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,072	04.01.2027	1.490	(9)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,085	02.01.2026	1.800	(9)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,090	04.01.2027	2.800	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,098	04.01.2027	4.490	(26)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,105	02.01.2026	1.800	(9)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,138	04.01.2027	700	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,165	04.01.2027	2.280	(13)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,170	04.01.2027	3.800	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,183	04.01.2027	6.830	(38)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,203	04.01.2027	5.320	(29)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,210	04.01.2027	770	(4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,256	04.01.2027	5.310	(28)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,328	04.01.2027	3.980	(20)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,157	02.01.2025	1.300	(6)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,177	02.01.2025	800	(4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,250	04.01.2027	1.500	(9)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,275	04.01.2027	700	(4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,290	04.01.2027	800	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,367	02.01.2025	1.000	(4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,731	04.01.2027	400	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,746	04.01.2027	1.700	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,901	04.01.2027	4.000	(8)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,018	02.01.2025	2.800	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,098	02.01.2025	4.700	(4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,158	02.01.2025	2.300	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,163	02.01.2025	2.300	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,178	02.01.2025	4.700	(2)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	CAD 5.300	67	0,01
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,750	19.06.2029	NZD 2.000	3	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,360	07.08.2028	ZAR 500	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,380	04.08.2028	400	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,400	07.08.2028	500	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	31.07.2028	100	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	04.08.2028	1.100	1	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,410	07.08.2028	100	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	31.07.2028	100	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,415	04.08.2028	400	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,420	31.07.2028	300	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,421	04.08.2028	500	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,426	01.08.2028	100	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,428	31.07.2028	200	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	01.08.2028	200	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,460	02.08.2028	200	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,464	02.08.2028	200	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,543	04.08.2028	500	1	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,550	03.08.2028	800	1	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD 460	(13)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	18.640	(876)	(0,19)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024	1.600	(65)	(0,02)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025	19.492	(1.109)	(0,25)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024	650	(57)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500 %	20.09.2033	AUD 300	\$ 2	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	2.100	12	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	18.09.2034	3.300	(39)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	€ 6.200	1.003	0,22
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	2.300	971	0,21
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	100	6	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	200	8	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	100	2	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	6.800	392	0,09
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	21.09.2032	11.880	(873)	(0,19)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	3.400	93	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	800	(4)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,650	08.01.2034	200	5	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,670	03.04.2034	100	2	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	9.300	(167)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	05.03.2034	200	(2)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	3.300	(61)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	200	3	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	04.03.2034	200	(1)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	16.04.2029	200	(1)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	29.04.2034	100	0	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029	200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,818	26.06.2029	200	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029	200	(1)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,860	24.04.2029	200	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	300	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	200	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	100	(2)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	300	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	200	(3)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029	200	1	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,970	15.12.2033	200	(5)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,990	08.12.2033	200	(5)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	100	(3)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033	100	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	200	(8)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	100	(3)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033	200	(10)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	100	(3)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	08.11.2028	300	(9)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	21.08.2033	200	12	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	100	(5)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,300	03.10.2033	500	31	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	200	(11)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,370	09.10.2028	300	12	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,450	20.10.2028	300	13	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,160	06.06.2025	MXN 9.300	(28)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,535	04.05.2027	18.500	(116)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,950	30.01.2026	12.300	14	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,980	26.08.2024	500	2	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,990	30.01.2026	15.000	15	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,080	10.03.2026	20.700	12	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,490	08.09.2026	13.700	(12)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,620	18.02.2030	600	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,710	20.09.2029	500	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,150	11.06.2027	28.100	(82)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,165	06.09.2032	3.000	(15)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,200	11.06.2027	2.900	(9)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,360	21.08.2037	3.100	(21)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,370	11.10.2027	14.800	(52)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,380	04.11.2026	400	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,380	14.08.2037	700	3	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,480	18.06.2037	1.300	(9)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,495	14.01.2032	8.100	14	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,498	15.01.2032	33.500	59	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,603	14.04.2025	49.000	(74)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,610	15.04.2025	3.000	(5)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,670	05.03.2025	52.900	(60)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,710	07.03.2025	6.400	(8)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,715	07.03.2025	6.300	(8)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,800	28.12.2027	2.900	10	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,818	17.02.2027	11.400	(50)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,865	02.02.2027	11.900	(52)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,910	30.12.2027	600	2	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,984	10.12.2027	6.800	20	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,990	21.12.2027	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,005	21.12.2027	37.500	133	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,010	04.02.2027	5.200	(25)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,030	31.01.2028	4.600	13	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,050	31.01.2028	3.400	9	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,090	15.01.2027	13.000	(65)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,103	04.01.2038	5.600	27	0,01

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,120 %	15.01.2027	MXN 2.700	\$ (14)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,300	16.06.2028	6.800	(14)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,410	31.03.2027	11.100	23	0,01
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,444	25.07.2028	16.200	(38)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,471	26.07.2028	8.200	(19)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,512	24.07.2028	12.300	(28)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,550	27.07.2028	4.100	(9)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,556	27.07.2028	24.600	(53)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,600	31.07.2028	8.000	(16)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,620	28.07.2028	4.200	(9)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,636	28.07.2028	8.300	(17)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,640	28.07.2028	1.700	(3)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,650	28.07.2028	4.200	(8)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	8,660	28.07.2028	4.200	(8)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>		28-Day MXN-TIIE	8,673	31.05.2029	900	2	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,680	31.05.2029	1.200	2	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,681	31.05.2029	1.500	3	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>		28-Day MXN-TIIE	8,683	31.05.2029	500	1	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,701	31.03.2032	19.500	45	0,01
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,720	07.03.2029	500	1	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,725	07.03.2029	1.300	2	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,730	06.04.2027	16.500	29	0,01
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,730	07.03.2029	700	1	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,732	30.03.2032	8.200	18	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,760	01.03.2029	2.000	3	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,770	01.03.2029	1.000	2	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,780	01.03.2029	1.000	2	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,810	29.05.2031	1.000	2	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	9,073	03.06.2027	3.600	5	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	9,260	03.06.2027	2.100	2	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	9,340	03.06.2027	3.800	3	0,00
Zahlung		UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 300	(48)	(0,01)
Zahlung		UKRPI	4,020	15.10.2031	400	(61)	(0,01)
Zahlung		UKRPI	4,055	15.09.2031	400	(63)	(0,01)
Zahlung		UKRPI	4,066	15.09.2031	600	(84)	(0,02)
Zahlung		UKRPI	4,140	15.10.2031	1.000	(138)	(0,03)
Zahlung		UKRPI	4,250	15.11.2031	900	(100)	(0,02)
Zahlung		UKRPI	4,400	15.10.2031	400	(46)	(0,01)
						\$ 8.543	1,89
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 8.973</b>	<b>1,98</b>

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### VERKAUFSOPTIONEN

#### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
DUB	Call - OTC USD versus MXN	MXN 18,150	06.02.2025	330	\$ (15)	\$ (21)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	18,100	11.02.2025	132	(6)	(9)	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	18,150	13.02.2025	329	(15)	(21)	(0,01)
MYI	Call - OTC USD versus MXN	18,230	29.01.2025	331	(16)	(19)	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	18,250	30.01.2025	331	(16)	(19)	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	18,150	10.02.2025	331	(15)	(21)	0,00
					\$ (83)	\$ (110)	(0,02)

### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
	- OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	200	\$ (1)	\$ 0	0,00
	- OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	200	(1)	0	0,00
	- OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700	04.07.2024	200	0	0	0,00
	- OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	200	0	0	0,00
	- OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,700	05.07.2024	100	0	0	0,00
	- OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	100	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vermögens
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710 %	26.07.2024	200	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,586	15.07.2024	400	(2)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,885	10.07.2024	400	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,986	15.07.2024	400	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,235	10.07.2024	400	(1)	0	0,00
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689	15.07.2024	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	500	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	500	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	500	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	500	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	500	(2)	(3)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	500	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	500	(2)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	18.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	18.07.2024	100	0	(1)	0,00
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,850	05.07.2024	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	05.07.2024	500	(1)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,610	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	15.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,640	23.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,990	23.07.2024	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,800	03.07.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,150	03.07.2024	100	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	200	0	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	200	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	200	(1)	0	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	17.07.2024	200	0	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	22.07.2024	200	0	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	200	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	22.07.2024	200	0	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,970	17.07.2024	200	0	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	200	0	0	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	100	0	(1)	0,00
							\$ (43)	\$ (30)	(0,01)

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vermögens
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	\$ 94,969	08.07.2024	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,266	08.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,969	08.07.2024	100	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	95,594	06.08.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	98,594	06.08.2024	200	0	0	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,969	08.07.2024	100	0	0	0,00
					\$ (2)	\$ (2)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto-vermögens
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ (11)	\$ 11	\$ 0	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	200	(18)	16	(2)	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	300	(14)	14	0	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	940	(110)	112	2	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	(9)	10	1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	2	0	2	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(4)	3	(1)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(10)	10	0	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(9)	11	2	0,00

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2027	\$ 100	\$ (4)	\$ 3	\$ (1)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	100	(9)	8	(1)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	(7)	10	3	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	300	(3)	3	0	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	900	(101)	103	2	0,00
JPM	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	300	(2)	5	3	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	200	(7)	6	(1)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	200	(18)	16	(2)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(5)	7	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.100	3	8	11	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(1)	5	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	300	(6)	7	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	1.300	(14)	14	0	0,00
					\$ (358)	\$ 384	\$ 26	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110 %	25.05.2046	\$ 286	\$ (68)	\$ 51	\$ (17)	0,00
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(6)	5	(1)	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	25	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	1	0	0	0	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	6.850	14	(32)	(18)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	7.300	(39)	2	(37)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	1	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	5.981	(309)	308	(1)	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	298	(12)	12	0	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	0	(4)	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	138	(8)	8	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	595	(47)	46	(1)	0,00
MYC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	453	(107)	80	(27)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	0	(4)	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	1	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	69	(4)	4	0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	2.075	17	(22)	(5)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	1.200	6	(12)	(6)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	0	(2)	(2)	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	15.379	15	(29)	(14)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	69	(4)	4	0	0,00
					\$ (560)	\$ 423	\$ (137)	(0,03)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD 448	\$ 274	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	08.2024	\$ 274	NZD 448	0	(1)	(1)	0,00
	10.2024	1.140	CNH 8.158	0	(13)	(13)	0,00
BOA	07.2024	KRW 1.662.652	\$ 1.215	8	0	8	0,00
	07.2024	SGD 27	20	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 430	€ 394	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	253	PLN 1.008	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	468	SGD 632	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	SGD 27	\$ 20	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 34	TRY 1.189	0	0	0	0,00
	02.2025	132	MXN 2.409	0	(5)	(5)	0,00
BPS	07.2024	AUD 81	\$ 54	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	BRL 14.971	2.797	102	0	102	0,02
	07.2024	CAD 4.054	2.970	7	0	7	0,00
	07.2024	€ 573	617	3	0	3	0,00
	07.2024	£ 11.125	14.211	148	0	148	0,03
	07.2024	KRW 1.650.193	1.202	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 2.888	AUD 4.334	7	0	7	0,00
	07.2024	326	€ 299	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	200	IDR 3.277.278	0	0	0	0,00
	07.2024	51	ILS 188	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	545	NZD 887	0	(4)	(4)	0,00
	07.2024	605	PLN 2.402	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	1.406	SGD 1.907	1	0	1	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2024	AUD	4.334	\$ 2.891	\$ 0	\$ (7)	0,00
	08.2024	SGD	1.905	1.406	0	(1)	0,00
	09.2024	CNH	20.060	2.799	36	0	0,01
	09.2024	INR	9.890	118	0	0	0,00
	09.2024	TWD	56.785	1.765	11	0	0,00
	09.2024	\$	452	INR 37.804	1	0	0,00
	10.2024	CNH	6.915	\$ 966	11	0	0,00
	10.2024	\$	228	CNH 1.632	0	(2)	0,00
	05.2029	KWD	93	\$ 320	9	0	0,00
BRC	07.2024	AUD	74	49	0	0	0,00
	07.2024	MXN	4.568	247	0	(2)	0,00
	07.2024	NOK	151	14	0	0	0,00
	07.2024	SGD	541	400	1	0	0,00
	07.2024	\$	351	PLN 1.401	0	(2)	0,00
	07.2024		794	TRY 27.472	29	0	0,01
	08.2024		516	17.850	3	0	0,00
	09.2024	MXN	7.900	\$ 418	0	(9)	0,00
	09.2024	\$	775	TRY 28.688	42	0	0,01
	02.2025		132	MXN 2.394	0	(6)	0,00
CBK	07.2024	CHF	393	\$ 432	0	(5)	0,00
	07.2024	€	186	199	0	0	0,00
	07.2024	KRW	123.663	91	1	0	0,00
	07.2024	\$	3.739	BRL 20.376	0	(71)	(0,01)
	07.2024		622	PLN 2.467	0	(8)	0,00
	07.2024		135	TRY 4.552	1	0	0,00
	07.2024		237	ZAR 4.316	0	(1)	0,00
	08.2024	BRL	20.444	\$ 3.739	72	0	0,02
	09.2024	MXN	93	5	0	0	0,00
	09.2024	PEN	1.598	429	12	0	0,00
	09.2024	TWD	21.248	659	3	0	0,00
	09.2024	\$	2.507	INR 209.556	2	(1)	0,00
	01.2025		126	MXN 2.295	0	(5)	0,00
DUB	07.2024	AUD	121	\$ 80	0	(1)	0,00
	07.2024	KRW	901.923	656	0	0	0,00
	07.2024	\$	180	CLP 166.367	0	(4)	0,00
	07.2024		649	PLN 2.549	0	(15)	0,00
	08.2024	BRL	829	\$ 161	12	0	0,00
	09.2024	INR	42.581	508	0	(2)	0,00
	02.2025	MXN	5.748	317	14	0	0,00
	02.2025	\$	185	MXN 3.360	0	(8)	0,00
	03.2025		33	TRY 1.551	4	0	0,00
FAR	07.2024	AUD	4.058	\$ 2.704	0	(6)	0,00
	07.2024	€	24.195	26.352	422	0	0,09
	07.2024	NZD	861	525	0	0	0,00
	07.2024	\$	7.519	¥ 1.174.141	0	(220)	(0,05)
	07.2024		59	NZD 96	0	(1)	0,00
	08.2024		525	861	0	0	0,00
GLM	07.2024	MXN	4.562	\$ 246	0	(3)	0,00
	07.2024	\$	400	PLN 1.580	0	(7)	0,00
	07.2024		146	TRY 4.972	4	0	0,00
	07.2024	ZAR	1.739	\$ 95	0	0	0,00
	08.2024	\$	10.815	BRL 57.207	0	(554)	(0,12)
	08.2024		268	TRY 9.256	2	0	0,00
	09.2024		271	10.402	24	0	0,01
JPM	07.2024	BRL	375	\$ 75	7	0	0,00
	07.2024	CHF	238	263	0	(2)	0,00
	07.2024	CNY	104	15	0	0	0,00
	07.2024	KRW	1.113.097	807	0	(1)	0,00
	07.2024	SGD	1.972	1.465	10	0	0,00
	07.2024	\$	3.309	CHF 2.969	0	(4)	0,00
	07.2024		150	ILS 553	0	(3)	0,00
	07.2024		258	PLN 1.010	0	(7)	0,00
	07.2024		145	TRY 4.926	2	0	0,00
	07.2024	ZAR	3.295	\$ 179	0	(1)	0,00
	08.2024	CHF	2.958	3.309	4	0	0,00
	08.2024	\$	15	CNY 104	0	0	0,00
	08.2024		158	TRY 5.427	1	0	0,00
	09.2024	TWD	36.150	\$ 1.123	6	0	0,00
	09.2024	\$	296	INR 24.810	1	0	0,00
	10.2024	CNH	11.913	\$ 1.665	19	0	0,00
	10.2024	\$	228	CNH 1.626	0	(3)	0,00
MBC	03.2025		28	TRY 1.370	4	0	0,00
	07.2024	€	662	\$ 721	11	0	0,00
	07.2024	¥	1.174.215	7.314	14	0	0,00
	07.2024	\$	2.963	CAD 4.057	2	0	0,00
	07.2024		11	NOK 117	0	0	0,00
	08.2024	CAD	4.054	\$ 2.963	0	(2)	0,00
	08.2024	NOK	117	11	0	0	0,00
	08.2024	\$	7.314	¥ 1.168.718	0	(14)	0,00
	09.2024	TWD	1.244	\$ 39	0	0	0,00
	02.2025	\$	132	MXN 2.394	0	(6)	0,00
MYI	07.2024	BRL	5.024	\$ 973	68	0	0,02
	07.2024	€	242	259	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 100	€ 93	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	435	£ 343	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	600	NZD 978	0	(4)	(4)	0,00
	09.2024	TWD 14.381	\$ 448	4	0	4	0,00
	09.2024	\$ 198	INR 16.560	0	0	0	0,00
	01.2025	MXN 2.296	\$ 126	5	0	5	0,00
	02.2025	4.804	264	10	0	10	0,00
RBC	07.2024	\$ 13.673	£ 10.782	0	(43)	(43)	(0,01)
	08.2024	£ 10.782	\$ 13.675	43	0	43	0,01
SCX	07.2024	€ 365	392	1	0	1	0,00
	07.2024	KRW 837.387	614	6	0	6	0,00
	07.2024	MXN 37.833	2.041	0	(24)	(24)	(0,01)
	07.2024	\$ 15	CNY 104	0	0	0	0,00
	07.2024	27.344	€ 25.522	9	0	9	0,00
	08.2024	€ 25.522	\$ 27.384	0	(9)	(9)	0,00
	09.2024	CNH 8.232	1.147	13	0	13	0,00
	09.2024	TWD 22.280	691	3	0	3	0,00
	09.2024	\$ 2.155	INR 180.394	3	0	3	0,00
TOR	07.2024	CHF 10	\$ 12	0	0	0	0,00
	07.2024	NZD 652	400	2	0	2	0,00
	08.2024	\$ 399	NZD 652	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07.2024	CHF 2.329	\$ 2.578	0	(15)	(15)	0,00
	07.2024	ILS 608	164	3	0	3	0,00
	08.2024	\$ 170	€ 159	0	0	0	0,00
				\$ 1.248	\$ (1.130)	\$ 118	0,03

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II, Class T EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 491	\$ 534	\$ 7	\$ 0	\$ 7	0,00
	07.2024	MXN 2.532	151	13	0	13	0,00
	07.2024	TWD 53.764	1.661	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 130.381	€ 120.089	0	(1.675)	(1.675)	(0,37)
	07.2024	181	ILS 678	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	ILS 677	\$ 181	1	0	1	0,00
BPS	07.2024	BRL 9	2	0	0	0	0,00
	07.2024	CAD 2.733	2.003	5	0	5	0,00
	07.2024	€ 104.195	111.452	3	(223)	(223)	(0,05)
	07.2024	£ 4.098	5.235	54	0	54	0,01
	07.2024	¥ 427	3	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 2.644	AUD 3.968	6	0	6	0,00
	07.2024	101.624	€ 93.870	0	(1.018)	(1.018)	(0,22)
	07.2024	973	SGD 1.320	1	0	1	0,00
	08.2024	AUD 3.968	\$ 2.646	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	SGD 1.318	973	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 2	BRL 9	0	0	0	0,00
	08.2024	111.134	€ 103.751	223	0	223	0,05
BRC	07.2024	DKK 813	\$ 118	1	0	1	0,00
	07.2024	€ 73	78	0	0	0	0,00
	07.2024	IDR 8.182.661	503	3	0	3	0,00
	07.2024	NOK 3.702	352	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 873	KRW 1.215.396	9	0	9	0,00
	07.2024	416	MXN 7.597	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	KRW 1.213.301	\$ 873	0	(9)	(9)	0,00
	08.2024	MXN 7.597	414	1	0	1	0,00
CBK	07.2024	CHF 501	550	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	€ 61	66	1	0	1	0,00
	07.2024	ILS 679	183	3	0	3	0,00
	07.2024	MXN 2.532	151	13	0	13	0,00
	07.2024	SEK 9.683	912	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	TWD 17.964	555	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 104	BRL 563	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	46	€ 43	0	0	0	0,00
	07.2024	670	INR 55.968	2	0	2	0,00
	08.2024	BRL 562	\$ 103	3	0	3	0,00
	08.2024	INR 56.022	670	0	(2)	(2)	0,00
DUB	07.2024	KRW 1.212.602	882	2	0	2	0,00
FAR	07.2024	AUD 4.585	3.055	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	¥ 1.112.248	7.122	208	0	208	0,05
	07.2024	\$ 126.516	€ 116.160	0	(2.023)	(2.023)	(0,45)
	07.2024	6.977	¥ 1.111.728	0	(66)	(66)	(0,01)
	08.2024	¥ 1.106.512	\$ 6.977	66	0	66	0,01
GLM	07.2024	MYR 1.754	374	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 69	€ 64	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	373	MYR 1.754	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	MYR 1.754	\$ 373	1	0	1	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens			
JPM	07.2024	€	126	\$	135	\$	0	0,00		
	07.2024	SGD	1.320		980		7	0,00		
	07.2024	\$	759	BRL	4.108		0	0,00		
	07.2024		5.834	CHF	5.235		0	0,00		
	07.2024		380	CNY	2.710		0	0,00		
	07.2024		176	DKK	1.228		0	0,00		
	07.2024		552	TWD	17.973		2	0,00		
	08.2024	BRL	4.122	\$	759		19	0,00		
	08.2024	CHF	5.216		5.834		8	0,00		
	08.2024	CNY	2.712		380		0	0,00		
	08.2024	DKK	1.226		176		0	0,00		
	08.2024	TWD	17.957		552		0	0,00		
MBC	07.2024	€	114.376		122.306		3	(0,06)		
	07.2024	\$	410	AUD	617		2	0,00		
	07.2024		78	€	72		0	0,00		
	07.2024		2.865	HKD	22.372		0	0,00		
	07.2024		271	NOK	2.883		0	0,00		
	07.2024		2	SEK	25		0	0,00		
	08.2024	HKD	22.351	\$	2.865		0	0,00		
	08.2024	NOK	2.865		269		0	0,00		
	08.2024	\$	122.258	€	114.168		281	0,06		
MYI	07.2024	€	35	\$	38		0	0,00		
	07.2024	\$	121	DKK	843		0	0,00		
	07.2024		498	IDR	8.189.788		2	0,00		
	07.2024		77	NOK	819		0	0,00		
	07.2024		915	SEK	9.669		0	0,00		
	07.2024		749	ZAR	13.645		0	0,00		
	07.2024	ZAR	13.680	\$	732		0	0,00		
	08.2024	DKK	841		121		0	0,00		
	08.2024	IDR	8.195.171		498		0	0,00		
	08.2024	NOK	818		77		0	0,00		
	08.2024	SEK	9.655		915		2	0,00		
	08.2024	ZAR	13.677		749		2	0,00		
RBC	07.2024	€	5		5		0	0,00		
	07.2024	\$	5.197	£	4.098		0	0,00		
	08.2024	£	4.098	\$	5.198		16	0,00		
RYL	07.2024	DKK	2		0		0	0,00		
	07.2024	€	101		108		0	0,00		
SCX	07.2024	CNY	2.708		381		5	0,00		
	07.2024	€	114.655		122.843		1	(0,01)		
	07.2024	\$	629	CHF	565		0	0,00		
	08.2024		122.627	€	114.287		39	0,01		
SSB	07.2024	BRL	4.662	\$	908		69	0,02		
	07.2024	MXN	2.532		151		13	0,00		
	07.2024	\$	4.144	€	3.820		0	(0,01)		
TOR	07.2024	CHF	24	\$	26		0	0,00		
UAG	07.2024		5.279		5.842		0	(0,01)		
	07.2024	DKK	1.258		183		2	0,00		
	07.2024	HKD	22.375		2.863		0	0,00		
	07.2024	INR	55.967		671		0	0,00		
	08.2024	\$	123	€	114		0	0,00		
							\$ 1.111	\$ (5.525)	\$ (4.414)	(0,98)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens		
BOA	07.2024	£	0	\$	0	\$	0	0,00	
	07.2024	\$	0	ILS	0		0	0,00	
	08.2024	ILS	0	\$	0		0	0,00	
BPS	07.2024	BRL	0		0		0	0,00	
	07.2024	CAD	2		2		0	0,00	
	07.2024	€	7		8		0	0,00	
	07.2024	£	75		95		0	0,00	
	07.2024	\$	2	AUD	3		0	0,00	
	07.2024		8	€	7		0	0,00	
	07.2024		285	£	224		0	(2)	0,00
	07.2024		0	KRW	682		0	0,00	
	07.2024		1	SGD	1		0	0,00	
	08.2024	AUD	3	\$	2		0	0,00	
	08.2024	€	7		8		0	0,00	
	08.2024	KRW	681		0		0	0,00	
	08.2024	SGD	1		1		0	0,00	
	08.2024	\$	0	BRL	0		0	0,00	
	08.2024		95	£	75		0	0,00	
CBK	07.2024	CHF	0	\$	0		0	0,00	
	07.2024	£	76		96		0	0,00	
	07.2024	ILS	0		0		0	0,00	
	07.2024	MXN	2		0		0	0,00	
	07.2024	NOK	2		0		0	0,00	
	07.2024	SEK	6		1		0	0,00	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2024	TWD	63	\$	2	\$	0	0,00
	07.2024	\$	0	BRL	0	\$	0	0,00
	07.2024		1	INR	64		0	0,00
	08.2024	BRL	0	\$	0		0	0,00
	08.2024	INR	64		1		0	0,00
	08.2024	\$	96	£	76		0	0,00
FAR	07.2024	AUD	3	\$	2		0	0,00
	07.2024	¥	857		5		0	0,00
	07.2024	\$	5	¥	857		0	0,00
	08.2024	¥	853	\$	5		0	0,00
JPM	07.2024	SGD	1		0		0	0,00
	07.2024	\$	1	BRL	3		0	0,00
	07.2024		5	CHF	4		0	0,00
	07.2024		0	CNY	1		0	0,00
	07.2024		0	DKK	1		0	0,00
	07.2024		2	TWD	63		0	0,00
	08.2024	BRL	3	\$	1		0	0,00
	08.2024	CHF	4		5		0	0,00
	08.2024	CNY	1		0		0	0,00
	08.2024	DKK	1		0		0	0,00
	08.2024	TWD	63		2		0	0,00
MYI	07.2024	¥	0		0		0	0,00
	07.2024	\$	0	DKK	0		0	0,00
	07.2024		0	IDR	4.848		0	0,00
	07.2024		0	NOK	2		0	0,00
	07.2024		1	SEK	6		0	0,00
	07.2024		0	ZAR	9		0	0,00
	07.2024	ZAR	9	\$	0		0	0,00
	08.2024	DKK	0		0		0	0,00
	08.2024	IDR	4.851		0		0	0,00
	08.2024	NOK	2		0		0	0,00
	08.2024	SEK	6		1		0	0,00
	08.2024	ZAR	9		0		0	0,00
SCX	07.2024	CNY	1		0		0	0,00
	07.2024	\$	0	CHF	0		0	0,00
	07.2024		0	MXN	2		0	0,00
	08.2024	MXN	2	\$	0		0	0,00
SOG	07.2024	SGD	0		0		0	0,00
SSB	07.2024	BRL	3		1		0	0,00
TOR	07.2024	KRW	682		0		0	0,00
UAG	07.2024	CHF	4		4		0	0,00
	07.2024	DKK	1		0		0	0,00
	07.2024	HKD	17		2		0	0,00
	07.2024	IDR	4.843		0		0	0,00
	07.2024	INR	64		1		0	0,00
						\$	0	0,00
						\$	(2)	0,00
						\$	(2)	0,00
						\$	(4.551)	(1,00)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (4.551) (1,00)

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS	
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				
Ginnie Mae, TBA				
5,500 % fällig am 01.07.2054 (f)	\$	700	(694)	(0,16)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
2,000 % fällig am 01.08.2054	10.600	(8.300)	(1,83)	
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$	(8.994)	(1,99)
Summe Anlagen		\$	651.943	143,96
Sonstige Aktiva und Passiva		\$	(199.069)	(43,96)
Nettovermögen		\$	452.874	100,00

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Zum 30. Juni 2024 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 1,33 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
AMSURG Corp.	06.11.2023	\$ 2.204	\$ 2.612	0,58
Intelsat Emergence S.A.	19.06.2017 - 23.02.2022	5.147	2.042	0,45
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	11.02.2020	619	444	0,10
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	278	1.168	0,26
		\$ 8.248	\$ 6.266	1,39

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 23.189 USD (31. Dezember 2023: 33.030 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 1.021 USD) wurde zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 8.260 USD (31. Dezember 2023: 8.742 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 5.084 USD (31. Dezember 2023: 164 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 82.517	\$ 564.553	\$ 7.262	\$ 654.332
Investmentfonds	534	0	0	534
Pensionsgeschäfte	0	1.165	0	1.165
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(79)	5.029	(44)	4.906
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(8.994)	0	(8.994)
<b>Summen</b>	<b>\$ 82.972</b>	<b>\$ 561.753</b>	<b>\$ 7.218</b>	<b>\$ 651.943</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 77.266	\$ 570.339	\$ 7.139	\$ 654.744
Investmentfonds	179	0	0	179
Pensionsgeschäfte	0	605	0	605
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(439)	6.287	(30)	5.818
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(13.890)	0	(13.890)
<b>Summen</b>	<b>\$ 77.006</b>	<b>\$ 563.341</b>	<b>\$ 7.109</b>	<b>\$ 647.456</b>

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,480 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ (6.495)	\$ (6.498)	(1,43)
		5,540	27.06.2024	03.07.2024	(4.393)	(0,97)
SCX	5,560	26.06.2024	03.07.2024	(12.478)	(12.487)	(2,76)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (23.381)</b>	<b>(5,16)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (13)	\$ 0	\$ (13)	\$ (76)	\$ 0	\$ (76)
BOA	(1.676)	2.040	364	(86)	60	(26)
BPS	(648)	710	62	(107)	10	(97)
BRC	66	(50)	16	461	(1.010)	(549)
CBK	10	0	10	(100)	0	(100)
DUB	(50)	0	(50)	(23)	0	(23)
FAR	(1.631)	1.940	309	(28)	0	(28)
GLM	(548)	270	(278)	(124)	0	(124)

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
GST	\$ (51)	\$ 0	\$ (51)	\$ 9	\$ 0	\$ 9
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
JPM	35	0	35	(106)	0	(106)
MBC	10	(10)	0	(141)	0	(141)
MEI	(5)	0	(5)	(1)	0	(1)
MYC	(20)	94	74	10	94	104
MYI	6	30	36	456	(1.000)	(544)
RYL	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(27)	0	(27)	(2)	0	(2)
SCX	7	0	7	(128)	0	(128)
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	(10)	0	(10)
SSB	32	0	32	3	0	3
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	76	0	76
UAG	(46)	0	(46)	383	(990)	(607)
ULO	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	80,92	68,71
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	62,64	76,18
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,92	0,64
Investmentfonds	0,12	0,04
Pensionsgeschäfte	0,26	0,13
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,11	(0,38)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,98	1,57
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,00)	0,10
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,99)	(3,09)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(5,16)	(7,36)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,23)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,75	0,96
Unternehmensanleihen und Wechsel	11,74	13,58
Wandelanleihen & Wechsel	0,00	0,00
Kommunalanleihen und Wechsel	0,09	0,07
US-Regierungsbehörden	46,65	44,18
US-Schatzobligationen	19,76	19,83
Non-Agency-MBS	7,56	8,07
Forderungsbesicherte Wertpapiere	21,39	22,35
Staatsemissionen	5,52	5,62
Stammaktien	25,15	24,64
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,46	0,60
Real Estate Investment Trusts	5,41	5,48
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,15
Investmentfonds	0,12	0,04
Pensionsgeschäfte	0,26	0,13
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,11	(0,38)
Verkaufsoptionen		
Futures-ähnliche Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,08	0,13
Zinsswaps	1,89	1,43
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,02)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,02)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,03)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	0,03	(0,07)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,98)	0,18
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,99)	(3,09)
Sonstige Aktiva und Passiva	(43,96)	(43,90)
Nettovermögen	100,00	100,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>Castellum AB</b>				<b>5,300 % fällig am 15.01.2029</b>	\$ 2.000	\$ 1.972	0,05
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				0,750 % fällig am 04.09.2026	€ 9.700	\$ 9.699	0,24	<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>	4.800	4.433	0,11
<b>Cotiviti Corp.</b>				<b>CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-</b>				<b>1,948 % fällig am 21.10.2027</b>	6.000	5.962	0,14
8,579 % fällig am 01.05.2031	\$ 1.895	\$ 1.890	0,05	<b>SIF-Pan European Core Fund</b>				<b>3,272 % fällig am 29.09.2025</b>			
<b>Project Hudson</b>				0,500 % fällig am 27.01.2028	13.300	12.578	0,30	<b>Golub Capital BDC, Inc.</b>	5.800	5.925	0,14
7,730 % fällig am 29.05.2026	2.100	2.109	0,05	0,900 % fällig am 12.10.2029	7.600	6.892	0,17	<b>7,050 % fällig am 05.12.2028</b>			
		3.999	0,10	<b>Citibank N.A.</b>				<b>Goodman Australia Finance Pty. Ltd.</b>	5.000	5.423	0,13
				5,803 % fällig am 29.09.2028	\$ 2.800	2.877	0,07	<b>4,250 % fällig am 03.05.2030</b>	€ 5.000		
				5,864 % fällig am 29.09.2025	3.200	3.217	0,08	<b>Goodman U.S. Finance Four LLC</b>			
				<b>Citigroup, Inc.</b>				<b>4,500 % fällig am 15.10.2037</b>	\$ 6.900	5.947	0,14
				1,250 % fällig am 06.07.2026	€ 5.000	5.227	0,13	<b>GSPA Monetization Trust</b>			
				3,070 % fällig am 24.02.2028	\$ 7.400	6.985	0,17	<b>6,422 % fällig am 09.10.2029</b>	8.776	8.642	0,21
				5,174 % fällig am 13.02.2030	8.700	8.651	0,21	<b>HAT Holdings LLC</b>			
				<b>Citycon Treasury BV</b>				<b>3,750 % fällig am 15.09.2030</b>	2.150	1.877	0,05
				1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 15.000	13.774	0,33	<b>8,000 % fällig am 15.06.2027</b>	3.800	3.955	0,10
				<b>Clarion Funding PLC</b>				<b>Host Hotels &amp; Resorts LP</b>			
				1,250 % fällig am 13.11.2032	€ 2.400	2.237	0,05	<b>4,500 % fällig am 01.02.2026</b>	7.800	7.664	0,19
				<b>Cooperative Rabobank UA</b>				<b>HSBC Holdings PLC</b>			
				4,655 % fällig am 22.08.2028	\$ 10.500	10.257	0,25	<b>7,390 % fällig am 03.11.2028</b>	6.300	6.665	0,16
				5,447 % fällig am 05.03.2030	8.400	8.404	0,20	<b>HSBC USA, Inc.</b>			
				5,500 % fällig am 18.07.2025	2.200	2.204	0,05	<b>5,625 % fällig am 17.03.2025</b>	8.100	8.104	0,20
				<b>Corebridge Global Funding</b>				<b>Indian Railway Finance Corp. Ltd.</b>			
				5,750 % fällig am 02.07.2026	2.500	2.510	0,06	<b>3,835 % fällig am 13.12.2027</b>	3.300	3.144	0,08
				<b>CPI Property Group S.A.</b>				<b>ING Groep NV</b>			
				1,750 % fällig am 14.01.2030	€ 6.100	4.958	0,12	<b>1,125 % fällig am 07.12.2028</b>	€ 9.100	10.106	0,25
				2,750 % fällig am 12.05.2026	6.900	6.929	0,17	<b>2,125 % fällig am 23.05.2026</b>	€ 4.200	4.433	0,11
				4,000 % fällig am 22.01.2028	€ 400	442	0,01	<b>3,875 % fällig am 12.08.2029</b>	2.000	2.157	0,05
				<b>Credit Agricole S.A.</b>				<b>4,000 % fällig am 12.02.2035</b>	3.800	4.104	0,10
				6,316 % fällig am 03.10.2029	\$ 7.500	7.706	0,19	<b>International Development Association</b>			
				<b>Crown Castle, Inc.</b>				<b>0,750 % fällig am 21.09.2028</b>	€ 11.000	12.016	0,29
				4,800 % fällig am 01.09.2028	5.000	4.897	0,12	<b>1,750 % fällig am 05.05.2037</b>	€ 11.100	10.089	0,24
				<b>CTP NV</b>				<b>Intesa Sanpaolo SpA</b>			
				0,500 % fällig am 21.06.2025	€ 791	819	0,02	<b>0,750 % fällig am 16.03.2028</b>	10.200	9.840	0,24
				0,875 % fällig am 20.01.2026	3.421	3.495	0,08	<b>Iridium Capital PLC</b>			
				1,500 % fällig am 27.09.2031	4.700	4.128	0,10	<b>9,250 % fällig am 18.06.2029</b>	6.000	6.487	0,16
				<b>Danske Bank A/S</b>				<b>JAB Holdings BV</b>			
				6,500 % fällig am 23.08.2028	€ 5.000	6.579	0,16	<b>4,375 % fällig am 25.04.2034</b>	700	754	0,02
				<b>Deutsche Bank AG</b>				<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>			
				1,000 % fällig am 19.11.2025	€ 600	636	0,02	<b>4,323 % fällig am 26.04.2028</b>	\$ 4.333	4.228	0,10
				1,625 % fällig am 20.01.2027	7.400	7.509	0,18	<b>4,851 % fällig am 25.07.2028</b>	16.300	16.137	0,39
				1,750 % fällig am 19.11.2030	14.200	13.394	0,32	<b>5,299 % fällig am 24.07.2029</b>	8.600	8.631	0,21
				1,875 % fällig am 23.02.2028	4.000	4.065	0,10	<b>5,581 % fällig am 22.04.2030</b>	1.600	1.626	0,04
				2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 9.000	11.223	0,27	<b>6,070 % fällig am 22.10.2027</b>	8.200	8.345	0,20
				3,961 % fällig am 26.11.2025	\$ 6.800	6.743	0,16	<b>KBC Group NV</b>			
				<b>Digital Dutch Finco BV</b>				<b>0,250 % fällig am 01.03.2027</b>	€ 3.000	3.037	0,07
				0,625 % fällig am 15.07.2025	€ 4.600	4.770	0,12	<b>0,375 % fällig am 16.06.2027</b>	3.200	3.223	0,08
				1,000 % fällig am 15.01.2032	1.000	859	0,02	<b>Kookmin Bank</b>			
				<b>Digital Euro Finco LLC</b>				<b>4,500 % fällig am 01.02.2029 (f)</b>	\$ 7.400	7.104	0,17
				2,500 % fällig am 16.01.2026	6.100	6.390	0,15	<b>LeasePlan Corp. NV</b>			
				<b>DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt am Main</b>				<b>0,250 % fällig am 23.02.2026</b>	€ 15.000	15.218	0,37
				4,464 % fällig am 16.11.2026	5.600	6.027	0,15	<b>Lendlease Finance Ltd.</b>			
				<b>EQT AB</b>				<b>3,400 % fällig am 27.10.2027</b>	AUD 24.900	15.243	0,37
				2,375 % fällig am 06.04.2028	10.000	10.110	0,25	<b>3,700 % fällig am 31.03.2031</b>	4.800	2.675	0,06
				2,875 % fällig am 06.04.2032	7.400	7.185	0,17	<b>Lloyds Banking Group PLC</b>			
				<b>Equitable Financial Life Global Funding</b>				<b>4,375 % fällig am 22.03.2028</b>	\$ 1.200	1.163	0,03
				5,450 % fällig am 03.03.2028	\$ 4.900	4.905	0,12	<b>5,462 % fällig am 05.01.2028</b>	6.600	6.588	0,16
				<b>Europäische Investitionsbank</b>				<b>Logicor Financing SARL</b>			
				0,750 % fällig am 15.11.2024	€ 9.700	12.066	0,29	<b>1,625 % fällig am 15.07.2027</b>	€ 1.100	1.088	0,03
				<b>Federation des Caisses Desjardins du Quebec</b>				<b>2,000 % fällig am 17.01.2034</b>	11.600	9.857	0,24
				4,400 % fällig am 23.08.2025	\$ 11.000	10.869	0,26	<b>2,250 % fällig am 13.05.2025</b>	2.000	2.107	0,05
				5,700 % fällig am 14.03.2028	6.600	6.679	0,16	<b>3,250 % fällig am 13.11.2028</b>	12.600	12.824	0,31
				<b>First Abu Dhabi Bank PJSC</b>				<b>MassMutual Global Funding</b>			
				5,000 % fällig am 28.02.2029	5.000	4.977	0,12	<b>5,050 % fällig am 07.12.2027</b>	\$ 7.100	7.098	0,17
				<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>				<b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b>			
				1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 7.600	8.136	0,20	<b>1,412 % fällig am 17.07.2025</b>	11.200	10.735	0,26
				5,800 % fällig am 05.03.2027	\$ 7.200	7.203	0,17	<b>4,636 % fällig am 07.06.2031</b>	€ 1.000	1.125	0,03
				7,350 % fällig am 04.11.2027	1.000	1.042	0,03	<b>5,719 % fällig am 20.02.2026</b>	\$ 6.600	6.599	0,16
				<b>G City Europe Ltd.</b>				<b>Mizuho Financial Group, Inc.</b>			
				4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 5.300	5.487	0,13	<b>5,414 % fällig am 13.09.2028</b>	8.800	8.827	0,21
				<b>Gaci First Investment Co.</b>				<b>Morgan Stanley</b>			
				5,125 % fällig am 14.02.2053	\$ 9.600	8.318	0,20	<b>2,720 % fällig am 22.07.2025</b>	5.000	4.991	0,12
				5,375 % fällig am 29.01.2054	8.100	7.198	0,17	<b>5,050 % fällig am 28.01.2027</b>	6.000	5.968	0,14
				<b>Globalworth Real Estate Investments Ltd.</b>				<b>Morgan Stanley Bank N.A.</b>			
				6,250 % fällig am 31.03.2030	€ 5.336	5.353	0,13	<b>5,882 % fällig am 30.10.2026</b>	5.300	5.367	0,13
				<b>GLP Capital LP</b>				<b>6,436 % fällig am 14.01.2028</b>	8.800	8.866	0,21
				4,000 % fällig am 15.01.2030	\$ 2.600	2.384	0,06	<b>Nationwide Building Society</b>			
								<b>6,557 % fällig am 18.10.2027</b>	8.200	8.370	0,20









BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Paraguay Government International Bond 4,950 % fällig am 28.04.2031	\$ 2.300	\$ 2.205	0,05	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short- Term Fund (e)	10.082.473	\$ 102.740	2,49
Province of Ontario 1,850 % fällig am 01.02.2027	CAD 7.000	4.860	0,12	BGC Group, Inc. 3,750 % fällig am 01.10.2024	\$ 1.195	\$ 1.186	0,03	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (e)	1.267.284	12.629	0,30
Republic of Poland Government International Bond 5,125 % fällig am 18.09.2034	\$ 4.200	4.137	0,10	Summe kurzfristige Instrumente		1.186	0,03	Summe Investmentfonds	\$	126.791	3,07
Romania Government International Bond 3,000 % fällig am 27.02.2027	12.000	11.175	0,27	<b>INVESTMENTFONDS</b>							
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 16.01.2030	8.700	8.559	0,21	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>							
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033	£ 1.300	1.241	0,03	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (e)	981.265	11.422	0,28				
4,375 % fällig am 31.07.2054	19.890	23.983	0,58	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 5.606.401	135,86				
		210.550	5,10								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto-vernögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 417	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (425)	\$ 417	\$ 417	0,01
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (425)	\$ 417	\$ 417	0,01

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	444	\$ 266	0,01
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	1.483	(1.421)	(0,03)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	1.591	(1.717)	(0,04)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	166	(217)	(0,01)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	79	116	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	98	34	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	3.972	1.965	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	1.479	1.380	0,03
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	731	859	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	36	23	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	210	(93)	0,00
				\$ 1.195	0,03
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 1.195	0,03

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Boeing Co.	1,000 %	20.12.2025	\$ 4.600	\$ 93	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	4.000	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2027	4.600	189	0,01
Boeing Co.	1,000	20.06.2029	10.300	(217)	(0,01)
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	5.500	108	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 14.500	2.702	0,07
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	\$ 6.700	(17)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2024	8.000	8	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	500	14	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	5.000	84	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	1.200	24	0,00
				\$ 2.988	0,07

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 9.312	\$ 210	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	(5,000)	20.06.2026	5.238	183	0,00
CDX.HY-38 5-Year Index	(5,000)	20.06.2027	96.127	(8.560)	(0,21)
				\$ (8.167)	(0,20)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000 %	20.06.2029	\$ 59.900	\$ (87)	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,900 %	15.03.2052	£ 8.400	\$ 4.705	0,11
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,700	28.03.2034	1.600	44	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	24.900	644	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	5.300	308	0,01
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,320	20.10.2033	1.700	68	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,062	18.09.2026	¥ 3.550.000	(288)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,063	19.09.2026	7.000	(1)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,064	19.09.2026	877.000	(72)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,380	18.06.2028	5.170.000	(609)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	2.698.500	1.711	0,04
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,662	19.04.2042	260.000	201	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,705	31.10.2038	1.180.000	534	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,750	20.03.2038	436.000	142	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,750	20.12.2038	1.947.000	912	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,785	12.11.2038	600.000	270	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	22.10.2038	400.000	174	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	500.000	607	0,02
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	\$ 14.800	(2.308)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	60.600	9.624	0,23
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	45.000	(6.807)	(0,16)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,943	21.04.2032	14.800	(2.002)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,680	11.07.2032	31.600	(3.208)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,690	11.07.2032	31.600	(3.177)	(0,08)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,050	14.12.2052	9.570	1.375	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,156	10.03.2033	21.900	509	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.12.2025	40.000	362	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	90.500	1.322	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,613	15.08.2033	66.600	2.147	0,05
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,650	05.12.2024	68.600	(1.003)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,684	03.01.2034	1.800	63	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,687	15.08.2033	115.400	3.047	0,07
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,717	15.08.2033	24.100	580	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,722	31.10.2030	4.400	95	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,727	31.10.2030	8.900	189	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,732	31.10.2030	6.000	126	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,734	15.08.2033	33.200	753	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,739	31.10.2030	9.000	185	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,743	15.08.2033	4.400	97	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,745	15.08.2033	3.100	68	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2029	9.800	229	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	02.01.2034	1.900	55	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,753	15.08.2033	12.700	269	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,754	15.08.2033	10.700	226	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,763	15.08.2033	20.400	416	0,01
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,800	22.08.2030	1.900	(44)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,807	31.05.2028	24.700	359	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,810	02.01.2034	1.900	46	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,854	29.12.2033	3.700	76	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,080	05.06.2034	3.900	(20)	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,105	24.04.2034	3.500	45	0,00
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,130	03.05.2034	3.600	52	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,160	31.05.2025	75.900	(24)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5,388	18.10.2024	76.500	48	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,496	04.01.2027	BRL 223.000	(342)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,528	04.01.2027	99.600	(141)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,548	04.01.2027	195.600	(255)	(0,01)
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	01.06.2032	CAD 44.100	190	0,00
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2033	12.000	(182)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	NZD 39.100	(124)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,250	21.12.2027	3.300	(25)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	AUD 10.900	177	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	12.000	365	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 4.000	(48)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650 %	12.04.2027	€ 25.000	\$ (1.758)	(0,04)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	21.000	(1.261)	(0,03)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2024	46.900	2.250	0,05	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,650	08.01.2034	3.600	91	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,670	03.04.2034	1.600	32	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	05.03.2034	2.600	(20)	0,00	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	121.600	(3.083)	(0,07)	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	3.100	44	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	04.03.2034	2.600	(17)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	16.04.2029	3.800	(24)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	29.04.2034	2.400	(10)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029	3.900	(20)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,827	06.05.2029	3.900	(11)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,860	24.04.2029	5.700	(9)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	4.600	(57)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	3.500	(63)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	2.200	(45)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	5.100	(72)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	2.800	(46)	0,00	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029	3.100	15	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	2.300	(77)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033	1.800	(71)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	2.900	(117)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	2.300	(60)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255	22.11.2028	1.900	(57)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	1.400	(74)	0,00	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	2.700	(149)	0,00	
Zahlung <sup>(4)</sup>	28-Day MXN-TIIE	9,430	06.04.2029	MXN 76.300	(28)	0,00	
Zahlung <sup>(4)</sup>	28-Day MXN-TIIE	9,510	06.04.2029	48.000	(10)	0,00	
						\$ 8.028	0,20
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 2.762</b>	<b>0,07</b>

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	Put - OTC CDX.IG-42 5-Year Index	Kauf	0,600 %	20.11.2024	13.300	\$ 28	\$ 36	0,00

#### DEVIENOPTIEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens	
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,275	06.12.2024	700	\$ 84	\$ 178	0,01	
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	06.12.2024	400	50	77	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	06.12.2024	500	46	71	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,325	14.01.2025	500	48	82	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	14.01.2025	500	40	63	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	23.01.2025	500	47	63	0,00	
BRC	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	200	21	30	0,00	
CBK	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.01.2025	500	52	94	0,00	
	Call - OTC USD versus CNH	7,450	14.02.2025	500	48	57	0,00	
DUB	Call - OTC USD versus CNH	7,400	12.12.2024	4.400	407	649	0,02	
GLM	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,200	26.09.2024	11.100	367	21	0,00	
MBC	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7,350	06.12.2024	700	68	128	0,01	
	Call - OTC USD versus CNH	7,375	14.02.2025	500	49	68	0,00	
SCX	Call - OTC USD versus CNH	7,300	14.02.2025	200	20	30	0,00	
						\$ 1.347	\$ 1.611	0,04

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,070 %	04.06.2025	9.700	\$ 336	\$ 341	0,01
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,725	14.11.2024	48.700	0	24	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,749	13.11.2024	73.900	0	37	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,754	15.11.2024	34.200	0	18	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,765	18.11.2024	26.100	0	15	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	20.11.2024	35.100	0	23	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	17.12.2024	30.600	0	29	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,820	21.11.2024	35.100	0	25	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,840	05.12.2024	40.600	0	38	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,850	22.11.2024	26.100	0	21	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	09.12.2024	40.600	0	45	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	13.12.2024	41.400	0	50	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,920	25.11.2024	37.000	0	36	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,920	03.12.2024	28.800	0	32	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	29.11.2024	66.600	0	73	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	11.12.2024	40.500	0	51	0,00
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,920	27.02.2025	6.900	302	245	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,329	29.05.2025	11.700	399	279	0,01
							\$ 1.037	\$ 1.382	0,03

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	Put - OTC CDX.JG-42 5-Year Index	Verkauf	0,800 %	20.11.2024	26.600	\$ (27)	\$ (33)	0,00

## DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,100	26.09.2024	22.200	\$ (228)	\$ (2)	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	3.600	\$ (16)	\$ (5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	3.600	(16)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700	04.07.2024	4.000	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	4.000	(6)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,700	05.07.2024	2.400	(9)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	2.400	(9)	(1)	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	2.400	(9)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	2.400	(9)	(12)	0,00
FAR	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,430	04.06.2025	37.200	(335)	(314)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,586	15.07.2024	3.800	(14)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,885	10.07.2024	3.900	(13)	(15)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,986	15.07.2024	3.800	(14)	(21)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,235	10.07.2024	3.900	(13)	(2)	0,00
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689	15.07.2024	6.900	(14)	(3)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	6.900	(14)	(16)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,244	27.02.2025	26.200	(301)	(231)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	3.500	(15)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	6.700	(26)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	6.900	(25)	(12)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	3.400	(13)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	5.200	(17)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	7.000	(21)	(20)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	6.700	(26)	(43)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	6.900	(25)	(45)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	3.500	(15)	(23)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	3.400	(13)	(17)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	5.200	(17)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	7.000	(21)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,300	14.11.2024	5.400	0	(26)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	13.11.2024	8.200	0	(40)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	15.11.2024	3.800	0	(19)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.11.2024	2.900	0	(15)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,350	20.11.2024	3.900	0	(23)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,353	17.12.2024	3.400	0	(25)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,357	21.11.2024	3.900	0	(24)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,360	22.11.2024	2.900	0	(18)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,363	05.12.2024	4.500	0	(32)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,395	09.12.2024	4.500	0	(35)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,400	25.11.2024	4.100	0	(29)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,425	13.12.2024	4.600	0	(41)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	03.12.2024	3.200	0	(27)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,465	29.11.2024	3.200	0	(29)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,468 %	29.11.2024	4.200	\$ 0	\$ (38)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,468	11.12.2024	4.500	0	(44)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	1.900	(7)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	18.07.2024	2.300	(8)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	1.900	(7)	(8)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	18.07.2024	2.300	(8)	(10)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,850	05.07.2024	7.800	(19)	(3)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	05.07.2024	7.800	(19)	(3)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,610	15.07.2024	2.500	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	15.07.2024	2.500	(5)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,640	23.07.2024	1.800	(7)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	3.600	(14)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	1.800	(7)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,990	23.07.2024	1.800	(7)	(12)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	3.600	(14)	(19)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	1.800	(7)	(1)	0,00
	MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,800	03.07.2024	2.100	(9)	(3)
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,150	03.07.2024	2.100	(9)	0	0,00
Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,750	29.05.2025	44.900	(399)	(241)	(0,01)
Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	4.100	(7)	(10)	0,00
Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap		6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	4.100	(7)	(1)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	3.600	(9)	(7)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	3.600	(13)	(10)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	3.300	(14)	(10)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	3.600	(13)	(21)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	3.600	(9)	(16)	0,00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	3.300	(14)	(4)	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	17.07.2024	4.100	(7)	(3)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	22.07.2024	4.100	(7)	(4)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	4.000	(6)	(6)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	22.07.2024	4.100	(7)	(9)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,970	17.07.2024	4.100	(7)	(6)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	4.000	(6)	(3)	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	3.200	(10)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	3.200	(10)	(15)	0,00
							\$ (1.729)	\$ (1.735)	(0,04)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	\$ 94,969	08.07.2024	2.200	\$ (9)	\$ (1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,266	08.07.2024	3.500	(7)	(4)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,719	08.07.2024	2.300	(4)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,969	08.07.2024	2.200	(7)	(1)	0,00
MSC	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,250	08.07.2024	5.300	(10)	(7)	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,969	08.07.2024	2.600	(8)	(1)	0,00
					\$ (45)	\$ (15)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2027	\$ 1.600	\$ (77)	\$ 69	\$ (8)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	400	(36)	31	(5)	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.325	(107)	105	(2)	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	700	(25)	22	(3)	0,00
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.000	(112)	98	(14)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.300	(116)	100	(16)	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.275	(104)	102	(2)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(15)	13	(2)	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	2.900	(104)	90	(14)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	3.400	(303)	261	(42)	0,00
					\$ (999)	\$ 891	\$ (108)	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzu- nahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	NZD 1.562	\$ 957	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
	08.2024	\$ 957	NZD 1.562	0	(5)	(5)	0,00
	10.2024	5.881	CNH 42.093	0	(66)	(66)	0,00
BOA	07.2024	€ 804.187	\$ 873.139	11.252	0	11.252	0,27
	07.2024	HKD 17.944	2.300	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 8.974.089	6.560	42	0	42	0,00
	07.2024	SGD 122	90	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.689	€ 1.569	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	1.326	PLN 5.283	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	25.816	SGD 35.023	36	(9)	27	0,00
	08.2024	SGD 32.010	\$ 23.618	0	(36)	(36)	0,00
	08.2024	TRY 1.104	32	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 8	TRY 269	0	0	0	0,00
BPS	02.2025	CNH 6.730	\$ 942	5	0	5	0,00
	07.2024	CAD 6.769	4.959	13	0	13	0,00
	07.2024	€ 9.268	9.938	19	(14)	5	0,00
	07.2024	£ 211.341	269.968	2.813	0	2.813	0,07
	07.2024	¥ 221.900	1.410	30	0	30	0,00
	07.2024	KRW 8.990.680	6.550	20	0	20	0,00
	07.2024	\$ 24.288	AUD 36.452	56	0	56	0,00
	07.2024	50	BRL 268	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	6.133	€ 5.699	0	(25)	(25)	0,00
	07.2024	1.093	£ 860	0	(6)	(6)	0,00
	07.2024	1.100	IDR 18.025.029	2	0	2	0,00
	07.2024	301	ILS 1.115	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	2.954	NZD 4.809	0	(24)	(24)	0,00
	07.2024	3.115	PLN 12.370	0	(39)	(39)	0,00
	08.2024	AUD 36.452	\$ 24.309	0	(56)	(56)	0,00
	08.2024	\$ 5	TRY 186	0	0	0	0,00
	09.2024	CNH 102.965	\$ 14.368	183	0	183	0,00
	09.2024	TWD 543.352	16.886	103	0	103	0,00
	09.2024	\$ 2.309	INR 193.221	3	0	3	0,00
	10.2024	CNH 35.493	\$ 4.957	54	0	54	0,00
10.2024	\$ 1.164	CNH 8.339	0	(12)	(12)	0,00	
12.2024	1.713	12.287	0	(10)	(10)	0,00	
01.2025	CNH 12.844	\$ 1.798	13	0	13	0,00	
05.2029	KWD 1.021	3.510	101	0	101	0,00	
BRC	07.2024	AUD 376	249	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	CAD 153	112	0	0	0	0,00
	07.2024	PLN 25	6	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 3.042	2.253	8	0	8	0,00
	07.2024	THB 1.835	50	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 818	NOK 8.601	0	(10)	(10)	0,00
	07.2024	1.905	PLN 7.610	0	(12)	(12)	0,00
	07.2024	5.847	TRY 203.432	249	0	249	0,01
	08.2024	3.602	125.478	16	0	16	0,00
	09.2024	MXN 266.507	\$ 14.211	0	(190)	(190)	0,00
	09.2024	\$ 721	TRY 25.976	10	0	10	0,00
	02.2025	942	CNH 6.727	0	(5)	(5)	0,00
	CBK	07.2024	BRL 14.063	\$ 2.581	49	0	49
07.2024		CHF 1.945	2.137	0	(27)	(27)	0,00
07.2024		£ 664	848	8	0	8	0,00
07.2024		KRW 618.302	453	4	0	4	0,00
07.2024		NZD 399	243	0	0	0	0,00
07.2024		\$ 6.641	BRL 33.388	0	(631)	(631)	(0,01)
07.2024		6.240	£ 4.885	0	(64)	(64)	0,00
07.2024		3.410	PLN 13.525	0	(46)	(46)	0,00
07.2024		183	THB 6.710	0	0	0	0,00
07.2024		27	ZAR 502	0	0	0	0,00
08.2024		2.581	BRL 14.110	0	(50)	(50)	0,00
09.2024		TWD 204.052	\$ 6.331	28	0	28	0,00
09.2024		\$ 25.866	INR 2.162.452	20	(10)	10	0,00
01.2025		1.799	CNH 12.841	0	(14)	(14)	0,00
DUB		07.2024	AUD 664	\$ 439	0	(4)	(4)
	07.2024	BRL 264	50	3	0	3	0,00
	07.2024	KRW 4.868.089	3.538	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 350	BRL 1.757	0	(33)	(33)	0,00
	07.2024	3.294	PLN 12.945	0	(74)	(74)	0,00
	08.2024	BRL 7.784	\$ 1.512	116	0	116	0,00
	12.2024	\$ 16.368	CNH 116.810	0	(168)	(168)	0,00
	03.2025	100	TRY 4.738	12	0	12	0,00
FAR	07.2024	AUD 35.412	\$ 23.594	0	(56)	(56)	0,00
	07.2024	NZD 5.559	3.406	19	0	19	0,00
	07.2024	\$ 3.556	¥ 566.652	0	(34)	(34)	0,00
	08.2024	¥ 563.994	\$ 3.556	34	0	34	0,00
GLM	08.2024	\$ 1.831	NZD 3.002	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	KRW 7.697	\$ 6	0	0	0	0,00
	07.2024	MXN 22.352	1.204	0	(16)	(16)	0,00
	07.2024	\$ 12.369	€ 11.506	0	(38)	(38)	0,00
	07.2024	100	KRW 137.380	0	0	0	0,00
07.2024	2.091	PLN 8.261	0	(37)	(37)	0,00	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzu- nahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	\$ 5.926	ZAR 108.426	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	08.2024	17.725	BRL 93.758	0	(908)	(908)	(0,02)
	08.2024	4.354	TRY 150.254	27	0	27	0,00
	09.2024	1.110	44.363	148	0	148	0,00
JPM	07.2024	CAD 19.594	\$ 14.259	0	(60)	(60)	0,00
	07.2024	CHF 1.163	1.286	0	(8)	(8)	0,00
	07.2024	KRW 6.015.560	4.361	0	(8)	(8)	0,00
	07.2024	SGD 31.834	23.651	162	0	162	0,00
	07.2024	\$ 16.453	CHF 14.765	0	(22)	(22)	0,00
	07.2024	2.093	€ 1.945	1	(10)	(9)	0,00
	07.2024	10.195	IDR 165.342.838	0	(89)	(89)	0,00
	07.2024	799	ILS 2.954	0	(14)	(14)	0,00
	07.2024	1.310	PLN 5.123	0	(36)	(36)	0,00
	07.2024	2.153	TRY 73.239	58	0	58	0,00
	07.2024	11.157	ZAR 205.382	77	0	77	0,00
	08.2024	CHF 14.710	\$ 16.453	21	0	21	0,00
	08.2024	\$ 12.969	TRY 458.279	317	0	317	0,01
	09.2024	TWD 347.162	\$ 10.783	60	0	60	0,00
	09.2024	\$ 3.288	INR 275.494	9	0	9	0,00
	10.2024	CNH 61.208	\$ 8.553	98	0	98	0,00
	10.2024	\$ 1.164	CNH 8.314	0	(16)	(16)	0,00
	11.2024	2.380	TRY 93.909	120	0	120	0,00
	12.2024	CNH 12.293	\$ 1.713	9	0	9	0,00
	03.2025	\$ 86	TRY 4.186	12	0	12	0,00
MBC	07.2024	CAD 42.263	\$ 31.039	153	0	153	0,00
	07.2024	CZK 4.795	208	3	0	3	0,00
	07.2024	£ 1.471	1.864	4	0	4	0,00
	07.2024	¥ 345.235	2.208	61	0	61	0,00
	07.2024	NOK 6.691	628	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 67	50	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 50.266	CAD 68.822	30	0	30	0,00
	07.2024	876.373	€ 819.562	2.007	(13)	1.994	0,05
	07.2024	1.004	£ 789	0	(7)	(7)	0,00
	08.2024	CAD 68.776	\$ 50.266	0	(32)	(32)	0,00
	08.2024	€ 818.770	876.790	0	(2.007)	(2.007)	(0,05)
	08.2024	\$ 1.049	£ 829	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	628	NOK 6.686	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 9.626	\$ 299	2	0	2	0,00
	12.2024	CNH 19.147	2.683	28	0	28	0,00
	12.2024	\$ 2.683	CNH 19.140	0	(29)	(29)	0,00
MYI	07.2024	BRL 21.089	\$ 4.083	286	0	286	0,01
	07.2024	€ 6.991	7.496	3	0	3	0,00
	07.2024	£ 66	83	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 1.911	179	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 437	€ 409	1	0	1	0,00
	07.2024	171	£ 135	0	0	0	0,00
	07.2024	3.059	NZD 4.987	0	(20)	(20)	0,00
	07.2024	26	SGD 35	0	0	0	0,00
	08.2024	179	NOK 1.909	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 138.103	\$ 4.305	39	0	39	0,00
	09.2024	\$ 2.199	INR 183.890	1	0	1	0,00
RBC	07.2024	261.372	£ 206.113	0	(825)	(825)	(0,02)
	08.2024	£ 206.113	\$ 261.416	823	0	823	0,02
SCX	07.2024	IDR 328.240	20	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 4.558.335	3.342	32	0	32	0,00
	07.2024	PEN 20.286	5.411	115	0	115	0,00
	07.2024	SGD 33	24	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.292	€ 1.203	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	1.050	£ 829	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	12	MXN 223	0	0	0	0,00
	07.2024	3	SGD 4	0	0	0	0,00
	09.2024	CNH 42.255	\$ 5.890	68	0	68	0,00
	09.2024	TWD 211.393	6.558	28	0	28	0,00
	09.2024	\$ 19.104	INR 1.598.928	29	0	29	0,00
SSB	07.2024	€ 20.137	\$ 21.844	262	0	262	0,01
TOR	07.2024	CHF 52	57	0	0	0	0,00
	07.2024	NZD 2.276	1.394	7	0	7	0,00
	08.2024	\$ 1.394	NZD 2.276	0	(7)	(7)	0,00
UAG	07.2024	CHF 11.613	\$ 12.851	0	(72)	(72)	0,00
	07.2024	ILS 3.147	849	13	0	13	0,00
	12.2024	CNH 116.857	16.368	162	0	162	0,00
				\$ 20.609	\$ (6.040)	\$ 14.569	0,35

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzu- nahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	\$ 1.867	CAD 2.555	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	07.2024	CAD 3.670	\$ 2.682	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.663	CAD 2.265	0	(7)	(7)	0,00
	08.2024	2.682	3.668	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	CAD 7.646	\$ 5.585	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	\$ 2.210	CAD 3.010	0	(11)	(11)	0,00
	08.2024	5.585	7.641	3	0	3	0,00
MYI	07.2024	CAD 96	\$ 70	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	\$ 2.546	CAD 3.488	3	0	3	0,00
				\$ 6	\$ (21)	\$ (15)	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzu- nahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 6.373	CHF 5.732	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
BRC	07.2024	65	58	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	649	591	8	0	8	0,00
GLM	07.2024	CHF 2	\$ 2	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	6.881	7.668	10	0	10	0,00
	08.2024	\$ 7.654	CHF 6.843	0	(10)	(10)	0,00
MBC	07.2024	CHF 149	\$ 167	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 16	CHF 14	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	CHF 240	\$ 268	1	0	1	0,00
SCX	07.2024	\$ 198	CHF 178	0	0	0	0,00
TOR	07.2024	7.585	6.851	40	0	40	0,00
UAG	07.2024	CHF 6.815	\$ 7.595	12	0	12	0,00
	07.2024	\$ 7.480	CHF 6.759	42	0	42	0,00
	08.2024	7.595	6.789	0	(11)	(11)	0,00
				\$ 120	\$ (21)	\$ 99	0,00

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzu- nahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 938	\$ 1.014	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	07.2024	\$ 391.880	€ 360.947	0	(5.036)	(5.036)	(0,12)
BPS	07.2024	€ 327.481	\$ 350.294	17	(700)	(683)	(0,02)
	07.2024	\$ 334.223	€ 308.723	0	(3.350)	(3.350)	(0,08)
	08.2024	348.866	325.690	701	0	701	0,02
BRC	07.2024	€ 223	\$ 239	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	1.687	1.828	20	0	20	0,00
FAR	07.2024	\$ 381.716	€ 350.470	0	(6.100)	(6.100)	(0,15)
GLM	07.2024	€ 1.097	\$ 1.188	12	0	12	0,00
JPM	07.2024	1.346	1.440	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2024	353.340	377.905	50	(838)	(788)	(0,02)
	08.2024	\$ 365.793	€ 341.587	838	0	838	0,02
MYI	07.2024	€ 378	\$ 406	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	978	1.063	14	0	14	0,00
RYL	07.2024	\$ 45	€ 42	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	€ 342.212	\$ 366.649	3	(120)	(117)	0,00
	08.2024	\$ 366.228	€ 341.320	116	0	116	0,00
SSB	07.2024	10.304	9.499	0	(124)	(124)	0,00
UAG	08.2024	€ 402	\$ 430	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1.779	\$ (16.271)	\$ (14.492)	(0,35)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzu- nahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 8.407	\$ 10.631	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2024	\$ 22.697	£ 17.811	0	(183)	(183)	(0,01)
	08.2024	10.632	8.407	0	(3)	(3)	0,00
BRC	07.2024	£ 782	\$ 1.000	11	0	11	0,00
CBK	07.2024	195	248	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 547	£ 430	0	(3)	(3)	0,00
	08.2024	16	13	0	0	0	0,00
DUB	07.2024	11.859	9.294	0	(110)	(110)	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2024	£ 9.495	\$ 12.014	\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,00
	07.2024	\$ 127	£ 99	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	11.141	8.804	0	(9)	(9)	0,00
RBC	07.2024	£ 8.779	\$ 11.133	35	0	35	0,00
	08.2024	\$ 11.134	£ 8.779	0	(35)	(35)	0,00
RYL	07.2024	30	23	0	0	0	0,00
				\$ 61	\$ (344)	\$ (283)	(0,01)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	SGD 13.249	\$ 9.762	\$ 0	\$ (15)	\$ (15)	0,00
	07.2024	\$ 8.903	SGD 12.016	0	(37)	(37)	0,00
	08.2024	9.714	13.165	15	0	15	0,00
BPS	07.2024	SGD 13.256	\$ 9.774	0	(7)	(7)	0,00
	08.2024	\$ 9.774	SGD 13.237	8	0	8	0,00
BRC	07.2024	SGD 22	\$ 16	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	\$ 284	SGD 383	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2024	SGD 95	\$ 71	0	0	0	0,00
JPM	07.2024	33	25	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 9.802	SGD 13.194	0	(67)	(67)	0,00
MBC	07.2024	SGD 121	\$ 90	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	\$ 5	SGD 7	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	9.760	13.152	0	(56)	(56)	0,00
UAG	07.2024	SGD 18	\$ 13	0	0	0	0,00
				\$ 23	\$ (183)	\$ (160)	0,00
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ 854</b>	<b>0,02</b>

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2054	\$ 1.500	\$ (1.175)	(0,03)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (1.175)</b>	<b>(0,03)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 5.737.245</b>	<b>139,03</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (1.610.542)</b>	<b>(39,03)</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 4.126.703</b>	<b>100,00</b>

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- Mit dem Fonds verbunden.
- Bedingt wandelbares Wertpapier.
- Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 18.076 USD (31. Dezember 2023: 3.484 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.
- Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 7.576 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurde zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 35 USD (31. Dezember 2023: 35 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 73.768 USD (31. Dezember 2023: 53.307 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 8.150 USD (31. Dezember 2023: 9.980 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.603.136	\$ 3.265	\$ 5.606.401
Investmentfonds	126.791	0	0	126.791
Pensionsgeschäfte	0	417	0	417
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(3.067)	7.878	0	4.811
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(1.175)	0	(1.175)
<b>Summen</b>	<b>\$ 123.724</b>	<b>\$ 5.610.256</b>	<b>\$ 3.265</b>	<b>\$ 5.737.245</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.907.673	\$ 1.316	\$ 5.908.989
Investmentfonds	151.381	0	0	151.381
Pensionsgeschäfte	0	732	0	732
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(9.595)	(11.113)	0	(20.708)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(34.262)	0	(34.262)
<b>Summen</b>	<b>\$ 141.786</b>	<b>\$ 5.863.030</b>	<b>\$ 1.316</b>	<b>\$ 6.006.132</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettvermögens
BOS	5,570 %	26.06.2024	03.07.2024	\$ (9.938)	\$ (9.945)	(0,24)
BRC	5,300	26.02.2024	TBD <sup>(1)</sup>	(5.057)	(5.151)	(0,12)
JPS	5,250	14.06.2024	02.08.2024	(2.724)	(2.731)	(0,07)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (17.827)</b>	<b>(0,43)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettvermögens
BPG	5,450 %	13.06.2024	25.07.2024	\$ (7.738)	\$ (7.759)	(0,19)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (7.759)</b>	<b>(0,19)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 28 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (66)	\$ 0	\$ (66)	\$ 619	\$ (660)	\$ (41)
BOA	6.207	(6.710)	(503)	(190)	260	70
BPS	224	210	434	(1.685)	4.030	2.345
BRC	99	0	99	1.815	(3.920)	(2.105)
CBK	(586)	590	4	152	0	152
DUB	394	(420)	(26)	(152)	0	(152)
FAR	(6.152)	6.480	328	155	0	155
GLM	(951)	870	(81)	(2.320)	2.510	190
GST	(27)	0	(27)	(20)	260	240
JPM	543	(330)	213	(872)	930	58
MBC	436	(280)	156	3.501	(5.220)	(1.719)
MSC	(7)	0	(7)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(97)	0	(97)	1.848	(2.000)	(152)
MYI	311	(230)	81	270	(320)	(50)
RBC	15	0	15	58	0	58
RYL	(31)	0	(31)	k. A.	k. A.	k. A.

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
SAL	\$ (1)	\$ 0	\$ (1)	\$ (454)	\$ 550	\$ 96
SCX	240	(170)	70	469	(320)	149
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
SSB	138	(260)	(122)	65	0	65
TOR	40	(130)	(90)	112	0	112
UAG	145	0	145	(1.625)	1.440	(185)
ULO	(20)	0	(20)	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	60,98	57,73
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	74,58	75,96
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,30	k. A.
Investmentfonds	3,07	3,42
Pensionsgeschäfte	0,01	0,02
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,03	(0,36)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,07	(0,15)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,02	0,04
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,03)	(0,78)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,43)	(0,07)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,19)	k. A.

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,10	k. A.
Unternehmensanleihen und Wechsel	48,00	40,66
Kommunalanleihen und Wechsel	0,48	0,40
US-Regierungsbehörden	50,84	53,46
US-Schatzobligationen	17,07	18,14
Non-Agency-MBS	7,58	8,52
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,66	7,73
Staatsemissionen	5,10	4,28
Kurzfristige Instrumente	0,03	0,50
Investmentfonds	3,07	3,42
Pensionsgeschäfte	0,01	0,02
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,03	(0,36)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,07	0,08
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,20)	(0,20)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	0,20	(0,03)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	k. A.
Devisenoptionen	0,04	0,00
Zinsswapoptionen	0,03	0,06
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	k. A.
Devisenoptionen	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,04)	(0,02)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,35	(0,20)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,36)	0,21
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,03)	(0,78)
Sonstige Aktiva und Passiva	(39,03)	(35,88)
Nettovermögen	100,00	100,00



BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>				
Elevation CLO Ltd.	\$	20	0,01	<b>COMMERCIAL PAPER</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
6,820 % fällig am 15.10.2029				Alimentation Couche-Tard, Inc.	\$	1.900	1,896	0,85	PIMCO Select Funds plc -			
Euro-Galaxy CLO DAC	€	249	0,12	5,510 % fällig am 12.07.2024				PIMCO US Dollar				
4,511 % fällig am 24.04.2034				Keurig Dr Pepper, Inc.	1.900	1.894	0,84	Short-Term Floating	42.382	\$	422	0,19
Greenwood Park CLO Ltd.	\$	1.068	0,48	5,510 % fällig am 19.07.2024				NAV Fund (b)				
6,600 % fällig am 15.04.2031				L3Harris Technologies, Inc.	1.500	1.495	0,67	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>				
Madison Park Funding Ltd.		147	0,07	5,520 % fällig am 22.07.2024	250	249	0,11	PIMCO ETFs plc - PIMCO				
6,340 % fällig am 15.04.2029				5,600 % fällig am 17.07.2024				US Dollar Short				
Nassau Ltd.		688	0,31	Marriott International, Inc.	1.300	1.292	0,58	Maturity UCITS	220.110		22.023	9,84
6,840 % fällig am 15.01.2030				5,530 % fällig am 06.08.2024	600	596	0,27	ETF (b)				
Oak Hill European Credit Partners DAC	€	260	0,12	5,530 % fällig am 07.08.2024				<b>Summe Investmentfonds</b>		<b>\$</b>	<b>22.445</b>	<b>10,03</b>
4,637 % fällig am 20.10.2031				NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	900	899	0,40					
SLM Private Credit Student Loan Trust	\$	304	0,13	5,570 % fällig am 08.07.2024								
5,891 % fällig am 15.06.2039				Penske Truck Leasing Co. LP	1.800	1.785	0,80					
		3.901	1,74	5,540 % fällig am 20.08.2024								
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe kurzfristige Instrumente		<b>10.106</b>	<b>4,52</b>					
PSP Capital, Inc.				<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>		<b>\$191.386</b>	<b>85,51</b>					
5,611 % fällig am 03.03.2025	1.900	1.900	0,85									

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
DEU	5,230 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 3.100	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 31.08.2028	\$ (3.164)	\$ 3.100	\$ 3.101	1,39
	5,350	28.06.2024	01.07.2024	14.900	U.S. Treasury Bonds 5,375 % fällig am 15.02.2031	(15.196)	14.900	14.907	6,65
SSB	2,600	28.06.2024	01.07.2024	533	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028	(544)	533	533	0,24
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (18.904)</b>	<b>\$ 18.533</b>	<b>\$ 18.541</b>	<b>8,28</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month EURIBOR June Futures	Short	06.2025	38	\$ 10	0,00
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	65	(6)	0,00
3-Month SONIA Index June Futures	Short	09.2025	23	(8)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Long	09.2024	134	(60)	(0,03)
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	57	(55)	(0,02)
CAC 40 Index July Futures	Long	07.2024	13	(20)	(0,01)
DAX Index September Futures	Long	09.2024	2	7	0,00
E-mini NASDAQ 100 Index September Futures	Long	09.2024	12	(6)	0,00
E-Mini Russell 2000 Index September Futures	Long	09.2024	14	6	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2024	5	1	0,00
Euro STOXX Bank September Futures	Long	09.2024	327	22	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2024	215	(5)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2024	9	13	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	14	10	0,00
FTSE 100 Index September Futures	Long	09.2024	27	(1)	0,00
FTSE China A50 Index July Futures	Long	07.2024	263	(18)	(0,01)
FTSE Taiwan Index July Futures	Long	07.2024	84	36	0,02
FTSE/MIB Index September Futures	Long	09.2024	17	13	0,01
Hang Seng China Enterprises Index July Futures	Long	07.2024	39	(27)	(0,01)
IBEX 35 July Futures	Long	07.2024	28	(17)	(0,01)
MSCI Singapore Index July Futures	Long	07.2024	354	65	0,03
Nikkei 225 Index September Futures	Long	09.2024	8	15	0,01
OMXS30 Index July Futures	Long	07.2024	251	(4)	0,00
S&P CNX Nifty Index July Futures	Long	07.2024	46	42	0,02
S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures	Long	09.2024	8	15	0,01
SPI 200 Index September Futures	Long	09.2024	35	28	0,01
Topix Index September Futures	Long	09.2024	23	43	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	32	10	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	62	(25)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	12	(4)	0,00
Volatility S&P 500 Index July Futures	Short	07.2024	214	47	0,02
VSTOXX Mini July Futures	Short	07.2024	226	(33)	(0,02)
WIG20 Index September Futures	Long	09.2024	167	110	0,05
				\$ 204	0,09
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ 204</b>	<b>0,09</b>

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-41 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2029	\$ 4.500	\$ (3)	(0,01)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-40 5-Year Index	1,000 %	20.12.2028	\$ 11.800	\$ 48	0,02
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000	20.06.2029	6.100	(33)	(0,01)
				\$ 15	0,01

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	18.09.2034	£ 24.500	\$ 39	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	4.400	(4)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	18.09.2026	32.600	(69)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	18.09.2029	INR 1.364.800	(50)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	18.09.2029	439.770	(41)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	18.09.2034	¥ 2.508.400	(128)	(0,06)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,500	18.09.2054	1.174.900	64	0,03
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	18.09.2029	SGD 20.400	(28)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	18.09.2029	100	(1)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,250	18.09.2029	THB 470.200	(144)	(0,06)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day THB-THORON Compounded-OIS	2,500	18.09.2029	731.800	(148)	(0,07)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.09.2029	\$ 1.900	(1)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	18.09.2054	2.000	(39)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.09.2026	139.000	105	0,05
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	25.600	48	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,342	02.01.2025	BRL 14.100	(188)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,585	02.01.2025	10.300	(211)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,776	02.01.2025	3.300	(72)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,846	02.01.2025	11.400	(249)	(0,11)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,882	02.01.2025	3.000	(63)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,626	02.01.2025	5.500	112	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,636	02.01.2025	4.900	100	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,847	02.01.2025	16.800	395	0,18
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,018	02.01.2025	7.900	179	0,08
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,336	02.01.2025	20.000	415	0,19
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,724	02.01.2025	7.800	(157)	(0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,741	02.01.2025	8.200	155	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,190	02.01.2025	14.600	259	0,12
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,557	02.01.2025	700	(12)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,741	02.01.2025	21.700	327	0,15
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,996	02.01.2025	10.900	150	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,537	02.01.2025	13.300	148	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,642	02.01.2025	4.500	46	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,870	02.01.2029	37.600	213	0,10
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,955	02.01.2029	19.600	220	0,10
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,038	02.01.2029	21.600	(239)	(0,11)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,075	02.01.2029	11.700	(122)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,095	02.01.2029	35.500	365	0,16
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,205	02.01.2029	17.100	(167)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,210	02.01.2029	18.802	(182)	(0,08)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,234	02.01.2029	48.000	460	0,21
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,276	02.01.2029	11.000	118	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,317	02.01.2029	9.500	81	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,321	04.01.2027	6.000	14	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,333	02.01.2029	17.500	157	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,471	04.01.2027	20.100	(218)	(0,10)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,512	02.01.2029	28.400	268	0,12
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,567	02.01.2029	23.700	(195)	(0,09)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,583	02.01.2029	32.900	281	0,13
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,689	02.01.2029	115.600	814	0,36
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,804	02.01.2029	30.000	217	0,10
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,827	02.01.2025	10.500	(55)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,829	02.01.2029	12.900	90	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,933	02.01.2029	46.400	(280)	(0,13)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Year BRL-CDI	10,963	02.01.2029	48.500	274	0,12
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,060	02.01.2029	18.700	104	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,071	04.01.2027	10.400	73	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,099	04.01.2027	8.900	(63)	(0,03)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,113 %	02.01.2029	BRL	15.500	\$ (119)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,140	02.01.2029		26.900	(159)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,210	04.01.2027		17.900	(114)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,272	04.01.2027		24.300	(114)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,344	02.01.2029		22.800	(109)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,383	04.01.2027		63.000	(280)	(0,13)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,394	02.01.2029		24.000	(108)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,459	04.01.2027		7.500	(32)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,460	02.01.2029		21.200	68	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,485	04.01.2027		37.800	135	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,540	04.01.2027		25.100	76	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,630	04.01.2027		28.200	78	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,660	04.01.2027		36.700	49	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,695	02.01.2029		500	1	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,696	04.01.2027		9.100	31	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,872	02.01.2029		63.300	(117)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,920	02.01.2025		66.400	43	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,952	04.01.2027		28.000	(43)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,975	02.01.2029		17.600	(22)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,976	04.01.2027		21.800	35	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Year BRL-CDI		12,025	02.01.2029		12.400	(9)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,094	02.01.2029		89.700	(54)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,115	04.01.2027		12.200	(8)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,173	04.01.2027		6.000	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,226	02.01.2029		19.900	3	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,228	04.01.2027		25.200	(20)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,299	04.01.2027		27.200	30	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,490	04.01.2027		7.900	(10)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,492	02.01.2029		16.600	20	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,597	02.01.2029		36.400	81	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,677	02.01.2029		34.000	90	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,754	04.01.2027		35.400	(98)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,779	04.01.2027		45.700	(148)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,806	04.01.2027		11.000	34	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,073	04.01.2027		35.600	(174)	(0,08)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,120	04.01.2027		47.200	(233)	(0,10)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,207	04.01.2027		27.200	(94)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,231	04.01.2027		34.700	(190)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		13,318	04.01.2027		9.600	56	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,000	18.09.2029	CAD	8.300	(34)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,000	18.09.2054		9.600	129	0,06
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,250	18.09.2034		39.100	(289)	(0,13)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,500	18.09.2026		37.200	13	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,250	18.09.2029	CNY	216.100	216	0,10
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,325	23.01.2029	COP	13.648.800	(146)	(0,07)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,520	01.03.2029		9.821.800	65	0,03
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,550	18.03.2029		11.198.100	30	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,730	28.06.2028		15.146.400	(67)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,830	13.12.2028		16.270.800	(56)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,885	08.04.2029		13.350.600	61	0,03
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,914	24.05.2029		18.670.700	(60)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,927	09.04.2029		6.812.500	28	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,950	05.04.2029		9.083.300	36	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,960	01.09.2028		13.217.800	(38)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,035	28.05.2029		9.474.600	(19)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,040	09.08.2028		30.999.700	44	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,070	14.11.2028		27.811.700	(54)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,080	11.04.2029		11.150.700	28	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,106	15.06.2028		22.329.600	(23)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,120	10.04.2029		5.298.600	12	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,128	10.11.2028		10.475.000	(16)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,130	22.08.2028		6.457.600	30	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,150	11.04.2029		8.941.400	17	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,188	15.11.2028		23.532.500	(21)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,338	09.11.2028		15.447.500	6	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,435	12.04.2029		25.396.600	(8)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,449	16.04.2029		14.674.600	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,567	15.04.2029		12.991.700	(30)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,588	11.04.2028		27.727.300	41	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,700	10.04.2028		5.318.200	13	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,750	27.03.2028		21.497.700	87	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,771	18.04.2029		15.441.900	(68)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,830	28.04.2028		19.856.000	(112)	(0,05)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,970	08.02.2028		9.288.600	44	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,990	08.02.2028		22.636.600	111	0,05
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,992	08.02.2028		23.240.200	115	0,05
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,020	24.03.2028		33.052.700	200	0,09
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,040	08.02.2028		4.678.200	25	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,140	07.02.2028		41.500.400	252	0,11
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,190	13.10.2028		14.222.000	(107)	(0,05)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,260	10.10.2028		5.040.000	(41)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,370	02.10.2028		45.690.000	(407)	(0,18)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,650 %	11.10.2028	COP	20.400.000	\$ (237)	(0,11)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,050	09.09.2027		8.150.200	(99)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,210	18.11.2027		3.214.900	44	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,240	24.02.2028		72.000.000	(1.071)	(0,48)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,390	30.09.2027		10.319.800	(149)	(0,07)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,420	21.11.2027		6.380.400	96	0,04
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,430	21.11.2027		6.563.400	100	0,04
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,443	21.11.2027		19.784.200	302	0,13
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,478	29.09.2027		10.549.600	(158)	(0,07)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,800	31.10.2027		32.387.900	(805)	(0,36)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,810	14.10.2027		5.776.200	(100)	(0,04)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,920	18.10.2027		2.950.700	(54)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,800	24.10.2027		33.238.700	(750)	(0,34)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month HKD-HIBOR	3,500	18.09.2029	HKD	73.900	(133)	(0,06)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month HKD-HIBOR	3,750	18.09.2029		139.200	71	0,03
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,692	13.09.2026	ILS	48.400	923	0,41
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,750	10.12.2026		34.100	(730)	(0,33)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,900	07.10.2026		9.000	(181)	(0,08)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,905	25.11.2026		8.100	(178)	(0,08)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,965	14.01.2027		10.600	238	0,11
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,040	28.10.2026		10.400	(209)	(0,09)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,105	21.01.2027		16.900	361	0,16
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,178	04.02.2027		13.800	286	0,13
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,183	06.05.2027		7.500	113	0,05
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,390	27.05.2027		11.400	161	0,07
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,666	18.07.2027		7.500	27	0,01
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,670	15.07.2027		34.800	(44)	(0,02)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,825	10.06.2027		10.900	(120)	(0,05)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,260	18.11.2027		38.400	(204)	(0,09)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,290	16.11.2027		25.363	(115)	(0,05)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,440	24.11.2028		65.000	(396)	(0,18)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,460	23.11.2028		25.000	(127)	(0,06)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,515	22.11.2028		23.200	(103)	(0,05)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,530	03.04.2028		69.500	(545)	(0,24)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,590	31.03.2028		24.500	(178)	(0,08)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,590	18.05.2028		14.100	111	0,05
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,619	05.01.2028		27.400	114	0,05
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,650	02.01.2028		18.900	73	0,03
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,670	30.12.2027		19.000	69	0,03
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,680	24.01.2029		24.300	130	0,06
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,704	29.01.2029		36.400	182	0,08
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,720	21.10.2027		72.900	61	0,03
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,740	25.01.2029		14.400	67	0,03
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,770	18.10.2028		13.000	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,800	18.08.2028		20.200	(107)	(0,05)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,825	18.03.2029		19.300	68	0,03
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,855	19.03.2029		19.100	61	0,03
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,915	19.10.2028		34.100	14	0,01
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,920	20.03.2029		18.000	43	0,02
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,930	21.03.2029		9.000	21	0,01
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,980	23.02.2028		8.600	6	0,00
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	4,030	24.02.2028		54.700	(124)	(0,06)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	4,130	03.03.2028		30.000	(102)	(0,05)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	4,360	02.05.2029		38.400	(6)	0,00
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	4,370	02.05.2029		24.600	(1)	0,00
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	4,430	25.04.2029		20.600	13	0,01
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	4,460	02.10.2028		39.300	(279)	(0,12)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	4,515	22.04.2029		20.600	34	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	18.09.2029	KRW	15.379.600	49	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month KRW-KORIBOR	3,500	18.09.2029		13.684.000	1	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month TWD-TAIBOR	1,500	18.09.2029	TWD	502.900	214	0,10
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,900	12.11.2025	ZAR	3.400	(9)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	4,938	18.09.2025		7.000	19	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,120	02.09.2025		500	2	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,601	09.06.2026		31.050	(69)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026		41.150	(99)	(0,04)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,739	28.07.2026		72.100	(177)	(0,08)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,780	03.03.2026		36.600	70	0,03
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,860	23.06.2026		75.600	151	0,07
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	17.03.2026		1.200	2	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,980	22.09.2026		43.900	93	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,023	01.07.2026		28.100	57	0,03
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,231	29.09.2026		55.400	117	0,05
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,300	23.12.2026		30.900	(59)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,400	30.12.2026		33.600	(69)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,540	04.01.2027		37.100	(67)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,540	23.02.2027		64.600	(117)	(0,05)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,670	12.01.2027		73.700	122	0,05
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,690	04.11.2026		2.000	4	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,855	03.11.2026		22.830	(29)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,049	09.03.2027		70.000	75	0,03
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,489	18.05.2027		112.100	(9)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,705 %	10.01.2028	ZAR	504.000	\$ (276)	(0,12)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,710	06.05.2027		22.200	24	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,730	09.01.2028		119.300	(51)	(0,02)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,740	17.08.2027		63.300	(102)	(0,05)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,900	06.01.2028		119.300	(15)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,055	14.11.2027		8.400	8	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,064	27.07.2027		21.200	(23)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,120	13.03.2028		99.500	(99)	(0,04)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,130	25.01.2029		308.000	(78)	(0,03)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,205	17.02.2028		241.300	(102)	(0,05)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,205	31.08.2028		89.600	(138)	(0,06)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,220	30.08.2028		109.400	39	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,220	31.08.2028		30.900	(51)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,250	22.11.2028		127.300	(58)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,276	14.06.2029		119.000	24	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,291	27.07.2028		47.900	24	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,305	27.07.2028		84.400	45	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,310	27.07.2028		47.900	26	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,330	27.07.2028		54.000	32	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,352	09.11.2028		248.400	77	0,03
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,355	03.11.2028		160.100	102	0,05
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,360	06.11.2028		104.400	61	0,03
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,370	20.07.2028		197.600	138	0,06
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,411	19.07.2028		160.300	122	0,05
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,430	23.02.2028		152.700	(126)	(0,06)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,459	22.05.2029		172.100	111	0,05
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,465	23.02.2028		240.400	(213)	(0,10)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	17.10.2027		12.000	(14)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,510	25.04.2028		262.000	(253)	(0,11)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,510	17.05.2029		251.400	184	0,08
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,530	16.05.2029		119.300	97	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,550	23.08.2028		137.100	(139)	(0,06)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,560	25.04.2028		72.800	91	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,625	23.08.2028		106.800	(124)	(0,06)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,645	02.04.2029		104.100	(117)	(0,05)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,649	03.04.2029		74.900	(85)	(0,04)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,650	02.04.2029		52.500	(60)	(0,03)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,670	02.04.2029		104.500	(123)	(0,06)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,700	22.08.2028		115.200	(151)	(0,07)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	8,820	12.04.2029		63.900	15	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	8,880	11.04.2029		93.300	(154)	(0,07)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,950	11.05.2028		67.000	(164)	(0,07)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	9,090	28.09.2028		64.300	(104)	(0,05)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,185	12.06.2028		150.700	189	0,08
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	9,350	18.05.2028		56.800	(114)	(0,05)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,750	18.09.2026	AUD	99.800	184	0,08
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	18.09.2034		21.500	99	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,439	02.02.2029	CLP	5.503.000	(255)	(0,11)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,517	01.02.2029		3.221.000	(137)	(0,06)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,649	20.12.2028		7.526.500	(226)	(0,10)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,810	16.02.2029		3.159.500	88	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,815	15.02.2029		4.378.100	121	0,05
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	4,869	09.05.2029		6.765.000	(138)	(0,06)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,870	14.06.2029		2.977.700	(8)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,899	11.12.2028		8.430.700	(137)	(0,06)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,965	01.03.2029		15.466.000	300	0,13
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,970	25.03.2029		10.690.000	188	0,08
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,000	04.03.2029		970.800	(21)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,009	12.12.2028		8.694.300	(100)	(0,04)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,133	23.06.2028		3.579.500	(20)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,158	15.06.2028		7.959.600	(38)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,160	13.07.2028		6.791.900	(78)	(0,04)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,200	04.04.2029		6.485.700	40	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,230	14.06.2028		1.732.400	(4)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,237	14.06.2028		2.356.600	(4)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,290	13.06.2028		1.707.900	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,293	21.03.2028		4.537.600	(15)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	22.03.2028		6.618.300	(18)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,350	28.06.2029		6.435.000	(26)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,380	24.03.2028		6.593.800	1	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,455	16.08.2028		7.508.700	(14)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,458	20.03.2028		7.549.300	24	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,475	13.11.2028		5.062.200	38	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,490	18.08.2028		2.882.200	(11)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,530	22.08.2028		2.959.500	(17)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,540	17.08.2028		5.014.700	(30)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,540	14.11.2028		5.093.400	(18)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,550	17.08.2028		5.014.700	(33)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,590	21.08.2028		5.749.900	(48)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,631	23.08.2028		6.046.400	(61)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,650	01.06.2028		2.946.200	(40)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,699	01.06.2028		4.644.000	(72)	(0,03)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,750 %	28.09.2028	CLP	3.942.400	\$ 58	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,798	31.05.2028		5.567.800	(108)	(0,05)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,830	25.04.2028		5.063.700	58	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,000	16.02.2028		5.590.200	(124)	(0,06)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,370	03.03.2028		4.119.100	(155)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,380	03.03.2028		4.366.200	(166)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,385	07.03.2028		6.138.400	(236)	(0,11)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,490	06.03.2028		8.848.600	(376)	(0,17)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,637	24.07.2025	CZK	7.700	(15)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,690	04.05.2025		4.100	(5)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,934	02.07.2026		95.200	220	0,10
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,972	07.07.2026		55.500	133	0,06
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	2,015	10.08.2026		132.200	227	0,10
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,340	06.01.2032		171.700	(366)	(0,16)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,965	16.04.2029		127.900	(3)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,020	22.11.2033		15.400	(12)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,060	17.04.2034		98.400	(39)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,190	09.11.2028		140.900	9	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,195	21.03.2033		125.300	90	0,04
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,220	21.03.2033		67.600	55	0,02
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,250	18.04.2029		38.900	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,280	08.11.2033		124.900	212	0,09
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,290	18.04.2034		14.700	0	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,300	18.03.2027		80.900	(10)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,420	22.03.2028		172.600	97	0,04
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,420	05.05.2032		9.700	(2)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,420	01.06.2033		82.200	(116)	(0,05)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,440	12.12.2027		253.100	408	0,18
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,455	01.06.2033		29.100	(51)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,510	22.03.2028		151.800	107	0,05
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,560	09.12.2027		156.700	282	0,13
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,615	11.07.2028		197.900	(357)	(0,16)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,630	21.03.2028		151.800	136	0,06
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,638	03.10.2033		100.400	(275)	(0,12)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,640	07.12.2027		156.700	302	0,14
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,680	08.12.2027		156.700	315	0,14
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,695	04.05.2028		116.300	130	0,06
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,730	03.10.2028		67.700	(159)	(0,07)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,735	04.05.2028		95.500	113	0,05
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,070	20.04.2028		101.000	(171)	(0,08)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,090	20.04.2028		121.900	(211)	(0,09)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,103	16.11.2027		240.300	635	0,28
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,140	11.07.2027		58.000	134	0,06
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,175	11.07.2027		82.400	152	0,07
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,175	23.02.2028		48.100	(82)	(0,04)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,185	24.05.2027		64.000	(89)	(0,04)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,215	24.02.2028		249.500	(457)	(0,20)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,264	02.03.2028		224.100	(472)	(0,21)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,285	20.05.2027		83.300	(126)	(0,06)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,538	02.09.2027		52.400	(165)	(0,07)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,640	10.06.2027		3.400	(7)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,740	03.10.2027		121.600	(439)	(0,20)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,788	20.10.2027		538.000	(2.177)	(0,97)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€	5.900	(106)	(0,05)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034		11.800	113	0,05
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026		3.500	20	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,958	19.03.2026	HUF	1.746.000	412	0,18
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,980	09.03.2026		646.300	157	0,07
Erhalt	6-Month HUF-BBR	2,499	05.07.2026		78.800	20	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	2,558	06.08.2026		1.156.900	260	0,12
Zahlung	6-Month HUF-BBR	5,060	18.02.2027		885.100	(106)	(0,05)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	5,500	04.03.2027		627.800	49	0,02
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,065	13.12.2028		265.100	(22)	(0,01)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,100	11.03.2027		498.000	16	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6,250	21.05.2029		1.059.800	(10)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6,270	22.05.2029		1.848.600	(12)	(0,01)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,530	05.04.2029		950.200	(15)	(0,01)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,550	04.04.2029		1.165.600	(20)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month HUF-BBR	6,560	08.04.2029		1.585.600	(31)	(0,01)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,587	05.04.2029		1.632.400	(36)	(0,02)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,800	16.04.2029		1.019.800	(49)	(0,02)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,830	17.04.2029		1.006.600	(52)	(0,02)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	7,000	22.04.2029		2.594.100	(184)	(0,08)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	7,100	19.04.2029		969.200	(80)	(0,04)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	7,480	03.06.2027		700.700	144	0,06
Erhalt	6-Month HUF-BBR	7,640	13.05.2027		721.400	(67)	(0,03)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	7,740	26.10.2028		3.525.000	(879)	(0,39)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	7,770	27.10.2028		2.046.400	252	0,11
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,320	20.01.2028		729.300	114	0,05
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,500	25.01.2028		5.485.200	1.094	0,49
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,650	19.01.2028		731.300	137	0,06
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,712	28.04.2028		2.440.200	26	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,740 %	28.04.2028	HUF 4.994.100	\$ 782	0,35
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,800	27.04.2028	1.126.200	260	0,12
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,490	11.04.2028	2.501.700	(734)	(0,33)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,500	11.04.2028	1.025.500	(302)	(0,13)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,510	11.04.2028	1.038.900	(346)	(0,15)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,625	15.08.2027	695.900	352	0,16
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,750	22.11.2027	283.976	118	0,05
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,800	16.11.2027	2.235.924	942	0,42
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,900	16.12.2027	162.500	(71)	(0,03)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,000	18.11.2027	319.400	141	0,06
Erhalt	6-Month HUF-BBR	10,050	15.12.2027	164.000	(74)	(0,03)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,070	18.07.2027	428.900	181	0,08
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,100	15.07.2027	488.900	206	0,09
Erhalt	6-Month HUF-BBR	10,340	15.12.2027	334.200	(160)	(0,07)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	11,140	23.12.2027	2.021.500	(1.059)	(0,47)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	11,350	11.11.2027	289.300	139	0,06
Erhalt	6-Month HUF-BBR	11,524	12.09.2027	2.052.600	(1.149)	(0,51)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	12,500	19.10.2027	4.079.400	(2.846)	(1,26)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,188	19.03.2026	PLN 17.800	332	0,15
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,405	10.08.2026	27.100	532	0,24
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,450	05.07.2026	5.300	(117)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,465	07.06.2026	2.400	44	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	2,185	08.10.2026	8.300	(129)	(0,06)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,983	08.11.2026	20.100	183	0,08
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,525	24.12.2026	3.300	(18)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,600	27.12.2026	3.300	(16)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,739	03.01.2027	1.000	(11)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,934	04.03.2027	19.200	(36)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,219	04.02.2027	10.200	84	0,04
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,255	27.12.2028	16.500	(86)	(0,04)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month PLN-WIBOR	4,440	09.01.2029	15.600	81	0,04
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,735	09.10.2028	10.200	(14)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,825	13.03.2029	48.800	125	0,06
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,830	18.03.2027	2.000	6	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,840	22.08.2028	15.300	(34)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,850	15.02.2029	25.600	64	0,03
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,865	16.02.2029	25.600	60	0,03
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,890	16.02.2029	18.000	37	0,02
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,899	19.03.2029	46.700	47	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,930	29.06.2028	15.900	(15)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,975	29.03.2029	26.300	21	0,01
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,060	15.05.2029	33.100	14	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month PLN-WIBOR	5,165	12.04.2029	24.200	49	0,02
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,179	01.04.2027	7.900	3	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,265	22.04.2029	26.900	(4)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,300	12.01.2028	23.800	28	0,01
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,430	16.03.2028	6.700	10	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,460	16.08.2027	1.300	(25)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,490	12.12.2027	19.700	195	0,09
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,525	12.12.2027	6.500	66	0,03
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,540	01.06.2028	26.600	(31)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,670	09.12.2027	19.500	224	0,10
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,750	08.12.2027	16.300	201	0,09
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,800	07.12.2027	32.600	413	0,18
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,830	08.12.2027	32.600	425	0,19
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,160	23.02.2028	42.600	(389)	(0,17)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,310	18.11.2027	14.800	254	0,11
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,348	09.09.2027	14.800	(253)	(0,11)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,365	17.11.2027	15.600	275	0,12
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,455	16.11.2027	23.630	436	0,19
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,650	29.09.2027	33.200	(819)	(0,37)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	7,223	29.06.2027	23.200	222	0,10
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,726	24.10.2027	87.700	(2.483)	(1,11)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	7,761	21.10.2027	7.052	206	0,09
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,775	26.06.2025	MXN 4.900	17	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,800	05.02.2026	65.500	252	0,11
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,080	09.10.2025	14.500	(68)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,095	30.10.2025	23.500	(114)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,120	06.05.2025	15.800	(62)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,443	17.04.2025	5.700	(24)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,550	12.03.2026	32.800	145	0,06
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,050	04.06.2026	22.600	(98)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,095	20.03.2026	51.800	206	0,09
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,210	28.03.2025	4.300	(22)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,230	07.04.2025	16.700	(91)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,255	21.05.2026	23.500	93	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,460	18.06.2026	43.000	158	0,07
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,625	11.09.2026	21.100	84	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,635	11.09.2026	21.100	83	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,740	17.09.2026	28.500	109	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,109	03.12.2026	102.300	(371)	(0,17)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,113	24.09.2026	134.600	477	0,21

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Varibler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,264 %	17.12.2026	MXN	30.000	\$ 106	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,273	12.11.2026		33.880	(113)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,353	05.11.2026		58.150	190	0,09
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,370	14.10.2026		24.200	(77)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,383	28.01.2027		29.500	100	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,460	04.02.2027		44.800	(147)	(0,07)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,530	14.01.2027		24.100	79	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,590	29.10.2026		40.000	121	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,673	31.12.2026		23.900	71	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,745	11.02.2027		53.100	(161)	(0,07)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,055	13.06.2033		25.800	(131)	(0,06)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,207	19.06.2028		52.900	88	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,250	02.12.2032		85.900	(361)	(0,16)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,280	29.07.2027		40.300	(112)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,281	28.03.2033		68.000	(262)	(0,12)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,340	21.04.2033		35.500	105	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,374	14.03.2033		135.600	(471)	(0,21)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,400	21.05.2027		47.400	(103)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,402	20.05.2027		34.800	(75)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,438	20.03.2028		307.500	(699)	(0,31)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,453	30.11.2027		332.600	(727)	(0,32)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,470	16.12.2033		18.500	(61)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,480	30.11.2027		105.200	(225)	(0,10)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,498	11.03.2027		25.400	(52)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,500	25.07.2033		91.300	288	0,13
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,540	21.12.2033		73.800	(226)	(0,10)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,563	16.05.2033		31.700	90	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,616	05.11.2027		165.400	(316)	(0,14)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,620	09.11.2027		82.900	(129)	(0,06)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,645	27.07.2033		115.700	258	0,11
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,728	22.05.2028		135.300	236	0,11
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,740	30.08.2027		30.800	46	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,755	03.02.2033		45.900	102	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,765	02.08.2028		113.400	152	0,07
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,782	09.03.2034		53.000	120	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,785	06.05.2027		24.900	42	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,800	02.02.2033		73.500	153	0,07
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,810	01.07.2027		60.100	(99)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,844	07.02.2033		104.900	202	0,09
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,921	25.08.2027		61.100	101	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,940	07.02.2028		136.200	197	0,09
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,955	23.03.2034		48.000	77	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,990	10.08.2033		34.000	49	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,020	03.06.2027		91.300	114	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,060	14.09.2027		61.100	67	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,070	24.06.2027		13.500	16	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,114	24.06.2027		11.700	13	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,135	27.10.2033		63.600	(62)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,215	09.02.2028		146.800	142	0,06
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,238	02.11.2028		59.900	(47)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,290	23.09.2027		22.500	(20)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,295	21.10.2027		116.100	101	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,300	24.09.2027		34.400	(31)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,345	16.02.2028		99.400	72	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,382	12.10.2027		153.800	104	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,390	07.10.2027		40.300	28	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,536	22.09.2027		67.800	36	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,765	16.09.2033		43.100	51	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,885	08.06.2029		30.300	20	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,890	22.09.2028		61.300	27	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,981	01.06.2034		20.200	41	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	10,023	07.06.2029		31.200	30	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	10,180	01.06.2034		7.500	21	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,500	29.03.2033	\$	6.900	(82)	(0,04)
Erhalt	CPURNSA	2,525	07.06.2033		1.700	5	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,595	12.07.2033		5.200	9	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	CPURNSA	2,598	10.04.2034		1.200	(8)	0,00
						\$ (9.109)	(4,06)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (9.097)</b>	<b>(4,06)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

#### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC USD versus JPY	¥ 140,000	16.07.2024	15.000	\$ 1	\$ 0	0,00
MYI	Put - OTC USD versus JPY	142,000	18.07.2024	15.000	2	1	0,00
RBC	Put - OTC USD versus CAD	CAD 1,323	10.07.2024	2.000	0	0	0,00
					\$ 3	\$ 1	0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,700 %	18.09.2029	MYR 57.000	\$ (3)	\$ 35	\$ 32	0,01
BPS	Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	60.898	(118)	35	(83)	(0,04)
	Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,700	18.09.2029	34.000	12	7	19	0,01
GST	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	95.400	362	(231)	131	0,06
	Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	26.202	(54)	18	(36)	(0,02)
	Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	18.09.2029	91.600	47	(143)	(96)	(0,04)
MBC	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	20.03.2029	29.000	(34)	3	(31)	(0,01)
MYC	Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	18.09.2029	55.100	(123)	47	(76)	(0,03)
						\$ 89	\$ (229)	\$ (140)	(0,06)

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MEI	Zahlung	BOVESPA Index	385	0,000 %	BRL 47.250	14.08.2024	\$ 0	\$ (185)	\$ (185)	(0,08)
	Erhalt	KOSPI2 Index	12.250.000	0,000	KRW 4.582.752	12.09.2024	0	109	109	0,05
	Zahlung	SET 50 Index	263.200	0,000	THB 212.672	27.09.2024	0	35	35	0,01
							\$ 0	\$ (41)	\$ (41)	(0,02)

#### DEVIENSTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	10.2024	CNH 87.410	\$ 12.216	\$ 141	\$ 0	\$ 141	0,06
BOA	07.2024	HKD 27.334	3.503	0	0	0	0,00
	07.2024	KRW 4.648.619	3.396	20	0	20	0,01
	07.2024	PLN 535	133	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 34	PLN 135	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	TRY 353	\$ 10	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 800	HUF 296.954	4	0	4	0,00
	09.2024	3.280	ZAR 59.478	0	(42)	(42)	(0,02)
BPS	07.2024	CAD 19.644	\$ 14.354	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	€ 848	907	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	¥ 2.192.248	14.014	385	0	385	0,17
	07.2024	\$ 3.777	AUD 5.668	9	0	9	0,00
	07.2024	7.957	CAD 10.913	18	0	18	0,01
	07.2024	1.845	€ 1.725	4	0	4	0,00
	07.2024	513	£ 402	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	67	PLN 267	1	(1)	0	0,00
	07.2024	6.221	SGD 8.437	5	0	5	0,00
	07.2024	6	TWD 204	0	0	0	0,00
	08.2024	AUD 5.668	\$ 3.780	0	(9)	(9)	0,00
	08.2024	€ 1.725	1.848	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	SGD 8.425	6.221	0	(5)	(5)	0,00
	08.2024	\$ 908	€ 848	2	0	2	0,00
	09.2024	BRL 25.360	\$ 4.700	173	0	173	0,08
	09.2024	CLP 2.416.803	2.534	0	(25)	(25)	(0,01)
	09.2024	COP 1.244.672	299	2	0	2	0,00
	09.2024	CZK 62.381	2.683	9	0	9	0,00
	09.2024	€ 5.375	5.784	2	0	2	0,00
	09.2024	HUF 2.044.945	5.525	1	(10)	(9)	0,00
	09.2024	IDR 69.352.633	4.200	0	(33)	(33)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzu- nahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
	09.2024	INR 340.805	\$ 4.070	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	0,00
	09.2024	MXN 96.433	5.258	80	(32)	48	0,02
	09.2024	PLN 29.649	7.300	0	(69)	(69)	(0,03)
	09.2024	SGD 8.115	6.000	0	(10)	(10)	0,00
	09.2024	\$ 2.800	BRL 15.352	0	(59)	(59)	(0,03)
	09.2024	5.000	CHF 4.406	0	(50)	(50)	(0,02)
	09.2024	1.164	CNH 8.326	0	(17)	(17)	(0,01)
	09.2024	1.100	CZK 25.313	0	(15)	(15)	(0,01)
	09.2024	6.796	£ 5.313	0	(77)	(77)	(0,03)
	09.2024	1.200	HUF 431.227	0	(33)	(33)	(0,01)
	09.2024	1.600	IDR 26.236.199	1	0	1	0,00
	09.2024	1.100	MXN 20.054	0	(16)	(16)	(0,01)
	09.2024	2.900	SEK 29.970	0	(58)	(58)	(0,03)
	09.2024	19	TWD 608	0	0	0	0,00
	09.2024	ZAR 130.011	\$ 6.800	0	(279)	(279)	(0,12)
	10.2024	\$ 973	CNH 6.970	0	(11)	(11)	0,00
BRC	07.2024	IDR 150.810.150	\$ 9.243	26	0	26	0,01
	07.2024	KRW 6.210.842	4.489	0	(22)	(22)	(0,01)
	07.2024	RON 131	28	0	0	0	0,00
	07.2024	SEK 3.070	293	3	0	3	0,00
	07.2024	THB 342	9	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.519	AUD 2.296	14	0	14	0,01
	07.2024	173	HKD 1.351	0	0	0	0,00
	07.2024	4	IDR 65.253	0	0	0	0,00
	07.2024	5	ILS 18	0	0	0	0,00
	07.2024	199	¥ 30.903	0	(7)	(7)	0,00
	07.2024	5.549	NOK 58.622	0	(43)	(43)	(0,02)
	07.2024	5.754	PLN 23.129	22	(24)	(2)	0,00
	07.2024	7	TRY 245	0	0	0	0,00
	09.2024	KRW 2.470.950	\$ 1.800	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	MXN 3.007	163	0	0	0	0,00
	09.2024	\$ 1.223	CNH 8.808	0	(10)	(10)	0,00
	09.2024	2.767	MXN 51.829	34	0	34	0,02
	09.2024	3.713	NZD 6.000	0	(57)	(57)	(0,03)
	09.2024	12	TRY 445	1	0	1	0,00
CBK	11.2024	TRY 1.648	\$ 42	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	CAD 265	192	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	CHF 1.265	1.390	0	(18)	(18)	(0,01)
	07.2024	€ 1.257	1.348	1	0	1	0,00
	07.2024	£ 358	455	3	0	3	0,00
	07.2024	PEN 418	110	1	0	1	0,00
	07.2024	PLN 977	247	4	0	4	0,00
	07.2024	THB 105.035	2.870	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 124	AUD 186	0	0	0	0,00
	07.2024	17.001	BRL 92.708	0	(309)	(309)	(0,14)
	07.2024	6.572	CAD 8.992	0	0	0	0,00
	07.2024	9.132	COP 37.095.656	0	(205)	(205)	(0,09)
	07.2024	17	€ 16	0	0	0	0,00
	07.2024	10.302	£ 8.092	0	(73)	(73)	(0,03)
	07.2024	77	¥ 12.300	0	0	0	0,00
	07.2024	55	PEN 209	0	0	0	0,00
	07.2024	39	PLN 155	0	0	0	0,00
	07.2024	235	SEK 2.483	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	117	ZAR 2.134	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	BRL 93.019	\$ 17.001	315	0	315	0,14
	08.2024	CAD 9.196	6.725	0	0	0	0,00
	09.2024	CNH 95.608	13.280	109	0	109	0,05
	09.2024	COP 6.111.750	1.500	43	0	43	0,02
	09.2024	INR 161.591	1.930	0	(4)	(4)	0,00
	09.2024	MXN 27.623	1.500	7	0	7	0,00
	09.2024	PEN 25.306	6.700	94	0	94	0,04
	09.2024	PHP 99.944	1.700	0	(9)	(9)	0,00
	09.2024	TWD 34.485	1.071	6	0	6	0,00
	09.2024	\$ 1.500	BRL 8.344	0	(10)	(10)	0,00
	09.2024	8.458	INR 707.103	7	(3)	4	0,00
DUB	10.2024	CNH 14.754	\$ 2.065	27	0	27	0,01
	07.2024	BRL 12.296	2.434	220	0	220	0,10
	07.2024	KRW 2.929.430	2.129	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 6.004	CLP 5.552.938	0	(122)	(122)	(0,05)
FAR	07.2024	AUD 26.509	\$ 17.668	0	(36)	(36)	(0,02)
	07.2024	€ 7.283	7.933	127	0	127	0,06
	07.2024	¥ 1.813.727	11.614	339	0	339	0,15
	07.2024	NZD 17.541	10.699	10	0	10	0,00
	08.2024	\$ 5.772	AUD 8.646	7	0	7	0,00
	08.2024	10.637	NZD 17.441	0	(10)	(10)	0,00
	09.2024	CLP 1.160.135	\$ 1.239	11	0	11	0,00
	09.2024	COP 14.575.392	3.504	28	0	28	0,01
	09.2024	\$ 1.000	¥ 155.033	0	(25)	(25)	(0,01)
GLM	07.2024	MYR 24.106	\$ 5.118	4	0	4	0,00
	07.2024	THB 243.873	6.672	18	0	18	0,01
	08.2024	\$ 4.777	BRL 24.506	0	(381)	(381)	(0,17)
	09.2024	CZK 44.474	\$ 1.917	11	0	11	0,00
	09.2024	HUF 1.036.469	2.814	8	0	8	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzu- nahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2024	THB 76.417	\$ 2.100	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	09.2024	\$ 73	MXN 1.395	2	0	2	0,00
	03.2025	TRY 796	\$ 17	0	(2)	(2)	0,00
IND	07.2024	¥ 27.600	176	5	0	5	0,00
JPM	07.2024	BRL 81	15	0	0	0	0,00
	07.2024	SGD 17.469	12.979	89	0	89	0,04
	07.2024	TRY 987	29	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	\$ 18.578	CHF 16.514	0	(201)	(201)	(0,09)
	07.2024	325	€ 301	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	30	HUF 10.981	0	0	0	0,00
	07.2024	5	ILS 18	0	0	0	0,00
	07.2024	22	KRW 30.446	0	0	0	0,00
	07.2024	308	PLN 1.232	1	(2)	(1)	0,00
	07.2024	5.479	ZAR 100.857	38	0	38	0,02
	08.2024	CHF 6.300	\$ 7.047	9	0	9	0,00
	08.2024	TRY 142	4	0	0	0	0,00
	09.2024	CLP 1.668.681	1.753	0	(14)	(14)	(0,01)
	09.2024	HUF 4.483.166	12.061	16	(89)	(73)	(0,03)
	09.2024	MXN 43.744	2.442	79	0	79	0,04
	09.2024	\$ 1.291	INR 108.162	3	0	3	0,00
	09.2024	1.700	KRW 2.346.340	10	0	10	0,00
	09.2024	2.620	ZAR 47.356	0	(42)	(42)	(0,02)
	10.2024	CNH 35.148	\$ 4.912	57	0	57	0,03
	10.2024	\$ 15	BRL 82	0	0	0	0,00
MBC	10.2024	302	CNH 2.164	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	€ 1.747	\$ 1.901	29	0	29	0,01
	07.2024	HUF 4.158.083	11.156	0	(121)	(121)	(0,05)
	07.2024	IDR 1.744.181	107	0	0	0	0,00
	07.2024	ILS 66	18	0	0	0	0,00
	07.2024	¥ 1.178.900	7.482	153	0	153	0,07
	07.2024	KRW 107.196	78	0	0	0	0,00
	07.2024	NOK 45.601	4.281	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	PLN 2.942	733	2	(1)	1	0,00
	07.2024	\$ 1.866	CZK 43.028	0	(24)	(24)	(0,01)
	07.2024	20	€ 19	0	0	0	0,00
	07.2024	453	£ 358	0	0	0	0,00
	07.2024	21.447	HUF 7.947.169	106	0	106	0,05
	07.2024	7	ILS 25	0	0	0	0,00
	07.2024	62	¥ 9.800	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	19	PLN 77	0	0	0	0,00
	07.2024	2.921	ZAR 53.497	5	0	5	0,00
	08.2024	£ 358	\$ 453	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 4.281	NOK 45.565	2	0	2	0,00
	09.2024	12.448	CNH 89.798	0	(77)	(77)	(0,03)
MYI	09.2024	22	TWD 718	0	0	0	0,00
	07.2024	BRL 80.331	\$ 14.908	445	0	445	0,20
	07.2024	CHF 899	995	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	NOK 13.022	1.221	0	(2)	(2)	0,00
	07.2024	PLN 1.201	300	1	0	1	0,00
	07.2024	SEK 42.836	4.055	11	0	11	0,00
	07.2024	\$ 5	€ 5	0	0	0	0,00
	07.2024	474	£ 374	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	10.984	NZD 17.897	0	(79)	(79)	(0,04)
	07.2024	358	PLN 1.436	3	(4)	(1)	0,00
	07.2024	6.677	SGD 9.032	0	(13)	(13)	(0,01)
	08.2024	1.221	NOK 13.012	2	0	2	0,00
	08.2024	4.055	SEK 42.770	0	(11)	(11)	0,00
	09.2024	CNH 21.610	\$ 3.000	22	0	22	0,01
	09.2024	INR 1.948	23	0	0	0	0,00
	09.2024	TWD 61.444	1.915	17	0	17	0,01
	09.2024	\$ 126	MXN 2.390	3	0	3	0,00
RBC	09.2024	4.700	SGD 6.326	0	(15)	(15)	(0,01)
RYL	07.2024	342	HKD 2.668	0	0	0	0,00
	07.2024	12.252	AUD 18.359	9	0	9	0,00
	07.2024	4.155	SEK 43.370	0	(60)	(60)	(0,03)
SCX	07.2024	KRW 2.220.526	\$ 1.628	16	0	16	0,01
	07.2024	MXN 54	3	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 9.875	€ 9.192	0	(24)	(24)	(0,01)
	07.2024	ZAR 2.163	\$ 117	0	(1)	(1)	0,00
	09.2024	PHP 351.716	5.995	0	(19)	(19)	(0,01)
	09.2024	TWD 470.581	14.596	61	0	61	0,03
	09.2024	\$ 5.856	INR 490.103	9	0	9	0,00
	09.2024	103	MXN 1.936	2	0	2	0,00
SSB	09.2024	25	TWD 794	0	0	0	0,00
	07.2024	€ 118	\$ 128	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 524	¥ 83.000	0	(8)	(8)	0,00
	09.2024	CLP 4.488.536	\$ 4.774	27	(6)	21	0,01
	09.2024	COP 7.892.838	1.965	83	0	83	0,04
	09.2024	\$ 800	HUF 297.450	5	0	5	0,00
TOR	09.2024	2.200	INR 184.521	8	0	8	0,00
	07.2024	CHF 7.292	\$ 8.073	0	(42)	(42)	(0,02)
	07.2024	HKD 3.945	506	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 10.557	¥ 1.688.097	0	(63)	(63)	(0,03)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	07.2024	\$ 109	ZAR 1.965	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	08.2024	¥ 1.680.181	\$ 10.557	63	0	63	0,03
	08.2024	\$ 3.504	COP 14.053.150	0	(136)	(136)	(0,06)
	09.2024	COP 21.019.917	\$ 5.032	20	0	20	0,01
UAG	07.2024	CHF 7.061	7.813	0	(44)	(44)	(0,02)
	07.2024	TRY 101	3	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 3	CHF 3	0	0	0	0,00
	07.2024	1.041	ILS 3.856	0	(16)	(16)	(0,01)
	08.2024	CHF 3	\$ 3	0	0	0	0,00
				\$ 3.782	\$ (3.381)	\$ 401	0,18

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2024	€ 7	\$ 8	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	\$ 7.017	€ 6.463	0	(90)	(90)	(0,04)
BPS	07.2024	€ 5.916	\$ 6.328	0	(13)	(13)	(0,01)
	07.2024	\$ 5.463	€ 5.046	0	(55)	(55)	(0,03)
	08.2024	6.335	5.914	13	0	13	0,01
BRC	07.2024	40	37	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	€ 509	\$ 550	4	0	4	0,00
FAR	07.2024	\$ 7.300	€ 6.702	0	(116)	(116)	(0,05)
GLM	07.2024	579	535	0	(6)	(6)	0,00
JPM	07.2024	€ 11	\$ 12	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	5.958	6.372	1	(15)	(14)	(0,01)
	08.2024	\$ 6.350	€ 5.930	14	0	14	0,01
RBC	07.2024	€ 120	\$ 130	2	0	2	0,00
RYL	07.2024	3	3	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	5.910	6.332	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	\$ 6.333	€ 5.903	2	0	2	0,00
SSB	07.2024	€ 254	\$ 274	1	0	1	0,00
UAG	08.2024	5	5	0	0	0	0,00
				\$ 37	\$ (297)	\$ (260)	(0,12)

Zum 30. Juni 2024 standen fur die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BRC	07.2024	£ 248	\$ 315	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2024	\$ 1.426	£ 1.114	0	(17)	(17)	(0,01)
CBK	07.2024	£ 11.525	\$ 14.583	14	0	14	0,01
	08.2024	\$ 14.313	£ 11.310	0	(13)	(13)	(0,01)
MBC	07.2024	£ 11.069	\$ 14.005	12	0	12	0,01
	07.2024	\$ 15.133	£ 11.888	0	(106)	(106)	(0,05)
	08.2024	13.993	11.058	0	(12)	(12)	(0,01)
MYI	07.2024	£ 250	\$ 320	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 18	£ 14	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	£ 308	\$ 390	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 13.670	£ 10.733	0	(102)	(102)	(0,04)
UAG	07.2024	13.254	10.408	0	(98)	(98)	(0,04)
				\$ 32	\$ (348)	\$ (316)	(0,14)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (355)	(0,16)

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMOGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHORDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fallig am 01.07.2039	\$ 5.400	\$ (5.353)	(2,39)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (5.353)	(2,39)
Summe Anlagen		\$ 217.763	97,30
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 6.036	2,70
Nettovermogen		\$ 223.799	100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 13.666 USD (31. Dezember 2023: 21.778 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 720 USD (31. Dezember 2023: 4.760 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 191.386	\$ 0	\$ 191.386
Investmentfonds	22.445	0	0	22.445
Pensionsgeschäfte	0	18.533	0	18.533
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	229	(9.477)	0	(9.248)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(5.353)	0	(5.353)
<b>Summen</b>	<b>\$ 22.674</b>	<b>\$ 195.089</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 217.763</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 203.304	\$ 0	\$ 203.304
Investmentfonds	1.691	21.949	0	23.640
Pensionsgeschäfte	0	18.466	0	18.466
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.550	(5.154)	0	(3.604)
<b>Summen</b>	<b>\$ 3.241</b>	<b>\$ 238.565</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 241.806</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 141	\$ 0	\$ 141	\$ (243)	\$ 260	\$ 17
BOA	(77)	0	(77)	(1.323)	1.370	47
BPS	(258)	120	(138)	2.550	(2.380)	170
BRC	(82)	40	(42)	102	(80)	22
CBK	(8)	0	(8)	684	(830)	(146)
DUB	100	(20)	80	(42)	80	38
FAR	335	(310)	25	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(342)	250	(92)	(1.794)	1.680	(114)
GST	(1)	0	(1)	(293)	270	(23)
IND	5	0	5	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(53)	0	(53)	80	(100)	(20)
MBC	(66)	0	(66)	(24)	0	(24)
MEI	(41)	0	(41)	506	(690)	(184)
MYC	(76)	0	(76)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	379	(300)	79	316	(550)	(234)
RBC	2	0	2	(557)	330	(227)
RYL	(51)	0	(51)	868	(940)	(72)
SCX	(57)	20	(37)	(309)	360	51
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	(79)	0	(79)
SSB	112	0	112	134	(270)	(136)
TOR	(159)	0	(159)	(26)	60	34
UAG	(158)	290	132	(640)	350	(290)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	43,94	56,26
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	34,60	28,33
Sonstige übertragbare Wertpapiere	6,97	k. A.
Investmentfonds	10,03	9,84
Pensionsgeschäfte	8,28	7,68
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,09	0,48
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(4,06)	(1,94)
Freiverkehrsfinauzderivate	(0,16)	(0,04)
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,39)	k. A.

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	65,58	57,56
US-Regierungsbehörden	12,60	14,95
Non-Agency-MBS	0,22	0,50
Forderungsbesicherte Wertpapiere	1,74	5,59
Staatsemissionen	0,85	1,89
Kurzfristige Instrumente	4,52	4,10
Investmentfonds	10,03	9,84
Pensionsgeschäfte	8,28	7,68
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,09	0,48
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,01	0,31
Zinsswaps	(4,06)	(2,25)
Freiverkehrsfinauzderivat		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswaps	(0,06)	(0,21)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,02)	0,21
Devisenterminkontrakte	0,18	(0,29)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,26)	0,25
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,39)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	2,70	(0,61)
Nettovermögen	100,00	100,00





BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Mortimer BTL PLC				6,860 % fällig am 05.06.2026	£ 500	£ 512	0,21	Walgreens Boots Alliance, Inc.			
5,934 % fällig am 23.06.2053	£ 1.352	£ 1.351	0,55	General Motors Financial Co., Inc.				3,600 % fällig am 20.11.2025	£ 400	£ 386	0,16
6,283 % fällig am 23.03.2054	759	761	0,31	5,150 % fällig am 15.08.2026	500	496	0,20	Wells Fargo & Co.			
Pierpont BTL PLC				Goldman Sachs Group, Inc.				2,125 % fällig am 24.09.2031	1.800	1.472	0,61
6,334 % fällig am 21.09.2054	886	891	0,37	1,875 % fällig am 16.12.2030	1.600	1.321	0,54	2,500 % fällig am 02.05.2029	1.650	1.465	0,60
Polaris PLC				3,625 % fällig am 29.10.2029	1.175	1.104	0,45	Welltower OP LLC			
6,510 % fällig am 23.05.2059	774	778	0,32	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital, Inc.				4,800 % fällig am 20.11.2028	500	487	0,20
Stratton Mortgage Funding PLC				6,375 % fällig am 01.07.2034 (a)	\$ 200	155	0,06				
0,000 % fällig am 20.06.2060	400	401	0,17	JPMorgan Chase & Co.							
Towd Point Mortgage Funding PLC				0,991 % fällig am 28.04.2026	£ 500	482	0,20	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
0,000 % fällig am 20.07.2053	700	701	0,29	1,895 % fällig am 28.04.2033	1.500	1.205	0,50	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
6,583 % fällig am 20.07.2045	188	188	0,08	MassMutual Global Funding				5,960 % fällig am 25.04.2035	\$ 80	55	0,03
Twin Bridges PLC				1,375 % fällig am 15.12.2026	1.500	1.376	0,57	Sequoia Mortgage Trust			
6,084 % fällig am 12.03.2055	1.182	1.183	0,49	5,000 % fällig am 12.12.2027	750	754	0,31	4,121 % fällig am 20.07.2037	5	3	0,00
		9.825	4,03	McDonald's Corp.				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				2,950 % fällig am 15.03.2034	1.400	1.178	0,48	7,282 % fällig am 25.02.2034	1	1	0,00
United Kingdom Gilt				3,750 % fällig am 31.05.2038	500	425	0,18	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
1,500 % fällig am 31.07.2053	13.500	6.809	2,78	Medtronic, Inc.				6,353 % fällig am 25.11.2042	9	6	0,00
1,625 % fällig am 22.10.2028 (g)	7.400	6.712	2,76	4,150 % fällig am 15.10.2053	£ 100	86	0,04				
3,500 % fällig am 22.01.2045	700	596	0,24	Metropolitan Life Global Funding							
3,500 % fällig am 22.07.2068	400	324	0,13	0,625 % fällig am 08.12.2027	£ 400	346	0,14	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
4,375 % fällig am 31.07.2054	5.150	4.912	2,02	1,625 % fällig am 21.09.2029	400	341	0,14	Fannie Mae			
		19.353	7,93	3,500 % fällig am 30.09.2026	740	716	0,29	6,314 % fällig am 01.07.2044	3	3	0,00
Summe Großbritannien		103.820	42,60	5,000 % fällig am 10.01.2030	900	904	0,37	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
<b>USA</b>				Morgan Stanley				3,000 % fällig am 01.08.2054	500	337	0,14
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,789 % fällig am 18.11.2033	600	618	0,25	4,500 % fällig am 01.08.2054	2.680	2.000	0,82
Amgen, Inc.				Nestle Capital Corp.				5,000 % fällig am 01.08.2054	2.580	1.972	0,81
4,000 % fällig am 13.09.2029	740	708	0,29	4,500 % fällig am 22.03.2029	400	397	0,16	6,000 % fällig am 01.08.2054	7.280	5.773	2,37
AT&T, Inc.				Nestle Holdings, Inc.				6,500 % fällig am 01.08.2054	6.380	5.134	2,10
4,250 % fällig am 01.06.2043	900	736	0,30	2,500 % fällig am 04.04.2032	750	647	0,27	Summe USA			
4,375 % fällig am 14.09.2029	1.000	965	0,40	New York Life Global Funding							
Athene Global Funding				1,250 % fällig am 17.12.2026	500	458	0,19	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
1,750 % fällig am 24.11.2027	400	357	0,15	4,950 % fällig am 07.12.2029	900	911	0,37	<b>U.K. TREASURY BILLS</b>			
5,150 % fällig am 28.07.2027	900	895	0,37	Northwestern Mutual Global Funding				5,130 % fällig am			
Bank of America Corp.				4,880 % fällig am 12.12.2029	1.100	1.106	0,45	28.10.2024 (b)(c)	£ 50	49	0,02
3,584 % fällig am 27.04.2031	2.800	2.589	1,06	Pacific Life Global Funding				5,170 % fällig am			
Berkshire Hathaway Finance Corp.				5,000 % fällig am 12.01.2028	1.100	1.102	0,45	28.10.2024 (b)(c)	8.200	8.064	3,31
2,375 % fällig am 19.06.2039	1.600	1.122	0,46	5,375 % fällig am 30.11.2028	300	305	0,13	5,187 % fällig am			
Boeing Co.				PacifiCorp				28.10.2024 (b)(c)	4.000	3.933	1,62
6,259 % fällig am 01.05.2027	\$ 150	119	0,05	5,500 % fällig am 15.05.2054	\$ 900	662	0,27	5,199 % fällig am			
6,298 % fällig am 01.05.2029	150	120	0,05	Procter & Gamble Co.				16.12.2024 (b)(c)	700	684	0,28
6,528 % fällig am 01.05.2034	100	81	0,03	6,250 % fällig am 31.01.2030	£ 400	429	0,18	5,200 % fällig am			
Citigroup, Inc.				Prologis LP				16.12.2024 (b)(c)	500	488	0,20
1,750 % fällig am 23.10.2026	£ 1.000	927	0,38	5,625 % fällig am 04.05.2040	800	798	0,33	Summe kurzfristige Instrumente			
Comcast Corp.				Protective Life Global Funding				Summe Übertragbare Wertpapiere	£ 236.612	97,10	
1,500 % fällig am 20.02.2029	400	348	0,14	5,248 % fällig am 13.01.2028	1.100	1.109	0,46	<b>AKTIEN</b>			
Credit Suisse AG AT1 Claim				Realty Income Corp.				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Digital Stout Holding LLC				1,750 % fällig am 13.07.2033	825	613	0,25	<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>			
3,750 % fällig am 17.10.2030	£ 838	758	0,31	5,750 % fällig am 05.12.2031	100	102	0,04	PIMCO ETFs plc - PIMCO			
Fiserv, Inc.				6,124 % fällig am 31.05.2027	\$ 400	318	0,13	Sterling Short Maturity			
3,000 % fällig am 01.07.2031	791	687	0,28	Santander Holdings USA, Inc.				UCITS ETF (e)	187.100	19.189	7,88
Ford Motor Credit Co. LLC				6,342 % fällig am 31.05.2035	400	316	0,13	Summe Investmentfonds	£ 19.189	7,88	
5,625 % fällig am 09.10.2028	200	200	0,08	Verizon Communications, Inc.							
				1,875 % fällig am 19.09.2030	£ 500	417	0,17				
				2,500 % fällig am 08.04.2031	1.400	1.200	0,49				

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 439	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	£ (354)	£ 347	£ 347	0,14
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						£ (354)	£ 347	£ 347	0,14

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SONIA Index September Futures	Long	12.2024	98	£ 0	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2024	56	(36)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	59	(31)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	15	(24)	(0,01)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	32	(16)	(0,01)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2024	84	(31)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	76	(33)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	137	29	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	80	20	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	4	4	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2024	4	(6)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	2	(2)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	90	37	0,01
				£ (89)	(0,04)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>£ (89)</b>	<b>(0,04)</b>

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Cellnex Telecom S.A.	5,000 %	20.06.2030	€ 800	£ 14	0,01
Cellnex Telecom S.A.	5,000	20.12.2033	200	5	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2030	250	6	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2030	400	25	0,01
				£ 50	0,02

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000 %	20.06.2029	\$ 200	£ 0	0,00
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	1,000	20.06.2029	€ 10.000	(18)	(0,01)
				£ (18)	(0,01)

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,728 %	16.12.2025	£ 3.400	£ (8)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2054	400	11	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	4.300	18	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	18.09.2026	46.300	(4)	0,00
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	\$ 9.000	(179)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	9.300	(169)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	12.02.2045	2.100	70	0,03
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	4.100	41	0,02
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,750	20.06.2034	5.500	(87)	(0,04)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 1.200	32	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	1.600	27	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,650	08.01.2034	400	8	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	6.200	(88)	(0,04)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,760	03.01.2029	400	4	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,770	29.04.2034	1.100	(3)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,780	02.05.2029	1.300	(5)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,880	19.12.2028	600	(6)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,890	22.12.2033	400	(6)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,910	29.12.2033	300	(5)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	29.12.2028	300	(4)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,950	12.06.2029	600	2	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026	5.200	(33)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,063	06.12.2033	200	(5)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,128	04.12.2033	200	(6)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,148	20.11.2033	300	(6)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,179	29.11.2028	200	(4)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,250	06.11.2033	300	(10)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,255 %	22.11.2028	€ 300	£ (7)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,270	08.11.2028	600	(11)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,280	22.11.2033	200	(8)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	3,305	27.11.2033	300	(13)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	CPURNSA	2,501	10.05.2029	\$ 4.000	6	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,520	04.04.2029	3.900	(2)	0,00
					£ (450)	(0,18)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>£ (418)</b>	<b>(0,17)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSoPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 41 5-Year Index	Verkauf	0,850 %	18.09.2024	1.500	£ (2)	£ (1)	0,00

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700 %	04.07.2024	800	£ (1)	£ 0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	800	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,700	05.07.2024	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	400	(1)	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,610	15.07.2024	1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	15.07.2024	1.000	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,800	03.07.2024	800	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,150	03.07.2024	800	(3)	0	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	800	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	800	(1)	0	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	17.07.2024	1.700	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	22.07.2024	1.700	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	1.700	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	22.07.2024	1.700	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,970	17.07.2024	1.700	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	1.700	(2)	(1)	0,00
ULO	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,570	25.07.2024	1.000	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	25.07.2024	1.000	(3)	(4)	(0,01)
						£ (34)	£ (21)	(0,01)	

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzu- nahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 24.370	£ 20.757	£ 95	£ 0	£ 95	0,04
BPS	07.2024	£ 5.676	€ 6.700	4	0	4	0,00
	07.2024	\$ 4.545	£ 3.558	0	(37)	(37)	(0,01)
BRC	07.2024	€ 1.845	1.566	3	(1)	2	0,00
	07.2024	\$ 249	195	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2024	£ 1.288	\$ 1.635	6	0	6	0,00
GLM	07.2024	16.574	€ 19.638	76	0	76	0,03
	08.2024	€ 19.638	£ 16.595	0	(76)	(76)	(0,03)
JPM	07.2024	548	467	2	0	2	0,00
	07.2024	£ 280	€ 328	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2024	1.487	1.760	5	0	5	0,00
	07.2024	\$ 238	£ 186	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2024	£ 357	€ 423	2	0	2	0,00
RBC	07.2024	3.325	\$ 4.216	11	0	11	0,00
	08.2024	\$ 4.217	£ 3.325	0	(11)	(11)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzu- nahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SCX	07.2024	€ 294	£ 251	£ 1	£ 0	£ 1	0,00
	07.2024	\$ 855	673	0	(3)	(3)	0,00
SSB	07.2024	€ 1.792	1.513	0	(6)	(6)	0,00
	08.2024	677	574	0	(1)	(1)	0,00
				£ 205	£ (141)	£ 64	0,03
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>£ 42</b>	<b>0,02</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>£ 255.683</b>	<b>104,93</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>£ (12.024)</b>	<b>(4,93)</b>
<b>Nettovermögen</b>						<b>£ 243.659</b>	<b>100,00</b>

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.  
(b) Nullkuponwertpapier.  
(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
(e) Mit dem Fonds verbunden.  
(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
(g) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 7.172 GBP (31. Dezember 2023: 21.034 GBP) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null GBP (31. Dezember 2023: 483 GBP) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 3.522 GBP (31. Dezember 2023: 3.382 GBP) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 236.611	£ 1	£ 236.612
Investmentfonds	0	19.189	0	19.189
Pensionsgeschäfte	0	347	0	347
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(101)	(364)	0	(465)
<b>Summen</b>	<b>£ (101)</b>	<b>£ 255.783</b>	<b>£ 1</b>	<b>£ 255.683</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 365.325	£ 0	£ 365.325
Investmentfonds	18.137	0	0	18.137
Pensionsgeschäfte	0	5.455	0	5.455
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(231)	(127)	0	(358)
<b>Summen</b>	<b>£ 17.906</b>	<b>£ 370.653</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 388.559</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,500 %	17.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (273)	£ (231)	(0,09)
MEI	5,190	25.06.2024	22.07.2024	£ (6.760)	(6.766)	(2,78)
MYI	0,250	18.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (273)	(232)	(0,10)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>£ (7.229)</b>	<b>(2,97)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	£ 95	£ 0	£ 95	£ 2	£ 0	£ 2
BPS	(33)	0	(33)	(1)	0	(1)
BRC	(1)	0	(1)	(6)	0	(6)
CBK	6	0	6	(6)	0	(6)
GLM	(1)	0	(1)	5	0	5
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(2)	0	(2)
JPM	(3)	0	(3)	(24)	0	(24)
MBC	3	0	3	1	0	1
MYC	(2)	0	(2)	(1)	0	(1)
MYI	2	0	2	(45)	0	(45)
RYL	(10)	0	(10)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	(2)	0	(2)	22	0	22
SSB	(7)	0	(7)	26	0	26
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	73	0	73
ULO	(5)	0	(5)	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,37	96,47
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	12,30	4,71
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,43	0,01
Investmentfonds	7,88	5,02
Pensionsgeschäfte	0,14	1,51
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,04)	(0,08)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,17)	(0,03)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,02	0,01
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,97)	(5,70)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	0,49	0,42
Österreich	0,14	k. A.
Kanada	0,45	0,95
Cayman-Inseln	1,01	0,37
Tschechische Republik	0,56	0,58
Dänemark	1,47	1,27
Finnland	k. A.	0,53
Frankreich	6,50	6,42
Deutschland	0,67	1,66
Irland	1,88	1,20
Italien	1,76	1,31
Jersey, Kanalinseln	2,63	2,61
Luxemburg	0,88	1,19
Mexiko	0,12	0,11
Niederlande	4,79	5,46
Norwegen	0,94	0,51
Singapur	k. A.	0,06
Slowakei	0,27	k. A.
Spanien	1,39	0,71
Supranational	k. A.	3,56
Schweden	k. A.	0,43
Schweiz	1,52	1,11
Großbritannien	42,60	52,49
USA	21,60	17,60
Kurzfristige Instrumente	5,43	0,64
Investmentfonds	7,88	5,02
Pensionsgeschäfte	0,14	1,51
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,04)	(0,08)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,01)	k. A.
Zinsswaps	(0,18)	(0,05)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,01)	0,00
Devisenterminkontrakte	0,03	0,01
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,93)	(7,62)
Nettovermögen	100,00	100,00





Aufstellung der Wertpaperanlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,801 % fällig am 13.10.2040	£ 318		0,10	Polaris PLC				National Fuel Gas Co.			
6,052 % fällig am 13.10.2039	109	112	0,03	6,000 % fällig am 23.12.2058	£ 326	£ 326	0,10	2,950 % fällig am 01.03.2031	\$ 159	£ 106	0,03
<b>Thames Water Utilities Finance PLC</b>				Twin Bridges PLC				Nestle Capital Corp.			
2,375 % fällig am 22.04.2040	1.500	945	0,28	6,084 % fällig am 12.03.2055	657	657	0,20	4,750 % fällig am 22.03.2036	£ 600	590	0,18
2,625 % fällig am 24.01.2032	300	227	0,07					NextEra Energy Capital Holdings, Inc.			
4,375 % fällig am 03.07.2034	3.700	2.935	0,88					6,750 % fällig am 15.06.2054	\$ 1.300	1.037	0,31
5,125 % fällig am 28.09.2037	1.600	1.321	0,40	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Pfizer, Inc.			
5,500 % fällig am 11.02.2041	600	487	0,15	<b>LCR Finance PLC</b>				2,735 % fällig am 15.06.2043	£ 2.200	1.536	0,46
7,738 % fällig am 09.04.2058	1.200	1.167	0,35	4,500 % fällig am 07.12.2038	75	74	0,02	Prologis LP			
7,750 % fällig am 30.04.2044	300	281	0,08	United Kingdom Gilt				5,625 % fällig am 04.05.2040	1.000	997	0,30
8,250 % fällig am 25.04.2040	400	382	0,12	1,250 % fällig am 31.07.2051	5.900	2.853	0,86	Realty Income Corp.			
<b>Together Housing Finance PLC</b>				1,500 % fällig am 31.07.2053	400	202	0,06	1,750 % fällig am 13.07.2033	1.100	817	0,25
4,500 % fällig am 17.12.2042	300	261	0,08	1,750 % fällig am 22.07.2057	500	262	0,08	2,500 % fällig am 14.01.2042	500	330	0,10
<b>TP ICAP Finance PLC</b>				3,250 % fällig am 22.01.2044 (e)	3.300	2.725	0,82	6,000 % fällig am 05.12.2039	200	208	0,06
2,625 % fällig am 18.11.2028	1.000	858	0,26	3,750 % fällig am 22.10.2053	2.200	1.883	0,57	Time Warner Cable LLC			
Unique Pub Finance Co. PLC				4,375 % fällig am 31.07.2054	600	572	0,18	5,250 % fällig am 15.07.2042	1.886	1.556	0,47
5,659 % fällig am 30.06.2027	845	838	0,25	Summe Großbritannien		195.017	58,81	Verizon Communications, Inc.			
<b>United Utilities Water Finance PLC</b>								1,875 % fällig am 03.11.2038	2.700	1.757	0,53
5,125 % fällig am 06.10.2038	1.000	945	0,28					3,125 % fällig am 02.11.2035	600	489	0,15
5,750 % fällig am 26.06.2036	1.700	1.733	0,52	<b>USA</b>				3,375 % fällig am 27.10.2036	2.800	2.305	0,70
5,750 % fällig am 28.05.2051	600	583	0,18	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Walmart, Inc.			
<b>University of Oxford</b>				<b>AES Corp.</b>				5,250 % fällig am 28.09.2035	2.000	2.082	0,63
2,544 % fällig am 08.12.2117	3.150	1.652	0,50	7,600 % fällig am 15.01.2055	\$ 200	160	0,05	Wells Fargo & Co.			
<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>				Apple, Inc.				2,125 % fällig am 24.09.2031	400	327	0,10
4,250 % fällig am 15.01.2030	1.100	938	0,28	3,600 % fällig am 31.07.2042	£ 1.400	1.174	0,35	4,625 % fällig am 02.11.2035	1.729	1.642	0,50
<b>Vodafone Group PLC</b>				AT&T, Inc.				4,875 % fällig am 29.11.2035	1.700	1.571	0,47
3,000 % fällig am 12.08.2056	2.100	1.245	0,38	4,250 % fällig am 01.06.2043	5.113	4.179	1,26				
3,375 % fällig am 08.08.2049	5.100	3.445	1,04	4,875 % fällig am 01.06.2044	4.038	3.572	1,08				
<b>Wellcome Trust Ltd.</b>				7,000 % fällig am 30.04.2040	800	899	0,27	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
1,500 % fällig am 14.07.2071	5.600	2.145	0,65	Berkshire Hathaway Finance Corp.				Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
2,517 % fällig am 07.02.2118	1.500	775	0,23	2,375 % fällig am 19.06.2039	400	280	0,08	5,960 % fällig am 25.04.2035	\$ 127	89	0,03
4,000 % fällig am 09.05.2059	400	338	0,10	2,625 % fällig am 19.06.2059	3.600	2.047	0,62	GSR Mortgage Loan Trust			
<b>Workspace Group PLC</b>				Boeing Co.				6,455 % fällig am 25.09.2035	0	0	0,00
2,250 % fällig am 11.03.2028	450	386	0,12	6,858 % fällig am 01.05.2054	\$ 200	162	0,05	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust			
<b>WPP Finance</b>				Charter Communications Operating LLC				5,883 % fällig am 15.12.2030	2	1	0,00
2,875 % fällig am 14.09.2046	800	496	0,15	5,125 % fällig am 01.07.2049	500	304	0,09	Sequoia Mortgage Trust			
<b>Yorkshire Housing Finance PLC</b>				Citigroup, Inc.				4,121 % fällig am 20.07.2037	6	4	0,00
4,125 % fällig am 31.10.2044	800	654	0,20	6,800 % fällig am 25.06.2038	£ 2.000	2.264	0,68				
<b>Yorkshire Water Finance PLC</b>				7,375 % fällig am 01.09.2039	400	477	0,14	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
1,750 % fällig am 27.10.2032	715	524	0,16	Comcast Corp.				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,750 % fällig am 18.04.2041	2.300	1.516	0,46	1,875 % fällig am 20.02.2036	1.650	1.187	0,36	4,000 % fällig am 01.07.2054	5.900	4.271	1,29
5,500 % fällig am 28.04.2035	1.300	1.215	0,37	Credit Suisse AG AT1 Claim	\$ 1.600	152	0,05	4,500 % fällig am 01.08.2054	3.000	2.238	0,68
		181.492	54,73	Eli Lilly & Co.				5,000 % fällig am 01.08.2054	4.400	3.364	1,01
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				1,625 % fällig am 14.09.2043	£ 700	403	0,12	5,500 % fällig am 01.08.2054	4.100	3.199	0,96
Atlas Funding PLC				Entergy Corp.				6,500 % fällig am 01.08.2054	5.600	4.506	1,36
6,361 % fällig am 20.01.2061	566	570	0,17	Goldman Sachs Group, Inc.							
Great Hall Mortgages PLC				3,625 % fällig am 29.10.2029	£ 1.800	1.691	0,51	<b>US-SCHATZOBLIGATIONEN</b>			
5,483 % fällig am 18.03.2039	1	1	0,00	JPMorgan Chase & Co.				U.S. Treasury Inflation Protected Securities (a)			
<b>Mansard Mortgages PLC</b>				1,895 % fällig am 28.04.2033	£ 1.400	1.124	0,34	1,125 % fällig am 15.01.2033	3.052	2.235	0,68
6,002 % fällig am 15.12.2049	94	93	0,03	3,761 % fällig am 21.03.2034	€ 400	337	0,10	2,375 % fällig am 15.10.2028	5.015	4.020	1,21
<b>Mortimer BTL PLC</b>				McDonald's Corp.							
5,934 % fällig am 23.06.2053	879	878	0,26	2,950 % fällig am 15.03.2034	£ 400	337	0,10	<b>Summe USA</b>		65.255	19,68
6,283 % fällig am 23.03.2054	675	676	0,20	3,750 % fällig am 31.05.2038	2.700	2.296	0,69	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>		£ 338.305	102,03
<b>Newgate Funding PLC</b>				Mondelez International, Inc.							
4,319 % fällig am 15.12.2050	€ 1.074	901	0,27	3,875 % fällig am 06.03.2045	100	78	0,02				
5,512 % fällig am 01.12.2050	£ 51	50	0,02	Morgan Stanley							
<b>Pierpont BTL PLC</b>				5,789 % fällig am 18.11.2033	800	823	0,25				
6,334 % fällig am 21.09.2054	797	802	0,24								

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2024	16	£ 16	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2024	24	(25)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	32	19	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	10	(26)	(0,01)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2024	21	(14)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2024	17	7	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	7	8	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	67	(33)	(0,01)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	62	£ 19	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	24	9	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	22	9	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	57	(2)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	162	47	0,01
				£ 34	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				£ 34	0,01

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Cellnex Telecom S.A.	5,000 %	20.12.2033	€ 700	£ 40	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 41 5-Year Index	1,000 %	20.06.2029	€ 11.600	£ 15	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	18.09.2054	£ 19.500	£ (454)	(0,14)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	6.500	7	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,250	18.09.2026	11.300	(53)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	\$ 3.700	510	0,15
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,250	16.12.2050	100	34	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,625	16.01.2050	100	40	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	21.06.2047	1.300	499	0,15
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1,750	18.12.2049	400	161	0,05
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	2,000	12.02.2045	6.600	2.493	0,75
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.12.2025	CAD 14.000	142	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	20.12.2033	AUD 8.100	83	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	€ 3.300	137	0,04
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	1.400	(4)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2029	2.200	21	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	6.500	(106)	(0,03)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	18.09.2026	4.400	23	0,01
					£ 3.533	1,07
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					£ 3.588	1,08

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	07.2024	€ 9.425	£ 8.028	£ 37	£ 0	£ 37	0,01
BPS	07.2024	\$ 10.608	£ 8.304	0	(87)	(87)	(0,03)
GLM	07.2024	£ 8.511	€ 10.085	39	0	39	0,01
	08.2024	€ 10.085	£ 8.522	0	(39)	(39)	(0,01)
MBC	07.2024	£ 468	€ 395	0	(1)	(1)	0,00
	07.2024	£ 323	€ 381	0	0	0	0,00
	07.2024	£ 472	\$ 600	3	0	3	0,00
	07.2024	\$ 1.579	£ 1.235	0	(14)	(14)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
MYI	07.2024	¥ 10.300	£ 52	£ 1	£ 0	£ 1	0,00
	07.2024	\$ 426	335	0	(2)	(2)	0,00
RBC	07.2024	£ 9.402	\$ 11.923	30	0	30	0,01
	08.2024	\$ 11.925	£ 9.402	0	(30)	(30)	(0,01)
SSB	07.2024	€ 653	553	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07.2024	£ 68	€ 80	0	0	0	0,00
				£ 110	£ (174)	£ (64)	(0,02)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						£ (64)	(0,02)
<b>Summe Anlagen</b>						£ 341.863	103,10
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						£ (10.276)	(3,10)
<b>Nettovermögen</b>						£ 331.587	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
(b) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar  
(c) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
(d) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: null):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Places for People Treasury PLC	5,750 %	11.05.2055	11.06.2024	£ 676	£ 689	0,21

- (c) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 413 GBP (31. Dezember 2023: 4.309 GBP) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2023: 197 GBP) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 5.150 GBP (31. Dezember 2023: 3.754 GBP) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 338.305	£ 0	£ 338.305
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	32	3.526	0	3.558
<b>Summen</b>	<b>£ 32</b>	<b>£ 341.831</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 341.863</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 330.293	£ 0	£ 330.293
Pensionsgeschäfte	0	6.500	0	6.500
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.036	4.792	0	5.828
<b>Summen</b>	<b>£ 1.036</b>	<b>£ 341.585</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 342.621</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
SCX	5,290 %	14.05.2024	22.07.2024	£ (418)	£ (421)	(0,13)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>£ (421)</b>	<b>(0,13)</b>

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	£ 37	£ 0	£ 37	£ k. A.	£ k. A.	£ k. A.
BPS	(87)	0	(87)	2	0	2
BRC	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	3	0	3
MBC	(12)	0	(12)	5	0	5
MYI	(1)	0	(1)	(10)	0	(10)
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	9	0	9
SSB	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	11	0	11

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	98,46	95,70
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	3,56	5,95
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	0,05
Pensionsgeschäfte	k. A.	2,00
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,37
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,08	1,42
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,02)	0,01
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,13)	(1,22)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	0,13	0,14
Belgien	0,10	k. A.
Bermuda	k. A.	0,18
Cayman-Inseln	0,98	0,78
Tschechische Republik	0,65	k. A.
Dänemark	0,87	1,45
Frankreich	7,12	7,04
Deutschland	1,02	0,47
Irland	0,62	0,77
Italien	0,91	0,74
Jersey, Kanalinseln	3,40	3,51
Luxemburg	0,76	0,56
Mexiko	0,63	0,53
Niederlande	4,67	4,27
Norwegen	0,19	0,21
Singapur	0,32	0,35
Spanien	0,29	0,13
Schweden	0,41	0,44
Schweiz	0,47	0,25
Großbritannien	58,81	60,41
USA	19,68	19,47
Pensionsgeschäfte	k. A.	2,00
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,37
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	1,07	1,40
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	(0,02)	0,01
Sonstige Aktiva und Passiva	(3,10)	(5,50)
Nettovermögen	100,00	100,00





## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Cable One, Inc. 4,000 % fällig am 15.11.2030	\$ 6.025	\$ 4.502	0,26	Coherent Corp. 5,000 % fällig am 15.12.2029	\$ 600	\$ 568	0,03	Esab Corp. 6,250 % fällig am 15.04.2029	\$ 900	\$ 907	0,05
Cablevision Lightpath LLC 3,875 % fällig am 15.09.2027	604	535	0,03	Community Health Systems, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2031	5.000	3.936	0,23	Fertiitta Entertainment LLC 4,625 % fällig am 15.01.2029	2.000	1.823	0,10
Caesars Entertainment, Inc. 4,625 % fällig am 15.10.2029	1.500	1.376	0,08	5,250 % fällig am 15.05.2030	3.650	3.013	0,17	6,750 % fällig am 15.01.2030	2.050	1.802	0,10
6,500 % fällig am 15.02.2032	2.000	2.011	0,12	5,625 % fällig am 15.03.2027	9.000	8.389	0,48	Fiesta Purchaser, Inc. 7,875 % fällig am 01.03.2031	1.700	1.758	0,10
7,000 % fällig am 15.02.2030	1.300	1.329	0,08	6,000 % fällig am 15.01.2029	925	817	0,05	First Student Bidco, Inc. 4,000 % fällig am 31.07.2029	3.000	2.706	0,16
Capstone Borrower, Inc. 8,000 % fällig am 15.06.2030	2.300	2.377	0,14	10,875 % fällig am 15.01.2032	3.450	3.595	0,21	Fortrea Holdings, Inc. 7,500 % fällig am 01.07.2030	800	796	0,05
Cargo Aircraft Management, Inc. 4,750 % fällig am 01.02.2028	5.300	4.922	0,28	Comstock Resources, Inc. 5,875 % fällig am 15.01.2030	1.700	1.583	0,09	Fortress Intermediate, Inc. 7,500 % fällig am 01.06.2031	1.150	1.180	0,07
Carnival Corp. 4,000 % fällig am 01.08.2028	5.000	4.699	0,27	Concentra Escrow Issuer Corp. 6,875 % fällig am 15.07.2032 (a)	400	406	0,02	Foundation Building Materials, Inc. 6,000 % fällig am 01.03.2029	5.300	4.709	0,27
5,750 % fällig am 01.03.2027	8.900	8.798	0,50	Connect Finco SARRL 6,750 % fällig am 01.10.2026	2.000	1.932	0,11	Frontier Communications Holdings LLC 5,000 % fällig am 01.05.2028	2.000	1.886	0,11
6,000 % fällig am 01.05.2029	2.500	2.471	0,14	Consolidated Communications, Inc. 5,000 % fällig am 01.10.2028	2.000	1.656	0,10	5,875 % fällig am 15.10.2027	3.000	2.932	0,17
7,625 % fällig am 01.03.2026	5.000	5.053	0,29	CoreLogic, Inc. 4,500 % fällig am 01.05.2028	250	227	0,01	6,000 % fällig am 15.01.2030	1.200	1.046	0,06
Carnival PLC 1,000 % fällig am 28.10.2029	€ 5.000	4.388	0,25	Coty, Inc. 5,000 % fällig am 15.04.2026	1.045	1.032	0,06	6,750 % fällig am 01.05.2029	1.200	1.102	0,06
Carvana Co. (12.000% PIK) 12,000 % fällig am 01.12.2028 (b)	\$ 2.550	2.629	0,15	6,625 % fällig am 15.07.2030	2.000	2.031	0,12	8,625 % fällig am 15.03.2031	900	928	0,05
Carvana Co. (13.000% PIK) 13,000 % fällig am 01.06.2030 (b)	3.148	3.294	0,19	Cougar JV Subsidiary LLC 8,000 % fällig am 15.05.2032	225	233	0,01	8,750 % fällig am 15.05.2030	175	181	0,01
CCO Holdings LLC 4,250 % fällig am 01.02.2031	4.500	3.677	0,21	CQP Holdco LP 5,500 % fällig am 15.06.2031	5.800	5.502	0,32	Gap, Inc. 3,625 % fällig am 01.10.2029	9.300	8.060	0,46
4,250 % fällig am 15.01.2034	3.700	2.812	0,16	Crescent Energy Finance LLC 7,375 % fällig am 15.01.2033	2.325	2.331	0,13	3,875 % fällig am 01.10.2031	2.800	2.340	0,13
4,500 % fällig am 15.08.2030	3.000	2.542	0,15	Crocs, Inc. 4,250 % fällig am 15.03.2029	900	821	0,05	Garda World Security Corp. 4,625 % fällig am 15.02.2027	4.500	4.306	0,25
4,500 % fällig am 01.05.2032	6.500	5.240	0,30	Crownstrike Holdings, Inc. 3,000 % fällig am 15.11.2031	3.200	3.231	0,13	6,000 % fällig am 01.06.2029	3.300	3.014	0,17
4,500 % fällig am 01.06.2033	3.500	2.758	0,16	Crown Americas LLC 5,250 % fällig am 01.04.2030	1.000	968	0,06	7,750 % fällig am 15.02.2028	4.300	4.386	0,25
4,750 % fällig am 01.03.2030	4.000	3.467	0,20	CSC Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.02.2031	1.300	813	0,05	Genesee & Wyoming, Inc. 6,250 % fällig am 15.04.2032	3.550	3.541	0,20
5,000 % fällig am 01.02.2028	3.900	3.649	0,21	4,125 % fällig am 01.12.2030	1.625	1.052	0,06	GFL Environmental, Inc. 4,000 % fällig am 01.08.2028	5.000	4.651	0,27
5,125 % fällig am 01.05.2027	3.600	3.459	0,20	4,500 % fällig am 15.11.2031	2.000	1.292	0,07	Global Medical Response, Inc. 0,000 % fällig am 31.10.2028	1.338	1.307	0,08
5,375 % fällig am 01.06.2029	4.000	3.643	0,21	4,625 % fällig am 01.12.2030	1.625	1.052	0,06	GN Bondco LLC 9,500 % fällig am 15.10.2031	6.200	5.785	0,33
CD&R Smokey Buyer, Inc. 6,750 % fällig am 15.07.2025	2.589	2.575	0,15	5,000 % fällig am 01.12.2030	3.200	1.168	0,07	Go Daddy Operating Co. LLC 3,500 % fällig am 01.03.2029	3.300	2.983	0,17
Cerba Healthcare SACA 3,500 % fällig am 31.05.2028	€ 2.050	1.822	0,10	5,000 % fällig am 15.11.2031	800	291	0,02	goeasy Ltd. 7,625 % fällig am 01.07.2029	2.575	2.629	0,15
Champions Financing, Inc. 8,750 % fällig am 15.02.2029	\$ 500	513	0,03	5,375 % fällig am 01.02.2028	1.500	1.141	0,07	9,250 % fällig am 01.12.2028	3.050	3.240	0,19
Charles River Laboratories International, Inc. 3,750 % fällig am 15.03.2029	2.000	1.827	0,10	5,500 % fällig am 15.04.2027	1.800	1.462	0,08	Graham Packaging Co., Inc. 7,125 % fällig am 15.08.2028 (i)	8.000	7.566	0,43
4,000 % fällig am 15.03.2031	100	89	0,01	5,750 % fällig am 15.01.2030	3.200	1.211	0,07	Graphic Packaging International LLC 3,500 % fällig am 01.03.2029	2.100	1.892	0,11
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 5,500 % fällig am 15.01.2028	800	742	0,04	6,500 % fällig am 01.02.2029	3.000	2.192	0,13	6,375 % fällig am 15.07.2032	700	700	0,04
Chesapeake Energy Corp. 6,750 % fällig am 15.04.2029	3.100	3.109	0,18	7,500 % fällig am 01.04.2028	1.500	798	0,05	Gray Television, Inc. 10,500 % fällig am 15.07.2029	975	981	0,06
Chobani LLC 4,625 % fällig am 15.11.2028	2.000	1.891	0,11	11,250 % fällig am 15.05.2028	1.300	1.134	0,07	GYP Holdings Corp. 4,625 % fällig am 01.05.2029	1.100	1.019	0,06
7,625 % fällig am 01.07.2029	2.700	2.784	0,16	11,750 % fällig am 31.01.2029	2.850	2.432	0,14	Harbour Energy PLC 5,500 % fällig am 15.10.2026	3.800	3.728	0,21
Churchill Downs, Inc. 4,750 % fällig am 15.01.2028	5.000	4.779	0,27	DaVita, Inc. 4,625 % fällig am 01.06.2030	4.100	3.708	0,21	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd. 5,750 % fällig am 20.01.2026	2.825	2.691	0,15
5,500 % fällig am 01.04.2027	1.600	1.575	0,09	Delek Logistics Partners LP 8,625 % fällig am 15.03.2029	2.450	2.523	0,14	HealthEquity, Inc. 4,500 % fällig am 01.10.2029	1.800	1.685	0,10
5,750 % fällig am 01.04.2030	2.000	1.944	0,11	Directv Financing LLC 5,875 % fällig am 15.08.2027	7.000	6.590	0,38	Herc Holdings, Inc. 6,625 % fällig am 15.06.2029	1.625	1.649	0,09
6,750 % fällig am 01.05.2031	800	805	0,05	DISH DBS Corp. 5,125 % fällig am 01.06.2029	3.900	1.549	0,09	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2032	5.975	5.176	0,30
Cimpress PLC 7,000 % fällig am 15.06.2026	800	800	0,05	5,250 % fällig am 01.12.2026	5.100	4.032	0,23	3,750 % fällig am 01.05.2029	2.000	1.836	0,11
Cinemark USA, Inc. 5,250 % fällig am 15.07.2028	1.225	1.172	0,07	5,750 % fällig am 01.12.2028	2.600	1.808	0,10	4,000 % fällig am 01.05.2031	2.000	1.792	0,10
5,875 % fällig am 15.03.2026	1.435	1.421	0,08	7,375 % fällig am 01.07.2028	3.700	1.578	0,09	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 4,875 % fällig am 01.07.2031	3.000	2.658	0,15
CITGO Petroleum Corp. 8,375 % fällig am 15.01.2029	3.100	3.198	0,18	7,750 % fällig am 01.07.2026	4.100	2.549	0,15	5,000 % fällig am 01.06.2029	2.500	2.333	0,13
Civitas Resources, Inc. 8,750 % fällig am 01.07.2031	2.800	3.002	0,17	DISH Network Corp. 11,750 % fällig am 15.11.2027	3.000	2.944	0,17	Hologic, Inc. 3,250 % fällig am 15.02.2029	1.000	898	0,05
Clarivate Science Holdings Corp. 4,875 % fällig am 01.07.2029	5.000	4.645	0,27	DT Midstream, Inc. 4,125 % fällig am 15.06.2029	2.300	2.127	0,12	Howard Midstream Energy Partners LLC 7,375 % fällig am 15.07.2032	4.175	4.243	0,24
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 5,125 % fällig am 15.08.2027 (i)	2.200	2.103	0,12	4,375 % fällig am 15.06.2031	1.700	1.550	0,09	Imola Merger Corp. 4,750 % fällig am 15.05.2029	5.000	4.678	0,27
7,875 % fällig am 01.04.2030	7.300	7.354	0,42	Edgewell Personal Care Co. 4,125 % fällig am 01.04.2029	800	737	0,04	Ingevity Corp. 3,875 % fällig am 01.11.2028	5.000	4.544	0,26
Cloud Software Group, Inc. 6,500 % fällig am 31.03.2029	7.000	6.727	0,39	Element Solutions, Inc. 3,875 % fällig am 01.09.2028	1.200	1.104	0,06	Insight Enterprises, Inc. 6,625 % fällig am 15.05.2032	800	813	0,05
8,250 % fällig am 30.06.2032	5.125	5.227	0,30	Embecta Corp. 5,000 % fällig am 15.02.2030 (i)	5.900	4.865	0,28				
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. 8,750 % fällig am 15.04.2030	16.000	15.680	0,90	Emerald Borrower LP 6,750 % fällig am 15.07.2031 (a)	1.725	1.748	0,10				
CNX Midstream Partners LP 4,750 % fällig am 15.04.2030	200	180	0,01	Endo Finance Holdings, Inc. 8,500 % fällig am 15.04.2031	775	801	0,05				
CNX Resources Corp. 7,250 % fällig am 01.03.2032	1.900	1.939	0,11	EQM Midstream Partners LP 6,000 % fällig am 01.07.2025	735	736	0,04				
				6,375 % fällig am 01.04.2029	8.750	8.844	0,51				
				6,500 % fällig am 15.07.2048	3.800	3.839	0,22				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP (9,750 % bar oder 9,750 % PIK)	3.000	\$ 2.874	0,16	Molina Healthcare, Inc. 3,875 % fällig am 15.05.2032	\$ 3.025	\$ 2.624	0,15	Performance Food Group, Inc. 4,250 % fällig am 01.08.2029	\$ 3.000	\$ 2.733	0,16
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc. 6,000 % fällig am 15.09.2028	4.000	3.877	0,22	4,375 % fällig am 15.06.2028	275	259	0,01	Permian Resources Operating LLC 5,375 % fällig am 15.01.2026	3.000	2.971	0,17
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	11.249	10.494	0,60	MPH Acquisition Holdings LLC 5,500 % fällig am 01.09.2028	1.047	792	0,05	7,000 % fällig am 15.01.2032	1.800	1.850	0,11
Jazz Securities DAC 4,375 % fällig am 15.01.2029	1.000	929	0,05	5,750 % fällig am 01.11.2028	1.600	863	0,05	7,750 % fällig am 15.02.2026	425	429	0,02
Jeld-Wen, Inc. 4,875 % fällig am 15.12.2027	1.500	1.418	0,08	Murphy Oil USA, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031	1.000	882	0,05	PetSmart, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2028	1.700	1.581	0,09
Kaiser Aluminum Corp. 4,500 % fällig am 01.06.2031	1.000	887	0,05	Nabors Industries, Inc. 7,375 % fällig am 15.05.2027	1.700	1.731	0,10	Post Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 15.09.2031	2.779	2.493	0,14
4,625 % fällig am 01.03.2028	800	749	0,04	NCL Corp. Ltd. 5,875 % fällig am 15.03.2026	4.800	4.749	0,27	4,625 % fällig am 15.04.2030	9.000	8.276	0,47
Kinetik Holdings LP 6,625 % fällig am 15.12.2028	3.000	3.050	0,17	NCR Atleos Corp. 9,500 % fällig am 01.04.2029	1.975	2.136	0,12	5,625 % fällig am 15.01.2028	4.975	4.902	0,28
Kodiak Gas Services LLC 7,250 % fällig am 15.02.2029	1.400	1.436	0,08	NCR Voyix Corp. 5,000 % fällig am 01.10.2028	950	898	0,05	Prestige Brands, Inc. 3,750 % fällig am 01.04.2031	50	44	0,00
LABL, Inc. 5,875 % fällig am 01.11.2028	4.825	4.409	0,25	5,125 % fällig am 15.04.2029 (i)	2.200	2.074	0,12	Prime Security Services Borrower LLC 3,375 % fällig am 31.08.2027	2.000	1.852	0,11
6,750 % fällig am 15.07.2026	2.000	1.977	0,11	5,250 % fällig am 01.10.2030	1.200	1.098	0,06	6,250 % fällig am 15.01.2028	2.000	1.973	0,11
10,500 % fällig am 15.07.2027	1.000	980	0,06	Neptune Bidco US, Inc. 9,290 % fällig am 15.04.2029	3.775	3.627	0,21	PTC, Inc. 4,000 % fällig am 15.02.2028	1.550	1.461	0,08
Lamar Media Corp. 3,625 % fällig am 15.01.2031	275	243	0,01	NESCO Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.04.2029	2.250	2.087	0,12	Raising Cane's Restaurants LLC 9,375 % fällig am 01.05.2029	1.025	1.108	0,06
Lamb Weston Holdings, Inc. 4,125 % fällig am 31.01.2030	3.000	2.726	0,16	New Fortress Energy, Inc. 6,500 % fällig am 30.09.2026	2.450	2.256	0,13	Rakuten Group, Inc. 9,750 % fällig am 15.04.2029	1.900	1.961	0,11
4,375 % fällig am 31.01.2032	1.000	893	0,05	6,750 % fällig am 15.09.2025	584	567	0,03	11,250 % fällig am 15.02.2027	1.000	1.070	0,06
Legacy LifePoint Health LLC 4,375 % fällig am 15.02.2027	2.700	2.581	0,15	8,750 % fällig am 15.03.2029	1.300	1.188	0,07	Rand Parent LLC 8,500 % fällig am 15.02.2030	2.750	2.787	0,16
Level 3 Financing, Inc. 11,000 % fällig am 15.11.2029	606	621	0,04	Newell Brands, Inc. 6,875 % fällig am 01.04.2036	300	269	0,02	Resorts World Las Vegas LLC 4,625 % fällig am 16.04.2029	250	224	0,01
Life Time, Inc. 5,750 % fällig am 15.01.2026	600	598	0,03	Newfold Digital Holdings Group, Inc. 6,000 % fällig am 15.02.2029	9.000	6.505	0,37	8,450 % fällig am 27.07.2030	2.275	2.409	0,14
LifePoint Health, Inc. 5,375 % fällig am 15.01.2029	2.900	2.551	0,15	Nexstar Media, Inc. 5,625 % fällig am 15.07.2027	1.000	951	0,05	Reworld Holding Corp. 4,875 % fällig am 01.12.2029	750	685	0,04
10,000 % fällig am 01.06.2032	2.150	2.201	0,13	NextEra Energy Operating Partners LP 3,875 % fällig am 15.10.2026	200	190	0,01	5,000 % fällig am 01.09.2030	1.000	906	0,05
11,000 % fällig am 15.10.2030	3.800	4.191	0,24	4,500 % fällig am 15.09.2027	825	782	0,05	Ritchie Bros Holdings, Inc. 6,750 % fällig am 15.03.2028	1.250	1.274	0,07
Light & Wonder International, Inc. 7,500 % fällig am 01.09.2031	2.000	2.068	0,12	7,250 % fällig am 15.01.2029	1.700	1.745	0,10	7,750 % fällig am 15.03.2031	2.000	2.091	0,12
Lindblad Expeditions Holdings, Inc. 9,000 % fällig am 15.05.2028	3.000	3.087	0,18	Noble Finance LLC 8,000 % fällig am 15.04.2030	5.600	5.832	0,33	Rockcliff Energy LP 5,500 % fällig am 15.10.2029	6.000	5.620	0,32
Lindblad Expeditions LLC 6,750 % fällig am 15.02.2027	1.900	1.878	0,11	Nordstrom, Inc. 4,250 % fällig am 01.08.2031	1.050	936	0,05	Rockies Express Pipeline LLC 4,800 % fällig am 15.05.2030	2.000	1.848	0,11
Live Nation Entertainment, Inc. 3,750 % fällig am 15.01.2028	825	768	0,04	4,375 % fällig am 01.04.2030	1.025	933	0,05	4,950 % fällig am 15.07.2029	2.000	1.884	0,11
4,750 % fällig am 15.10.2027	1.300	1.247	0,07	5,000 % fällig am 15.01.2044	1.550	1.253	0,07	Roller Bearing Co. of America, Inc. 4,375 % fällig am 15.10.2029	700	645	0,04
Madison IAQ LLC 4,125 % fällig am 30.06.2028	2.450	2.287	0,13	Northriver Midstream Finance LP 6,750 % fällig am 15.07.2032 (a)	1.400	1.403	0,08	Royal Caribbean Cruises Ltd. 4,250 % fällig am 01.07.2026	5.000	4.843	0,28
MajorDrive Holdings LLC 6,375 % fällig am 01.06.2029	10.775	10.155	0,58	Novelis Corp. 3,250 % fällig am 15.11.2026	2.000	1.884	0,11	5,375 % fällig am 15.07.2027	3.000	2.956	0,17
Marriott Ownership Resorts, Inc. 4,500 % fällig am 15.06.2029	2.350	2.161	0,12	4,750 % fällig am 30.01.2030	3.000	2.786	0,16	5,500 % fällig am 31.08.2026	5.600	5.541	0,32
Masterbrand, Inc. 7,000 % fällig am 15.07.2032	475	481	0,03	NuStar Logistics LP 5,750 % fällig am 01.10.2025	2.000	1.989	0,11	5,500 % fällig am 01.04.2028	4.400	4.347	0,25
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,875 % fällig am 15.04.2027	3.500	3.574	0,20	6,375 % fällig am 01.10.2030	1.300	1.323	0,08	7,250 % fällig am 15.01.2030	2.000	2.072	0,12
9,250 % fällig am 15.04.2027	2.000	2.004	0,11	Olympus Water U.S. Holding Corp. 3,875 % fällig am 01.10.2028	€ 1.000	1.006	0,06	7,500 % fällig am 15.10.2027	700	738	0,04
McAfee Corp. 7,375 % fällig am 15.02.2030	6.000	5.547	0,32	4,250 % fällig am 01.10.2028	\$ 7.000	6.376	0,37	9,250 % fällig am 15.01.2029	1.000	1.068	0,06
Medline Borrower LP 3,875 % fällig am 01.04.2029	10.925	10.069	0,58	5,375 % fällig am 01.10.2029 (i)	€ 6.000	5.842	0,33	Sabre GLBL, Inc. 8,625 % fällig am 01.06.2027	2.958	2.728	0,16
5,250 % fällig am 01.10.2029	2.300	2.197	0,13	6,250 % fällig am 01.10.2029	\$ 500	457	0,03	11,250 % fällig am 15.12.2027	800	778	0,04
6,250 % fällig am 01.04.2029	1.975	2.000	0,11	7,250 % fällig am 15.06.2031	775	771	0,04	Scientific Games Holdings LP 6,625 % fällig am 01.03.2030	5.000	4.877	0,28
Merlin Entertainments Group U.S. Holdings, Inc. 7,375 % fällig am 15.02.2031	1.500	1.529	0,09	ON Semiconductor Corp. 3,875 % fällig am 01.09.2028	4.275	3.949	0,23	SCIH Salt Holdings, Inc. 4,875 % fällig am 01.05.2028	3.675	3.423	0,20
Merlin Entertainments Ltd. 5,750 % fällig am 15.06.2026	600	592	0,03	Open Text Holdings, Inc. 4,125 % fällig am 15.02.2030	3.725	3.362	0,19	Scripps Escrow, Inc. 5,375 % fällig am 15.01.2031	3.450	1.534	0,09
MGM Resorts International 6,500 % fällig am 15.04.2032	4.600	4.582	0,26	Organon & Co. 4,125 % fällig am 30.04.2028	4.800	4.462	0,26	Seadrill Finance Ltd. 8,375 % fällig am 01.08.2030	3.500	3.661	0,21
Michaels Cos., Inc. 5,250 % fällig am 01.05.2028	2.700	2.163	0,12	5,125 % fällig am 30.04.2031	6.400	5.755	0,33	Seagate HDD Cayman 5,750 % fällig am 01.12.2034	1.800	1.749	0,10
Midwest Gaming Borrower LLC 4,875 % fällig am 01.05.2029	1.300	1.212	0,07	6,750 % fällig am 15.05.2034	600	600	0,03	8,250 % fällig am 15.12.2029	1.150	1.234	0,07
Miter Brands Acquisition Holdco, Inc. 6,750 % fällig am 01.04.2032	1.450	1.461	0,08	7,875 % fällig am 15.05.2034	2.075	2.135	0,12	8,500 % fällig am 15.07.2031	1.175	1.267	0,07
				Outfront Media Capital LLC 4,250 % fällig am 15.01.2029	2.000	1.826	0,10	9,625 % fällig am 01.12.2032	2.000	2.282	0,13
				Pactiv Evergreen Group Issuer LLC 4,375 % fällig am 15.10.2028	3.000	2.804	0,16	Sealed Air Corp. 7,250 % fällig am 15.02.2031	1.505	1.551	0,09
				Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 4,000 % fällig am 15.10.2027	5.000	4.688	0,27	Sensata Technologies BV 4,000 % fällig am 15.04.2029	3.000	2.757	0,16
				Parkland Corp. 4,500 % fällig am 01.10.2029	1.500	1.374	0,08	Sensata Technologies, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031	3.300	2.879	0,17
				4,625 % fällig am 01.05.2030	2.500	2.282	0,13	Simmons Foods, Inc. 4,625 % fällig am 01.03.2029	8.000	7.042	0,40
				Perenti Finance Pty. Ltd. 7,500 % fällig am 26.04.2029	1.200	1.224	0,07	Sirius XM Radio, Inc. 3,875 % fällig am 01.09.2031	4.000	3.268	0,19
								4,000 % fällig am 15.07.2028	4.150	3.753	0,22



BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Yinson Production Financial Services Pte Ltd. 9,625 % fällig am 03.05.2029	\$ 275	\$ 274	0,01	<b>FINANZWERTE</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
		73.453	4,20	Voyager Aviation Holdings LLC (c)	833	\$ 0	0,00	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		1.535.127	87,86	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)	661.211	\$ 6.698	0,38
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				CHC Group LLC (c)	3.887	0	0,00	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (f)	1.743.573	21.658	1,24
ams-OSRAM AG 2,125 % fällig am 03.11.2027	€ 3.700	3.143	0,18	DreamWell Ltd. (c)(h)	926	8	0,00	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (f)	2.429.592	24.212	1,39
<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				Serta Simmons Bedding LLC (c)(h)	926	0	0,00				
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025	\$ 50.000	49.537	2,83			8	0,00				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>OPTIONSSCHEINE</b>							
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 3,408 % fällig am 25.01.2037	0	0	0,00	Revlon Group Holdings LLC - 28.04.2028	30.870	0	0,00				
<b>STAMMAKTIE</b>				<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>							
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	5.000	\$ 0	0,00	Summe Investmentfonds		\$ 52.568	3,01
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	167.378	236	0,01								
iHeartMedia, Inc. 'B' (c)	29.972	29	0,00	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 1.682.421	96,29				
Intelsat Emergence S.A. (h)	152.416	5.669	0,33								
		5.934	0,34								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 10.073	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (10.275)	\$ 10.073	\$ 10.073	0,58
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (10.275)	\$ 10.073	\$ 10.073	0,58

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	143	\$ (262)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2024	535	272	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	476	(379)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2024	4	2	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	115	59	0,00
				\$ (308)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (308)	(0,02)

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHÜTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.06.2028	€ 1.200	\$ 147	0,01
Newell Brands, Inc.	1,000	20.06.2028	\$ 2.275	191	0,01
				\$ 338	0,02

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-42 5-Year Index	5,000 %	20.06.2029	\$ 39.700	\$ (142)	(0,01)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>				<b>\$ 196</b>	<b>0,01</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Erhalt	SOFRI Index	k. A.	1,144 %	\$ 33.600	20.09.2024	\$ (169)	\$ 579	\$ 410	0,02

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 1.097	€ 1.006	\$ 0	\$ (18)	\$ (18)	0,00
BPS	07.2024	CAD 1.256	\$ 920	2	0	2	0,00
	07.2024	\$ 964	€ 888	0	(12)	(12)	0,00
FAR	07.2024	€ 47.268	\$ 51.482	824	0	824	0,04
MBC	07.2024	\$ 918	CAD 1.257	1	0	1	0,00
	07.2024	2.229	€ 2.055	0	(28)	(28)	0,00
	08.2024	CAD 1.256	\$ 918	0	(1)	(1)	0,00
MYI	07.2024	€ 1.455	1.554	0	(5)	(5)	0,00
	07.2024	\$ 51	£ 40	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	46.826	€ 43.705	15	0	15	0,00
	08.2024	€ 43.705	\$ 46.894	0	(15)	(15)	0,00
SSB	07.2024	386	414	0	0	0	0,00
				<b>\$ 842</b>	<b>\$ (79)</b>	<b>\$ 763</b>	<b>0,04</b>

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	€ 1.872	\$ 2.015	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	07.2024	\$ 106.032	€ 97.662	0	(1.362)	(1.362)	(0,08)
BPS	07.2024	€ 91.131	\$ 97.482	7	(194)	(187)	(0,01)
	07.2024	\$ 91.234	€ 84.273	0	(914)	(914)	(0,05)
	08.2024	96.610	90.192	194	0	194	0,01
BRC	07.2024	€ 156	\$ 167	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	\$ 355	€ 326	0	(5)	(5)	0,00
FAR	07.2024	102.875	94.454	0	(1.643)	(1.643)	(0,09)
GLM	07.2024	605	559	0	(6)	(6)	0,00
JPM	07.2024	180	168	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	€ 93.198	\$ 99.661	5	(228)	(223)	(0,01)
	07.2024	\$ 523	€ 485	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	99.531	92.945	227	0	227	0,01
RBC	07.2024	66	61	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07.2024	€ 327	\$ 350	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2024	92.977	99.616	1	(33)	(32)	0,00
	08.2024	\$ 99.690	€ 92.910	31	0	31	0,00
SSB	07.2024	1.814	1.673	0	(21)	(21)	0,00
UAG	08.2024	1.498	1.399	3	0	3	0,00
				<b>\$ 476</b>	<b>\$ (4.412)</b>	<b>\$ (3.936)</b>	<b>(0,22)</b>

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 5.166	\$ 6.533	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2024	\$ 13.111	£ 10.289	0	(105)	(105)	(0,01)
	08.2024	6.534	5.166	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2024	£ 12	\$ 15	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 155	£ 122	0	(1)	(1)	0,00
DUB	07.2024	6.793	5.324	0	(63)	(63)	0,00
MBC	07.2024	£ 5.315	\$ 6.725	6	0	6	0,00
	07.2024	\$ 89	£ 70	0	0	0	0,00
	08.2024	6.726	5.315	0	(6)	(6)	0,00
RBC	07.2024	£ 5.315	\$ 6.739	21	0	21	0,00
	08.2024	\$ 6.740	£ 5.315	0	(21)	(21)	0,00
RYL	07.2024	5	4	0	0	0	0,00
				\$ 29	\$ (198)	\$ (169)	(0,01)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (2.932)	(0,17)
Summe Anlagen						\$ 1.742.018	99,70
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 5.286	0,30
Nettovermögen						\$ 1.747.304	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.  
 (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.  
 (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.  
 (d) Nullkuponwertpapier.  
 (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (f) Mit dem Fonds verbunden.  
 (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2023: 0,28 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Allice France S.A, 11,500 % fällig am 01.02.2027	20.12.2023	\$ 855	\$ 703	0,04
DreamWell Ltd.	24.04.2024	1.317	8	0,00
Intelsat Emergence S.A.	11.02.2024 - 02.03.2022	15.552	5.669	0,33
Serta Simmons Bedding LLC	29.06.2023	1.317	0	0,00
		\$ 19.041	\$ 6.380	0,37

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 10.808 USD (31. Dezember 2023: 10.428 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 9.332 USD (31. Dezember 2023: 18.197 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.730 USD (31. Dezember 2023: 630 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 236	\$ 1.675.309	\$ 6.876	\$ 1.682.421
Investmentfonds	52.568	0	0	52.568
Pensionsgeschäfte	0	10.073	0	10.073
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(262)	(2.782)	0	(3.044)
Summen	\$ 52.542	\$ 1.682.600	\$ 6.876	\$ 1.742.018

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 305	\$ 1.765.023	\$ 5.584	\$ 1.770.912
Investmentfonds	74.138	0	0	74.138
Pensionsgeschäfte	0	912	0	912
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(934)	6.895	0	5.961
<b>Summen</b>	<b>\$ 73.509</b>	<b>\$ 1.772.830</b>	<b>\$ 5.584</b>	<b>\$ 1.851.923</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,200 %	14.06.2024	11.07.2024	\$ (1.596)	\$ (1.600)	(0,09)
BPS	5,000	22.11.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(246)	(253)	(0,01)
JPS	4,800	10.06.2024	02.08.2024	(385)	(386)	(0,02)
	5,250	14.06.2024	02.08.2024	(1.825)	(1.829)	(0,11)
	5,300	14.06.2024	02.08.2024	(3.233)	(3.241)	(0,19)
MYI	2,250	12.06.2024	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.192)	(1.279)	(0,07)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (8.588)</b>	<b>(0,49)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (1.372)	\$ 1.670	\$ 298	\$ 17	0	\$ 17
BPS	(1.022)	1.070	48	208	(310)	(102)
BRC	k. A.	k. A.	k. A.	477	(1.020)	(543)
CBK	(6)	0	(6)	(215)	300	85
DUB	(63)	0	(63)	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(819)	990	171	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(6)	0	(6)	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	410	(370)	40	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	(28)	0	(28)	(435)	330	(105)
MYI	(5)	0	(5)	253	(510)	(257)
RBC	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	(1)	0	(1)	105	0	105
SSB	(21)	0	(21)	85	0	85
UAG	3	0	3	603	(1.280)	(677)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	21,92	29,96
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	74,03	64,32
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,34	0,27
Investmentfonds	3,01	3,96
Pensionsgeschäfte	0,58	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	(0,06)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	0,32
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,17)	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,49)	(0,44)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	5,08	2,39
Unternehmensanleihen und Wechsel	87,86	89,24
Wandelanleihen & Wechsel	0,18	k. A.
US-Schatzobligationen	2,83	2,66
Non-Agency-MBS	k. A.	0,01
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,00	0,00
Stammaktien	0,34	0,25
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,00	0,00
Investmentfonds	3,01	3,96
Pensionsgeschäfte	0,58	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,02)	(0,06)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,05
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,01)	0,27
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	0,02	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,04	(0,02)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,23)	0,08
Sonstige Aktiva und Passiva	0,30	1,12
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund

BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES		
	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
B.C. Unlimited Liability Co.				2,125 % fällig am 21.02.2026	\$ 400	\$ 376	0,08	Citibank N.A.			
7,094 % fällig am 20.09.2030	\$ 500	\$ 499	0,10	2,528 % fällig am 18.11.2027	1.301	1.171	0,24	5,570 % fällig am 30.04.2034	\$ 1.750	\$ 1.779	0,36
Broadcom, Inc.				5,500 % fällig am 15.01.2026	400	397	0,08	Citigroup, Inc.			
TBD % fällig am 15.08.2025	300	299	0,06	AXIS Specialty Finance PLC				2,976 % fällig am 05.11.2030	1.600	1.426	0,29
TBD % fällig am 14.08.2026	300	299	0,06	4,000 % fällig am 06.12.2027	200	192	0,04	3,785 % fällig am 17.03.2033	200	178	0,04
Cedar Fair LP				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				4,075 % fällig am 23.04.2029	400	384	0,08
7,329 % fällig am 01.05.2031	500	500	0,10	6,750 % fällig am 05.09.2027	€ 2.300	2.569	0,52	4,412 % fällig am 31.03.2031	200	191	0,04
Charter Communications Operating LLC				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				5,449 % fällig am 11.06.2035	800	794	0,16
7,052 % fällig am 01.02.2027	87	87	0,02	4,875 % fällig am 08.02.2036	1.400	1.513	0,31	6,270 % fällig am 17.11.2033	2.000	2.096	0,42
7,302 % - 7,312 % fällig am 07.12.2030	498	492	0,10	Banco Daycoval S.A.				Citizens Bank N.A.			
Chromalloy Corp.				4,250 % fällig am 13.12.2024	\$ 1.200	1.188	0,24	5,284 % fällig am 26.01.2026	500	497	0,10
9,058 % fällig am 27.03.2031	300	301	0,06	Banco Mercantil del Norte S.A.				CNA Financial Corp.			
Concentra, Inc.				6,750 % fällig am 27.09.2024 (e)(g)	500	498	0,10	5,125 % fällig am 15.02.2034	700	678	0,14
TBD % fällig am 26.06.2031	200	201	0,04	Bank of America Corp.				Commonwealth Bank of Australia			
Cotiviti Corp.				1,898 % fällig am 23.07.2031	3.500	2.884	0,58	3,784 % fällig am 14.03.2032 (g)	400	350	0,07
8,579 % fällig am 01.05.2031	698	697	0,14	2,687 % fällig am 22.04.2032	2.200	1.860	0,38	Cooperative Rabobank UA			
Modena Buyer LLC				3,194 % fällig am 23.07.2030	1.800	1.635	0,33	5,447 % fällig am 05.03.2030	700	700	0,14
TBD % fällig am 18.04.2031	200	195	0,04	3,705 % fällig am 24.04.2028	600	575	0,12	COPT Defense Properties LP			
Ontario Gaming GTA LP				3,824 % fällig am 20.01.2028	100	96	0,02	2,250 % fällig am 15.03.2026	300	283	0,06
9,585 % fällig am 01.08.2030	199	200	0,04	4,300 % fällig am 28.01.2025 (e)	900	885	0,18	2,750 % fällig am 15.04.2031	1.400	1.158	0,23
Station Casinos LLC				4,376 % fällig am 27.04.2028	800	781	0,16	Credit Acceptance Corp.			
7,594 % fällig am 14.03.2031	200	200	0,04	4,948 % fällig am 22.07.2028	800	794	0,16	9,250 % fällig am 15.12.2028	200	212	0,04
				5,288 % fällig am 25.04.2034	3.700	3.663	0,74	Crown Castle, Inc.			
				Bank of America N.A.				2,100 % fällig am 01.04.2031	500	405	0,08
				5,526 % fällig am 18.08.2026	100	101	0,02	2,500 % fällig am 15.07.2031	500	413	0,08
				Barclays PLC				3,100 % fällig am 15.11.2029	900	804	0,16
				4,972 % fällig am 16.05.2029	500	490	0,10	4,300 % fällig am 15.02.2029	600	573	0,12
				5,304 % fällig am 09.08.2026	400	397	0,08	DBS Bank Ltd.			
				5,690 % fällig am 12.03.2030	1.400	1.404	0,28	3,209 % fällig am 19.08.2026	€ 1.000	1.070	0,22
				5,851 % fällig am 21.03.2035	€ 1.300	1.644	0,33	Deutsche Bank AG			
				6,036 % fällig am 12.03.2055	\$ 900	913	0,19	3,375 % fällig am 13.03.2029	1.500	1.622	0,33
				6,692 % fällig am 13.09.2034	300	318	0,06	Discover Financial Services			
				BGC Group, Inc.				4,500 % fällig am 30.01.2026	\$ 500	490	0,10
				4,375 % fällig am 15.12.2025	1.100	1.071	0,22	DOC DR LLC			
				Blackstone Holdings Finance Co. LLC				4,300 % fällig am 15.03.2027	300	294	0,06
				2,000 % fällig am 30.01.2032	200	158	0,03	Encore Capital Group, Inc.			
				Blackstone Secured Lending Fund				8,500 % fällig am 15.05.2030	100	102	0,02
				5,875 % fällig am 15.11.2027	500	497	0,10	EPR Properties			
				Block Financial LLC				3,600 % fällig am 15.11.2031	100	83	0,02
				3,875 % fällig am 15.08.2030	1.500	1.376	0,28	4,500 % fällig am 01.06.2027	450	431	0,09
				Blue Owl Capital Corp.				4,750 % fällig am 15.12.2026	100	97	0,02
				2,875 % fällig am 11.06.2028	200	177	0,04	4,950 % fällig am 15.04.2028	500	479	0,10
				Blue Owl Finance LLC				Equitable Financial Life Global Funding			
				6,250 % fällig am 18.04.2034	800	803	0,16	5,500 % fällig am 02.12.2025	2.100	2.099	0,43
				BNP Paribas S.A.				Equitable Holdings, Inc.			
				1,904 % fällig am 30.09.2028	200	179	0,04	5,594 % fällig am 11.01.2033	200	203	0,04
				7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(g)	700	708	0,14	ERP Operating LP			
				8,500 % fällig am 14.08.2028 (e)(g)	500	513	0,10	3,250 % fällig am 01.08.2027	100	95	0,02
				BPCE S.A.				Essex Portfolio LP			
				5,716 % fällig am 18.01.2030	250	250	0,05	5,500 % fällig am 01.04.2034	300	297	0,06
				6,612 % fällig am 19.10.2027	500	508	0,10	Extra Space Storage LP			
				Brandywine Operating Partnership LP				2,350 % fällig am 15.03.2032	400	319	0,06
				3,950 % fällig am 15.11.2027	500	454	0,09	3,875 % fällig am 15.12.2027	800	764	0,16
				Brixmor Operating Partnership LP				F&G Annuities & Life, Inc.			
				5,500 % fällig am 15.02.2034	200	197	0,04	6,500 % fällig am 04.06.2029	400	399	0,08
				Brookfield Finance, Inc.				Fairfax Financial Holdings Ltd.			
				3,500 % fällig am 30.03.2051	400	277	0,06	2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 200	205	0,04
				3,900 % fällig am 25.01.2028	1.400	1.337	0,27	4,625 % fällig am 29.04.2030	\$ 900	859	0,17
				CaixaBank S.A.				4,850 % fällig am 17.04.2028	300	295	0,06
				5,673 % fällig am 15.03.2030	200	199	0,04	Federal Realty OP LP			
				Cantor Fitzgerald LP				3,500 % fällig am 01.06.2030	400	363	0,07
				7,200 % fällig am 12.12.2028	800	823	0,17	Fifth Third Bancorp			
				Capital One Financial Corp.				4,772 % fällig am 28.07.2030	800	770	0,16
				5,700 % fällig am 01.02.2030	700	703	0,14	Ford Motor Credit Co. LLC			
				6,312 % fällig am 08.06.2029	400	409	0,08	4,125 % fällig am 17.08.2027	1.775	1.687	0,34
				Carlyle Finance Subsidiary LLC				Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			
				3,500 % fällig am 19.09.2029	1.900	1.757	0,36	7,875 % fällig am 01.12.2030	300	314	0,06
				Cathaylife Singapore Pte Ltd.				Freedom Mortgage Holdings LLC			
				5,950 % fällig am 05.07.2034 (a)	200	201	0,04	9,250 % fällig am 01.02.2029	300	300	0,06
				CBRE Services, Inc.				FS KKR Capital Corp.			
				5,950 % fällig am 15.08.2034	300	304	0,06	6,875 % fällig am 15.08.2029	400	397	0,08
				Charles Schwab Corp.				7,875 % fällig am 15.01.2029	700	723	0,15
				5,643 % fällig am 19.05.2029	800	811	0,16	Gaci First Investment Co.			
				6,196 % fällig am 17.11.2029	1.100	1.144	0,23	5,125 % fällig am 14.02.2053	600	520	0,11
				CI Financial Corp.				GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.			
				7,500 % fällig am 30.05.2029	600	595	0,12	3,400 % fällig am 30.09.2026	500	479	0,10

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Global Atlantic Fin Co. 3,125 % fällig am 15.06.2031 \$	200	\$ 166	0,03	Kilroy Realty LP 3,050 % fällig am 15.02.2030 \$	1.800	\$ 1.519	0,31	Retail Opportunity Investments Partnership LP 6,750 % fällig am 15.10.2028 \$	200	\$ 207	0,04
4,400 % fällig am 15.10.2029	800	746	0,15	KKR Group Finance Co. LLC 3,625 % fällig am 25.02.2050	1.100	784	0,16	RGA Global Funding 5,500 % fällig am 11.01.2031	100	100	0,02
7,950 % fällig am 15.10.2054	100	101	0,02	Lazard Group LLC 3,625 % fällig am 01.03.2027	100	96	0,02	6,000 % fällig am 21.11.2028	700	721	0,15
GLP Capital LP 3,350 % fällig am 01.09.2024	700	698	0,14	4,500 % fällig am 19.09.2028	200	193	0,04	Rocket Mortgage LLC 2,875 % fällig am 15.10.2026	200	187	0,04
4,000 % fällig am 15.01.2031	300	269	0,05	6,000 % fällig am 15.03.2031	100	101	0,02	Safehold GL Holdings LLC 6,100 % fällig am 01.04.2034	300	296	0,06
5,750 % fällig am 01.06.2028	700	701	0,14	Legg Mason, Inc. 5,625 % fällig am 15.01.2044	200	194	0,04	Sagax AB 2,250 % fällig am 13.03.2025 €	300	317	0,06
Goldman Sachs Group, Inc. 2,383 % fällig am 21.07.2032	1.500	1.232	0,25	Lloyds Bank PLC 0,000 % fällig am 02.04.2032	200	131	0,03	Sammons Financial Group, Inc. 6,875 % fällig am 15.04.2034 \$	700	718	0,15
2,615 % fällig am 22.04.2032	1.200	1.009	0,20	Lloyds Banking Group PLC 4,976 % fällig am 11.08.2033	200	191	0,04	Santander Holdings USA, Inc. 4,400 % fällig am 13.07.2027	400	387	0,08
3,691 % fällig am 05.06.2028	655	627	0,13	5,679 % fällig am 05.01.2035	800	797	0,16	6,499 % fällig am 09.03.2029	600	611	0,12
5,798 % fällig am 10.08.2026	500	500	0,10	5,985 % fällig am 07.08.2027	1.000	1.006	0,20	Santander UK Group Holdings PLC 1,532 % fällig am 21.08.2026	1.700	1.618	0,33
6,484 % fällig am 24.10.2029	1.800	1.880	0,38	Lseg U.S. Fin Corp. 5,297 % fällig am 28.03.2034	500	499	0,10	Santander UK PLC 3,000 % fällig am 12.03.2029 €	1.000	1.063	0,22
Golub Capital BDC, Inc. 7,050 % fällig am 05.12.2028	200	204	0,04	Main Street Capital Corp. 6,950 % fällig am 01.03.2029	200	202	0,04	SBA Tower Trust 1,884 % fällig am 15.07.2050 \$	1.000	941	0,19
Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % fällig am 15.03.2028	1.600	1.500	0,30	Marsh & McLennan Cos., Inc. 5,700 % fällig am 15.09.2053	600	607	0,12	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	2.100	126	0,03
Great-West Lifeco Finance LP 4,581 % fällig am 17.05.2048	300	255	0,05	Maybank Singapore Ltd. 3,439 % fällig am 07.06.2027 €	1.000	1.077	0,22	5,250 % fällig am 23.05.2023 ^ (g)	600	36	0,01
Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital, Inc. 6,375 % fällig am 01.07.2034 (a)	100	98	0,02	Mid-America Apartments LP 1,100 % fällig am 15.09.2026 \$	1.200	1.097	0,22	SBL Holdings, Inc. 5,125 % fällig am 13.11.2026	1.000	963	0,20
Hanover Insurance Group, Inc. 4,500 % fällig am 15.04.2026	800	786	0,16	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,309 % fällig am 20.07.2032	2.600	2.139	0,43	SELF Finance SARL 3,750 % fällig am 10.08.2027 €	300	320	0,07
HAT Holdings LLC 8,000 % fällig am 15.06.2027	400	416	0,08	5,133 % fällig am 20.07.2033	900	887	0,18	Sixth Street Lending Partners 6,500 % fällig am 11.03.2029 \$	1.000	989	0,20
Highwoods Realty LP 4,125 % fällig am 15.03.2028	500	468	0,10	5,406 % fällig am 19.04.2034	300	302	0,06	SLM Corp. 3,125 % fällig am 02.11.2026	500	466	0,09
4,200 % fällig am 15.04.2029	200	183	0,04	5,441 % fällig am 22.02.2034	300	303	0,06	Standard Chartered PLC 3,265 % fällig am 18.02.2036	200	168	0,03
Host Hotels & Resorts LP 3,500 % fällig am 15.09.2030	1.300	1.149	0,23	Mizuho Financial Group, Inc. 3,153 % fällig am 16.07.2030	1.873	1.687	0,34	Stifel Financial Corp. 4,000 % fällig am 15.05.2030	600	553	0,11
4,000 % fällig am 15.06.2025	1.233	1.213	0,25	Morgan Stanley 4,889 % fällig am 20.07.2033	1.400	1.350	0,27	Store Capital LLC 4,500 % fällig am 15.03.2028	200	190	0,04
HPS Corporate Lending Fund 6,250 % fällig am 30.09.2029	800	791	0,16	5,250 % fällig am 21.04.2034	4.100	4.038	0,82	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 3,202 % fällig am 17.09.2029 (g)	700	636	0,13
6,750 % fällig am 30.01.2029	200	202	0,04	5,831 % fällig am 19.04.2035	1.000	1.025	0,21	Synchrony Financial 7,250 % fällig am 02.02.2033	1.200	1.194	0,24
HSBC Capital Funding Dollar LP 10,176 % fällig am 30.06.2030 (e)	400	485	0,10	6,407 % fällig am 01.11.2029	1.700	1.774	0,36	TP ICAP Finance PLC 5,250 % fällig am 29.05.2026 £	400	500	0,10
HSBC Holdings PLC 2,099 % fällig am 04.06.2026	900	870	0,18	Morgan Stanley Direct Lending Fund 6,150 % fällig am 17.05.2029	400	391	0,08	Truist Financial Corp. 7,161 % fällig am 30.10.2029 \$	900	956	0,19
4,583 % fällig am 19.06.2029	400	387	0,08	Mutual of Omaha Cos. Global Funding 5,350 % fällig am 09.04.2027	300	300	0,06	Trust Fibr Uno 7,375 % fällig am 13.02.2034	400	395	0,08
5,402 % fällig am 11.08.2033	900	891	0,18	5,450 % fällig am 12.12.2028	400	402	0,08	U.S. Bancorp 6,787 % fällig am 26.10.2027	1.250	1.287	0,26
5,719 % fällig am 04.03.2035	200	201	0,04	Nationwide Building Society 6,557 % fällig am 18.10.2027	1.100	1.123	0,23	UBS AG 7,500 % fällig am 15.02.2028	700	749	0,15
6,500 % fällig am 15.09.2037	100	102	0,02	NatWest Group PLC 4,892 % fällig am 18.05.2029	1.500	1.467	0,30	UBS Group AG 2,593 % fällig am 11.09.2025	400	397	0,08
6,800 % fällig am 01.06.2038	220	233	0,05	5,778 % fällig am 01.03.2035	1.100	1.104	0,22	2,126 % fällig am 13.08.2030	900	808	0,16
7,390 % fällig am 03.11.2028	1.175	1.243	0,25	4,500 % fällig am 15.03.2027	1.000	962	0,20	4,282 % fällig am 09.01.2028	1.250	1.199	0,24
Hudson Pacific Properties LP 4,650 % fällig am 01.04.2029	200	154	0,03	Newmark Group, Inc. 7,500 % fällig am 12.01.2029	500	514	0,10	5,959 % fällig am 12.01.2034	1.400	1.422	0,29
5,950 % fällig am 15.02.2028	500	426	0,09	Nippon Life Insurance Co. 6,250 % fällig am 13.09.2053	200	206	0,04	6,537 % fällig am 12.08.2033	2.750	2.887	0,58
Huntington Bancshares, Inc. 6,208 % fällig am 21.08.2029	400	408	0,08	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,750 % fällig am 09.03.2028	1.900	1.695	0,34	9,250 % fällig am 13.11.2033 (e)(g)	200	224	0,05
IHG Finance LLC 4,375 % fällig am 28.11.2029 €	500	549	0,11	Nomura Holdings, Inc. 2,679 % fällig am 16.07.2030	1.300	1.107	0,22	UDR, Inc. 3,100 % fällig am 01.11.2034	300	242	0,05
ING Groep NV 8,000 % fällig am 16.05.2030 (e)(g)	\$ 900	919	0,19	5,594 % fällig am 02.07.2027 (a)	1.000	1.001	0,20	3,500 % fällig am 15.01.2028	300	283	0,06
Intesa Sanpaolo SpA 6,625 % fällig am 20.06.2033	200	206	0,04	6,580 % fällig am 02.07.2027 (a)	500	503	0,10	Unum Group 6,000 % fällig am 15.06.2054	100	96	0,02
7,200 % fällig am 28.11.2033	200	214	0,04	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2052	DKK 9.029	1.024	0,21	VICI Properties LP 3,875 % fällig am 15.02.2029	300	278	0,06
7,800 % fällig am 28.11.2053	900	991	0,20	Omega Healthcare Investors, Inc. 4,750 % fällig am 15.01.2028 \$	800	775	0,16	4,125 % fällig am 15.08.2030	100	91	0,02
Invitation Homes Operating Partnership LP 2,300 % fällig am 15.11.2028	1.300	1.152	0,23	OneMain Finance Corp. 7,875 % fällig am 15.03.2030	500	516	0,10	4,500 % fällig am 15.01.2028	100	96	0,02
JAB Holdings BV 2,200 % fällig am 23.11.2030	535	431	0,09	Pacific Life Global Funding 1,375 % fällig am 14.04.2026	2.600	2.430	0,49	5,125 % fällig am 15.05.2032	800	763	0,15
Jefferies Financial Group, Inc. 5,875 % fällig am 21.07.2028	600	606	0,12	Phillips Edison Grocery Center Operating Partnership LP 5,750 % fällig am 15.07.2034	300	296	0,06	5,750 % fällig am 01.02.2027	100	100	0,02
JPMorgan Chase & Co. 2,182 % fällig am 01.06.2028	700	643	0,13	Piedmont Operating Partnership LP 6,875 % fällig am 15.07.2029	700	692	0,14	Vonovia SE 0,000 % fällig am 01.12.2025 (b)	€ 1.200	1.217	0,25
2,545 % fällig am 08.11.2032	900	750	0,15	Protective Life Global Funding 1,170 % fällig am 15.07.2025	2.300	2.201	0,45	Wells Fargo & Co. 2,393 % fällig am 02.06.2028 \$	1.000	921	0,19
2,580 % fällig am 22.04.2032	5.100	4.309	0,88	Realty Income Corp. 3,200 % fällig am 15.02.2031	100	88	0,02				
2,947 % fällig am 24.02.2028	466	439	0,09	4,000 % fällig am 15.07.2029	200	189	0,04				
3,509 % fällig am 23.01.2029	1.505	1.424	0,29								
3,782 % fällig am 01.02.2028	40	39	0,01								
4,000 % fällig am 01.04.2025 (e)	2.900	2.825	0,57								
5,350 % fällig am 01.06.2034	800	797	0,16								
5,766 % fällig am 22.04.2035	1.000	1.026	0,21								
6,087 % fällig am 23.10.2029	500	517	0,10								
JPMorgan Chase Bank N.A. 5,110 % fällig am 08.12.2026	900	900	0,18								

**Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)**

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
2,406 % fällig am 30.10.2025	\$ 300	\$ 297	0,06	Booz Allen Hamilton, Inc.				Ecopetrol S.A.			
3,196 % fällig am 17.06.2027	4.400	4.214	0,85	5,950 % fällig am 04.08.2033	\$ 100	\$ 103	0,02	8,875 % fällig am 13.01.2033	\$ 300	\$ 310	0,06
4,897 % fällig am 25.07.2033	2.100	2.021	0,41	Boston Scientific Corp.				Elevance Health, Inc.			
5,557 % fällig am 25.07.2034	100	100	0,02	2,650 % fällig am 01.06.2030	100	88	0,02	4,750 % fällig am 15.02.2033	1.800	1.739	0,35
6,428 % fällig am 22.04.2028	1.900	1.910	0,39	Bristol-Myers Squibb Co.				Enbridge, Inc.			
6,491 % fällig am 23.10.2034	700	747	0,15	5,200 % fällig am 22.02.2034	1.300	1.298	0,26	5,250 % fällig am 05.04.2027	400	400	0,08
Weyerhaeuser Co.				British Airways Pass-Through Trust				Energy Transfer LP			
4,000 % fällig am 15.04.2030	1.300	1.214	0,25	4,125 % fällig am 20.03.2033	242	226	0,05	4,400 % fällig am 15.03.2027	1.400	1.366	0,28
4,750 % fällig am 15.05.2026	600	593	0,12	4,250 % fällig am 15.05.2034	193	181	0,04	5,750 % fällig am 15.02.2033	1.000	1.011	0,20
7,375 % fällig am 15.03.2032	343	384	0,08	Broadcom, Inc.				5,950 % fällig am 01.10.2043	100	97	0,02
		214.622	43,47	2,600 % fällig am 15.02.2033	400	324	0,07	5,950 % fällig am 15.05.2054	1.400	1.364	0,28
				3,469 % fällig am 15.04.2034	569	485	0,10	6,050 % fällig am 01.12.2026	300	304	0,06
				Burlington Northern Santa Fe LLC				6,500 % fällig am 01.02.2042	100	104	0,02
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				5,200 % fällig am 15.04.2054	100	96	0,02	Eni SpA			
<b>AbbVie, Inc.</b>				Cameron LNG LLC				5,950 % fällig am 15.05.2054	400	393	0,08
4,250 % fällig am 21.11.2049	200	167	0,03	3,302 % fällig am 15.01.2035	1.400	1.153	0,23	EnLink Midstream LLC			
4,850 % fällig am 15.06.2044	800	741	0,15	Canadian Natural Resources Ltd.				6,500 % fällig am 01.09.2030	700	717	0,15
5,500 % fällig am 15.03.2064	900	889	0,18	6,250 % fällig am 15.03.2038	200	205	0,04	Enterprise Products Operating LLC			
Adani Transmission Step-One Ltd.				6,450 % fällig am 30.06.2033	100	105	0,02	5,350 % fällig am 15.03.2034	100	99	0,02
4,000 % fällig am 03.08.2026	400	379	0,08	Canadian Pacific Railway Co.				Enterprise Products Operating LLC			
Adventist Health System				3,125 % fällig am 01.06.2026	300	287	0,06	2,800 % fällig am 31.01.2030	1.000	894	0,18
5,430 % fällig am 01.03.2032	300	297	0,06	Carnival Corp.				2,800 % fällig am 15.02.2042	300	300	0,06
Air Canada Pass-Through Trust				4,000 % fällig am 01.08.2028	500	470	0,10	EQM Midstream Partners LP			
3,300 % fällig am 15.07.2031	718	658	0,13	7,000 % fällig am 15.08.2029	200	207	0,04	6,375 % fällig am 01.04.2029	200	202	0,04
3,750 % fällig am 15.06.2029	123	116	0,02	CDW LLC				EQT Corp.			
5,250 % fällig am 01.10.2030	229	226	0,05	3,569 % fällig am 01.12.2031	900	787	0,16	5,750 % fällig am 01.02.2034	300	298	0,06
Alaska Airlines Pass-Through Trust				Centene Corp.				Equifax, Inc.			
4,800 % fällig am 15.02.2029	581	570	0,12	2,450 % fällig am 15.07.2028	1.100	977	0,20	5,100 % fällig am 01.06.2028	500	498	0,10
Alcon Finance Corp.				Charter Communications Operating LLC				Essent Group Ltd.			
2,600 % fällig am 27.05.2030	500	436	0,09	4,200 % fällig am 15.03.2028	1.300	1.229	0,25	6,250 % fällig am 01.07.2029	200	200	0,04
Allegion U.S. Holding Co., Inc.				6,150 % fällig am 10.11.2026	1.600	1.616	0,33	(a)			
3,550 % fällig am 01.10.2027	1.100	1.043	0,21	Cheniere Energy Partners LP				Ferguson Finance PLC			
Amdocs Ltd.				3,250 % fällig am 31.01.2032	600	513	0,10	3,250 % fällig am 02.06.2030	300	271	0,05
2,538 % fällig am 15.06.2030	1.600	1.366	0,28	4,000 % fällig am 01.03.2031	2.000	1.820	0,37	Flex Ltd.			
American Airlines Pass-Through Trust				5,750 % fällig am 15.08.2034	300	301	0,06	4,750 % fällig am 15.06.2025	300	297	0,06
3,200 % fällig am 15.12.2029	587	545	0,11	5,950 % fällig am 30.06.2033	600	609	0,12	Fox Corp.			
3,250 % fällig am 15.04.2030	648	590	0,12	Cheniere Energy, Inc.				6,500 % fällig am 13.10.2033	100	105	0,02
3,375 % fällig am 01.11.2028	330	312	0,06	4,625 % fällig am 15.10.2028	800	777	0,16	Gatewick Funding Ltd.			
3,500 % fällig am 15.08.2033	391	344	0,07	Choice Hotels International, Inc.				6,125 % fällig am 02.03.2028	£ 200	256	0,05
3,575 % fällig am 15.07.2029	129	122	0,02	5,850 % fällig am 01.08.2034 (a)	100	99	0,02	Glencore Funding LLC			
3,600 % fällig am 15.04.2031	203	184	0,04	Cigna Group				5,400 % fällig am 08.05.2028	\$ 400	400	0,08
4,000 % fällig am 15.01.2027	0	0	0,00	4,375 % fällig am 15.10.2028	1.400	1.360	0,28	Global Payments, Inc.			
Amgen, Inc.				Coastal Gaslink Pipeline LP				2,900 % fällig am 15.05.2030	600	523	0,11
5,250 % fällig am 02.03.2033	500	499	0,10	5,606 % fällig am 30.03.2047CAD	1.000	769	0,16	5,400 % fällig am 15.08.2032	300	294	0,06
5,600 % fällig am 02.03.2043	3.075	3.033	0,61	Comcast Corp.				Greene King Finance PLC			
Apple, Inc.				5,500 % fällig am 15.05.2064	\$ 500	481	0,10	5,318 % fällig am 15.09.2031	£ 102	126	0,03
4,850 % fällig am 10.05.2053	2.100	2.032	0,41	ConocoPhillips Co.				Greensaf Pipelines Bidco SARL			
Ashtead Capital, Inc.				5,550 % fällig am 15.03.2054	300	295	0,06	6,129 % fällig am 23.02.2038	\$ 300	305	0,06
4,000 % fällig am 01.05.2028	400	378	0,08	Constellation Brands, Inc.				GXO Logistics, Inc.			
5,800 % fällig am 15.04.2034	200	199	0,04	4,900 % fällig am 01.05.2033	1.000	966	0,20	6,250 % fällig am 06.05.2029	500	509	0,10
Astrazeneca Finance LLC				Continental Airlines Pass-Through Trust				Haleon U.S. Capital LLC			
5,000 % fällig am 26.02.2034	600	597	0,12	4,000 % fällig am 29.04.2026	191	191	0,04	3,375 % fällig am 24.03.2029	2.400	2.229	0,45
Astrazeneca PLC				Continental Resources, Inc.				3,625 % fällig am 24.03.2032	750	672	0,14
4,000 % fällig am 17.01.2029	500	482	0,10	5,750 % fällig am 15.01.2031	400	394	0,08	HCA, Inc.			
Bacardi Ltd.				Coterra Energy, Inc.				3,500 % fällig am 01.09.2030	1.000	902	0,18
4,700 % fällig am 15.05.2028	200	195	0,04	5,600 % fällig am 15.03.2034	500	499	0,10	3,500 % fällig am 15.07.2051	700	468	0,09
5,250 % fällig am 15.01.2029	1.100	1.086	0,22	CVS Health Corp.				5,500 % fällig am 01.06.2033	900	893	0,18
BAE Systems PLC				1,300 % fällig am 21.08.2027	500	443	0,09	5,625 % fällig am 01.09.2028	200	202	0,04
3,400 % fällig am 15.04.2030	200	181	0,04	4,125 % fällig am 01.04.2040	900	728	0,15	Health & Happiness International Holdings Ltd.			
Baptist Healthcare System Obligated Group				5,125 % fällig am 21.02.2030	1.500	1.484	0,30	13,500 % fällig am 26.06.2026	600	639	0,13
3,540 % fällig am 15.08.2050	300	219	0,04	CVS Pass-Through Trust				Howard Midstream Energy Partners LLC			
Bayer U.S. Finance LLC				5,789 % fällig am 10.01.2026	23	23	0,00	8,875 % fällig am 15.07.2028	200	212	0,04
4,250 % fällig am 15.12.2025	1.100	1.077	0,22	6,036 % fällig am 10.12.2028	110	111	0,02	Humana, Inc.			
6,125 % fällig am 21.11.2026	400	404	0,08	Dell International LLC				5,875 % fällig am 01.03.2033	800	814	0,16
6,375 % fällig am 21.11.2030	200	205	0,04	6,200 % fällig am 15.07.2030	400	420	0,09	Hyundai Capital America			
6,500 % fällig am 21.11.2033	600	614	0,12	Delta Air Lines Pass-Through Trust				6,512 % fällig am 04.08.2025	300	301	0,06
Becton Dickinson & Co.				2,000 % fällig am 10.12.2029	837	761	0,15	Illumina, Inc.			
3,828 % fällig am 07.06.2032	€ 300	323	0,07	Delta Air Lines, Inc.				5,750 % fällig am 13.12.2027	900	909	0,18
5,081 % fällig am 07.06.2029	\$ 800	799	0,16	3,750 % fällig am 28.10.2029	200	185	0,04	Imperial Brands Finance PLC			
5,110 % fällig am 08.02.2034	500	493	0,10	Directv Financing LLC				4,250 % fällig am 21.07.2025	500	493	0,10
Berry Global, Inc.				5,875 % fällig am 15.08.2027	1.100	1.036	0,21	Infor, Inc.			
1,570 % fällig am 15.01.2026	1.500	1.410	0,29	Dyno Nobel Finance LLC				1,750 % fällig am 15.07.2025	600	575	0,12
Boeing Co.				3,950 % fällig am 03.08.2027	500	477	0,10	Intel Corp.			
2,196 % fällig am 04.02.2026	100	94	0,02	Eastern Gas Transmission & Storage, Inc.				5,200 % fällig am 10.02.2033	1.200	1.199	0,24
5,805 % fällig am 01.05.2050	100	90	0,02	3,900 % fällig am 15.11.2049	2.300	1.630	0,33	IRB Infrastructure Developers Ltd.			
5,930 % fällig am 01.05.2060	700	626	0,13					7,110 % fällig am 11.03.2032	400	400	0,08
6,259 % fällig am 01.05.2027	400	403	0,08								
6,298 % fällig am 01.05.2029	100	101	0,02								
7,008 % fällig am 01.05.2064	1.200	1.230	0,25								





BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	AKTIEN	% DES		BESCHREIBUNG	AKTIEN	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
Peru Government International Bond 6,900 % fällig am 12.08.2037 PEN	600	\$ 150	0,03	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
6,950 % fällig am 12.08.2031	300	80	0,02	Wells Fargo & Co. 4,250 % fällig am 15.09.2026 (e)	40.800	\$ 766	0,16	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,800 % fällig am 23.06.2030	\$ 300	263	0,05					PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	660.075	\$ 6.578	1,33
Romania Government International Bond 3,750 % fällig am 07.02.2034	€ 400	368	0,08	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
5,625 % fällig am 22.02.2036	400	419	0,09	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>							
5,625 % fällig am 30.05.2037	400	414	0,08	TER Finance Jersey Ltd. 7,020 % fällig am 02.01.2025 (b)(c)	\$ 500	482	0,10	Summe Investmentfonds		\$ 6.578	1,33
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 16.01.2030	\$ 1.400	1.377	0,28	Summe kurzfristige Instrumente		482	0,10				
United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054	£ 1.530	1.845	0,37	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 550.835	111,54				
		10.989	2,22								

**PENSIONS-GESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,600 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 2.068	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	\$ (2.109)	\$ 2.068	\$ 2.068	0,42
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (2.109)	\$ 2.068	\$ 2.068	0,42

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2024	2	\$ 1	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	198	(28)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2024	189	123	0,02
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2024	258	180	0,04
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2024	11	(4)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2024	86	51	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2024	25	(10)	0,00
				\$ 313	0,06
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 313	0,06

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus SE	1,000 %	20.12.2028	€ 200	\$ 3	0,00
Airbus SE	1,000	20.06.2029	300	0	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2026	\$ 500	(2)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	900	(2)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	1.000	26	0,01
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	200	4	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	4	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	2.900	159	0,03
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 700	(5)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	400	(4)	0,00
Cellnex Telecom S.A.	5,000	20.12.2030	400	85	0,02
Devon Energy Corp.	1,000	20.12.2026	\$ 800	17	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.12.2026	900	4	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	1.600	(9)	0,00
Expedia Group, Inc.	1,000	20.12.2026	300	2	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	1.300	(119)	(0,03)
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.200	9	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	200	2	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	710	(65)	(0,01)
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	890	28	0,01
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2031	€ 300	(3)	0,00
Hess Corp.	1,000	20.12.2026	\$ 1.200	29	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
MetLife, Inc.	1,000 %	20.12.2024	\$ 1.400	\$ (29)	(0,01)
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	1,000	20.12.2026	200	(1)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 1.600	230	0,05
Southwest Airlines Co.	1,000	20.12.2026	\$ 550	7	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	€ 1.000	(18)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	1.050	23	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	100	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 1.200	(12)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	1.800	(17)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	1.100	20	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2028	300	6	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	€ 1.600	7	0,00
				\$ 381	0,08

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-41 5-Year Index	1,000 %	20.12.2028	\$ 4.200	\$ 10	0,00
CDX.IG-42 5-Year Index	1,000	20.06.2029	74.800	(86)	(0,02)
				\$ (76)	(0,02)

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,700 %	28.03.2034	£ 200	\$ 6	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	18.09.2034	500	13	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	18.09.2029	2.200	(8)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.03.2028	¥ 199.900	58	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,000	18.12.2025	\$ 4.400	66	0,01
Erhalt	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3,500	20.06.2054	6.400	131	0,03
Zahlung	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4,500	18.07.2024	11.200	(7)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,815	04.01.2027	BRL 10.800	(76)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,832	04.01.2027	9.800	(68)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,835	04.01.2027	17.000	(117)	(0,03)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Year BRL-CDI	9,842	04.01.2027	2.400	(17)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033	AUD 4.300	36	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.03.2034	4.500	33	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 3.850	1.750	0,35
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	18.09.2054	2.700	101	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	05.03.2034	300	(2)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	18.09.2034	5.100	(65)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,920	13.12.2028	300	(4)	0,00
					\$ 1.830	0,37
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 2.135 0,43</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,725 %	14.11.2024	8.100	\$ 0	\$ 4	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,749	13.11.2024	12.600	0	6	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,754	15.11.2024	5.400	0	3	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,765	18.11.2024	4.500	0	2	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	20.11.2024	5.400	0	4	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,800	17.12.2024	4.500	0	4	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,820	21.11.2024	5.400	0	4	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,840	05.12.2024	6.300	0	6	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,850	22.11.2024	4.500	0	3	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900 %	09.12.2024	6.300	\$ 0	\$ 7	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,900	13.12.2024	6.300	0	8	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,920	25.11.2024	5.400	0	5	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,920	03.12.2024	4.500	0	5	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	29.11.2024	10.800	0	12	0,01
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,930	11.12.2024	6.300	0	8	0,01
							\$ 0	\$ 81	0,02

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800 %	08.07.2024	400	\$ (2)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,350	08.07.2024	400	(2)	0	0,00
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,700	04.07.2024	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,000	04.07.2024	500	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,700	05.07.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,070	05.07.2024	300	(1)	0	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,710	26.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,060	26.07.2024	300	(1)	(2)	0,00
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,689	15.07.2024	800	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,139	15.07.2024	800	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,540	24.07.2024	400	(2)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,628	18.07.2024	800	(3)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,648	24.07.2024	800	(3)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,680	22.07.2024	400	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,844	03.07.2024	600	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,880	08.07.2024	800	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,978	18.07.2024	800	(3)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,998	24.07.2024	800	(3)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	24.07.2024	400	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,030	22.07.2024	400	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,194	03.07.2024	600	(2)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,230	08.07.2024	800	(2)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,300	14.11.2024	900	0	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	13.11.2024	1.400	0	(7)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	15.11.2024	600	0	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,310	18.11.2024	500	0	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,350	20.11.2024	600	0	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,353	17.12.2024	500	0	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,357	21.11.2024	600	0	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,360	22.11.2024	500	0	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,363	05.12.2024	700	0	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,395	09.12.2024	700	0	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,400	25.11.2024	600	0	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,425	13.12.2024	700	0	(6)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,440	03.12.2024	500	0	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,465	29.11.2024	500	0	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,468	29.11.2024	700	0	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,468	11.12.2024	700	0	(7)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	15.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,550	18.07.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,880	15.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,890	18.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,850	05.07.2024	900	(2)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250	05.07.2024	900	(2)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,610	15.07.2024	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	15.07.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,640	23.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,675	22.07.2024	400	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,800	05.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,990	23.07.2024	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,025	22.07.2024	400	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,150	05.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	3,800	03.07.2024	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,150	03.07.2024	200	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,820	11.07.2024	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,120	11.07.2024	500	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	29.07.2024	400	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,690	29.07.2024	400	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,765	22.07.2024	400	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,040	29.07.2024	400	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,090	29.07.2024	400	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,265	22.07.2024	400	(2)	(1)	0,00
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	17.07.2024	500	(1)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,630	22.07.2024	500	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,740	15.07.2024	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,940	22.07.2024	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,970	17.07.2024	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,040	15.07.2024	500	(1)	0	0,00
							\$ (72)	\$ (123)	(0,03)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	\$ 97,266	08.07.2024	200	\$ 0	\$ 0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,719	08.07.2024	200	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	95,594	06.08.2024	300	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.08.2054	98,594	06.08.2024	300	(1)	(1)	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.07.2054	97,969	08.07.2024	300	(1)	0	0,00
					\$ (3)	\$ (2)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 100	\$ (4)	\$ 4	\$ 0	0,00
BRC	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.12.2024	400	5	(3)	2	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	500	11	(6)	5	0,01
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	400	(2)	4	2	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	2	2	0,00
GST	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(2)	3	1	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	2	2	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	400	(9)	10	1	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	0	3	3	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.000	(62)	60	(2)	0,00
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	300	0	2	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	1	0	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	200	1	1	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	100	(3)	4	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2028	300	(3)	3	0	0,00
					\$ (69)	\$ 90	\$ 21	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2024	AUD	83	\$ 55	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	07.2024	€	20.848	22.635	292	292	0,06
BPS	07.2024	CAD	4.939	3.619	9	9	0,00
	07.2024	DKK	3.993	580	6	6	0,00
	07.2024	€	618	672	9	9	0,00
	07.2024	£	5.681	7.256	76	76	0,02
	07.2024	IDR	18.414.492	1.124	0	(1)	0,00
	07.2024	\$	55	AUD 83	0	0	0,00
	07.2024		8.004	£ 6.330	0	(3)	0,00
	08.2024	AUD	83	\$ 55	0	0	0,00
	08.2024	£	6.330	8.006	2	2	0,00
	08.2024	TRY	3.707	107	0	(1)	0,00
	10.2024	CNH	8.716	1.212	8	8	0,00
BRC	07.2024	DKK	2.580	376	5	5	0,00
	07.2024	£	139	178	2	2	0,00
	07.2024	\$	37	NOK 384	0	0	0,00
	07.2024		190	TRY 6.604	7	7	0,00
	08.2024		534	18.606	4	4	0,00
	09.2024		1.243	MXN 23.295	15	15	0,00
	09.2024		53	TRY 1.910	1	1	0,00
CBK	07.2024	€	2.134	\$ 2.309	24	(2)	0,01
	07.2024	£	540	689	7	7	0,00
	07.2024	\$	60	TRY 2.012	0	0	0,00
	09.2024		647	INR 54.076	0	0	0,00
GLM	08.2024		866	BRL 4.444	0	(70)	(0,01)
	08.2024		153	TRY 5.283	1	1	0,00
	09.2024		59	2.076	0	0	0,00
JPM	07.2024	CAD	1.000	\$ 728	0	(3)	0,00
	07.2024	\$	559	DKK 3.893	1	1	0,00
	07.2024		1.148	IDR 18.620.572	0	(10)	0,00
	07.2024		930	TRY 31.492	26	26	0,01
	08.2024	DKK	3.886	\$ 559	0	(1)	0,00
	08.2024	\$	556	TRY 19.668	14	14	0,00
	09.2024	MXN	39.890	\$ 2.204	49	49	0,01
	09.2024	\$	88	INR 7.376	0	0	0,00
MYI	07.2024	€	26	\$ 28	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2024	£ 57	\$ 73	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2024	NOK 384	\$ 36	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 383	DKK 2.672	1	0	1	0,00
	07.2024	81	€ 76	0	0	0	0,00
	07.2024	503	£ 398	0	0	0	0,00
	08.2024	DKK 2.667	\$ 383	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	\$ 36	NOK 384	0	0	0	0,00
	09.2024	59	INR 4.923	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	MXN 25	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 25.286	€ 23.600	8	0	8	0,00
	08.2024	€ 23.600	\$ 25.323	0	(8)	(8)	0,00
	09.2024	\$ 399	INR 33.422	1	0	1	0,00
	09.2024	399	MXN 7.500	6	0	6	0,00
SSB	07.2024	CHF 1	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2024	HUF 329	1	0	0	0	0,00
	07.2024	TRY 15	0	0	0	0	0,00
				\$ 574	\$ (100)	\$ 474	0,10

#### ABGESICHERTE DEWISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 46.749	€ 43.061	\$ 0	\$ (599)	\$ (599)	(0,12)
BPS	07.2024	€ 45.506	\$ 48.694	16	(93)	(77)	(0,02)
	07.2024	\$ 42.129	€ 38.915	0	(422)	(422)	(0,10)
	08.2024	€ 73	\$ 78	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 46.133	€ 43.068	93	0	93	0,02
BRC	07.2024	38.319	35.386	0	(394)	(394)	(0,08)
CBK	07.2024	€ 167	\$ 179	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 129	€ 119	0	(2)	(2)	0,00
GLM	07.2024	67	62	0	(1)	(1)	0,00
MYI	07.2024	5	5	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	€ 43.510	\$ 46.618	0	(15)	(15)	0,00
	07.2024	\$ 14.011	€ 13.056	0	(18)	(18)	0,00
	08.2024	46.510	43.347	15	0	15	0,00
SSB	07.2024	€ 41.421	\$ 44.376	0	(17)	(17)	0,00
	08.2024	\$ 44.441	€ 41.421	17	0	17	0,00
				\$ 141	\$ (1.561)	\$ (1.420)	(0,30)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 9.556	\$ 12.084	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	07.2024	\$ 21.857	£ 17.151	0	(176)	(176)	(0,04)
	08.2024	12.086	9.556	0	(4)	(4)	0,00
BRC	07.2024	£ 69	\$ 88	1	0	1	0,00
	07.2024	\$ 885	£ 697	0	(4)	(4)	0,00
CBK	07.2024	£ 9.565	\$ 12.103	11	0	11	0,00
	07.2024	\$ 232	£ 182	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	12.093	9.556	0	(10)	(10)	0,00
DUB	07.2024	11.510	9.021	0	(107)	(107)	(0,02)
JPM	07.2024	640	503	0	(4)	(4)	0,00
	08.2024	£ 24	\$ 30	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	\$ 141	£ 111	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 16	\$ (308)	\$ (292)	(0,06)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (1.261) (0,26)

Summe Anlagen

\$ 560.668 113,52

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (66.780) (13,52)

Nettovermögen

\$ 493.888 100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 19.169 USD (31. Dezember 2023: null USD) wurde zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 9.106 USD (31. Dezember 2023: 8.248 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.350 USD (31. Dezember 2023: 110 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 766	\$ 548.251	\$ 1.818	\$ 550.835
Investmentfonds	6.578	0	0	6.578
Pensionsgeschäfte	0	2.068	0	2.068
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(9)	1.196	0	1.187
<b>Summen</b>	<b>\$ 7.335</b>	<b>\$ 551.515</b>	<b>\$ 1.818</b>	<b>\$ 560.668</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 725	\$ 486.459	\$ 162	\$ 487.346
Investmentfonds	18.239	0	0	18.239
Pensionsgeschäfte	0	259	0	259
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(25)	6.181	0	6.156
<b>Summen</b>	<b>\$ 18.939</b>	<b>\$ 492.899</b>	<b>\$ 162</b>	<b>\$ 512.000</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2024:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,510 %	25.06.2024	09.07.2024	\$ (4.589)	\$ (4.593)	(0,93)
	5,550	25.06.2024	02.07.2024	(14.998)	(15.012)	(3,04)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (19.605)</b>	<b>(3,97)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ 46	\$ 0	\$ 46
BOA	(308)	340	32	85	0	85
BPS	(477)	500	23	232	(420)	(188)
BRC	(354)	350	(4)	129	(280)	(151)
CBK	23	0	23	(57)	0	(57)
DUB	(105)	0	(105)	3	0	3
GLM	(90)	0	(90)	(165)	0	(165)
GST	3	0	3	4	0	4
JPM	69	0	69	(12)	0	(12)
MYC	(6)	90	84	1	90	91
MYI	0	70	70	(2)	20	18
RYL	(4)	0	(4)	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
SCX	(12)	0	(12)	74	0	74
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	122	0	122

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	69,53	66,97
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	41,77	34,39
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,24	k. A.
Investmentfonds	1,33	3,79
Pensionsgeschäfte	0,42	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,06	0,56
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,43	0,63
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,26)	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(3,97)	k. A.

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,80	0,12
Unternehmensanleihen und Wechsel	86,48	79,76
US-Regierungsbehörden	11,94	9,12
US-Schatzobligationen	8,13	8,15
Non-Agency-MBS	0,72	0,60
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,99	1,56
Staatsemissionen	2,22	1,43
Stammaktien	k. A.	0,00
Optionsscheine	k. A.	0,00
Vorzugswertpapiere	0,16	0,15
Kurzfristige Instrumente	0,10	0,47
Investmentfonds	1,33	3,79
Pensionsgeschäfte	0,42	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,06	0,56
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen		
– Schutzverkauf	0,08	0,09
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,02)	0,11
Zinsswaps	0,37	0,43
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,02	0,00
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,03)	(0,02)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen		
– Schutzverkauf	0,01	0,01
Devisenterminkontrakte	0,10	(0,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,36)	0,15
Sonstige Aktiva und Passiva	(13,52)	(6,48)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund

AUSTRALIEN				% DES NETTOVERMÖGENS				% DES NETTOVERMÖGENS				% DES NETTOVERMÖGENS			
BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTOVERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTOVERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTOVERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTOVERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>															
<b>AUSTRALIEN</b>															
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>															
Ausgrid Finance Pty. Ltd.				Sound Point CLO Ltd.	4.070	4.077	0,20	Deutsche Bank AG				Deutsche Bank AG			
3,750 % fällig am 30.10.2024 AUD	5.590	3.717	0,19	6,739 % fällig am 18.04.2031				2,129 % fällig am 24.11.2026	1.000	949	0,05	3,961 % fällig am 26.11.2025	17.200	17.055	0,85
5,629 % fällig am 30.10.2024	6.100	4.076	0,21	6,600 % fällig am 15.04.2031	5.076	5.084	0,26	Summe Deutschland						18.004	0,90
Bank of Queensland Ltd.				6,656 % fällig am 21.04.2031	1.796	1.798	0,09							38.427	1,92
5,241 % fällig am 18.12.2024	4.000	2.675	0,13	Trinitas CLO Ltd.	9.000	9.024	0,45								
Incitec Pivot Ltd.				6,663 % fällig am 25.01.2034											
4,300 % fällig am 18.03.2026	1.900	1.242	0,06	Venture CLO Ltd.											
ING Bank Australia Ltd.				6,470 % fällig am 15.04.2027	28	28	0,00								
5,115 % fällig am 26.05.2025	10.200	6.834	0,34	6,574 % fällig am 07.09.2030	1.146	1.147	0,06								
Optus Finance Pty. Ltd.				6,686 % fällig am 20.01.2029	1.611	1.614	0,08								
1,600 % fällig am 01.07.2025	600	387	0,02	Summe Australien		57.685	2,89								
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.															
3,375 % fällig am 30.04.2025	1.100	1.080	0,05												
Toyota Finance Australia Ltd.															
4,787 % fällig am 09.09.2024 AUD	2.000	1.335	0,07												
Transurban Queensland Finance Pty. Ltd.															
6,421 % fällig am 16.12.2024	1.570	1.052	0,05												
Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd.															
4,835 % fällig am 23.08.2024	3.000	2.002	0,10												
Woodside Finance Ltd.															
3,650 % fällig am 05.03.2025	9.100	8.973	0,45												
Summe Australien		33.373	1,67												
<b>KANADA</b>															
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>															
Algonquin Power & Utilities Corp.															
5,365 % fällig am 15.06.2026	4.200	4.182	0,21												
National Bank of Canada															
6,275 % fällig am 25.03.2027	1.000	999	0,05												
Rogers Communications, Inc.															
2,950 % fällig am 15.03.2025	8.000	7.845	0,39												
Royal Bank of Canada															
6,308 % fällig am 19.01.2027	2.700	2.722	0,14												
Summe Kanada		15.748	0,79												
<b>CAYMAN INSELN</b>															
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>															
Apex Credit CLO Ltd.															
0,000 % fällig am 20.10.2031 (b)	3.500	3.500	0,18												
Atlas Senior Loan Fund Ltd.															
6,680 % fällig am 15.01.2031	2.232	2.234	0,11												
Carlyle U.S. CLO Ltd.															
6,770 % fällig am 15.01.2030	685	686	0,03												
Catamaran CLO Ltd.															
6,686 % fällig am 22.04.2030	743	743	0,04												
CBAM Ltd.															
6,599 % fällig am 17.04.2031	2.483	2.485	0,12												
CIFC Funding Ltd.															
6,635 % fällig am 24.04.2030	7.142	7.150	0,36												
Crestline Denali CLO Ltd.															
6,706 % fällig am 20.01.2030	2.932	2.936	0,15												
Dryden CLO Ltd.															
6,640 % fällig am 15.07.2031	616	617	0,03												
Dryden Senior Loan Fund															
6,490 % fällig am 15.04.2029	398	398	0,02												
Elevation CLO Ltd.															
6,820 % fällig am 15.10.2029	156	156	0,01												
6,870 % fällig am 15.07.2029	126	126	0,01												
Greenwood Park CLO Ltd.															
6,600 % fällig am 15.04.2031	5.161	5.168	0,26												
Octagon Investment Partners Ltd.															
6,549 % fällig am 16.04.2031	233	233	0,01												
6,560 % fällig am 15.04.2031	441	442	0,02												
Octagon Loan Funding Ltd.															
6,767 % fällig am 18.11.2031	5.289	5.295	0,27												
OZLM Ltd.															
6,610 % fällig am 15.04.2031	888	889	0,04												
6,649 % fällig am 17.01.2031	1.425	1.427	0,07												
Palmer Square CLO Ltd.															
6,709 % fällig am 17.01.2031	428	428	0,02												
<b>FRANKREICH</b>															
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>															
Cars Alliance Auto Leases France															
4,258 % fällig am 21.10.2038	4.600	4.950	0,25												
Red & Black Auto Lease France															
4,202 % fällig am 27.06.2039	6.400	6.860	0,34												
Summe Frankreich						11.810	0,59								
<b>IRLAND</b>															
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>															
Black Diamond CLO DAC															
4,808 % fällig am 15.05.2032	€ 4.822	5.172	0,26												
BNPP AM Euro CLO DAC															
4,506 % fällig am 15.04.2031	1.999	2.138	0,11												
Carlyle Euro CLO DAC															
4,606 % fällig am 15.01.2031	17.399	18.675	0,94												
Contego CLO DAC															
4,532 % fällig am 23.01.2030	13.442	14.388	0,72												
Oak Hill European Credit Partners DAC															
4,637 % fällig am 20.10.2031	1.215	1.299	0,06												
Palmer Square European Loan Funding DAC															
4,636 % fällig am 15.07.2031	3.098	3.303	0,17												
4,686 % fällig am 15.04.2031	4.162	4.463	0,22												
TIKEHAU CLO DAC															
4,723 % fällig am 04.08.2034	12.995	13.931	0,70												
Voya Euro CLO DAC															
4,656 % fällig am 15.10.2030	7.715	8.268	0,41												
Summe Irland						71.637	3,59								
<b>ISRAEL</b>															
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>															
AerCap Ireland Capital DAC															
1,650 % fällig am 29.10.2024	\$ 11.000	10.852	0,54												
1,750 % fällig am 29.10.2024	7.000	6.907	0,35												
Summe Israel						17.759	0,89								
<b>JAPAN</b>															
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>															
Aozora Bank Ltd.															
1,050 % fällig am 09.09.2024	9.600	9.501	0,48												
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.															
4,788 % fällig am 18.07.2025	3.100	3.098	0,16												
5,063 % fällig am 12.09.2025	1.100	1.098	0,06												
5,541 % fällig am 17.04.2026	1.000	999	0,05												
6,756 % fällig am 12.09.2025	11.000	11.025	0,55												
7,007 % fällig am 18.07.2025	9.100	9.106	0,46												
Mizuho Financial Group, Inc.															
2,839 % fällig am 16.07.2025	10.000	9.987	0,50												
MUFG Bank Ltd.															
5,215 % fällig am 17.02.2026 AUD	300	201	0,01												
Nissan Motor Co. Ltd.															
3,522 % fällig am 17.09.2025	\$ 5.402	5.243	0,26												
Nomura Holdings, Inc.															
1,851 % fällig am 16.07.2025	10.127	9.732	0,49												
2,648 % fällig am 16.01.2025	14.780	14.529	0,73												
ORIX Corp.															
3,250 % fällig am 04.12.2024	1.600	1.584	0,08												
Panasonic Holdings Corp.															
2,679 % fällig am 19.07.2024	2.000	1.998	0,10												
Renesas Electronics Corp.															
1,543 % fällig am 26.11.2024	2.485	2.441	0,12												
Sumitomo Mitsui Banking Corp.															
5,193 % fällig am 20.02.2026 AUD	3.700	2.481	0,12												
5,461 % fällig am 28.07.2026	3.000	2.019	0,10												
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.															
5,606 % fällig am 16.10.2024	9.700	6.488	0,32												
6,655 % fällig am 13.07.2026	\$ 200	203	0,01												
6,785 % fällig am 13.01.2026	9.700	9.850	0,49												
Sumitomo Trust Bank Ltd.															
6,514 % fällig am 14.09.2026	2.000	2.024	0,10												
6,522 % fällig am 14.09.2026	200	202	0,01												
Summe Japan						103.809	5,20								

BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES					
	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				<b>Schweden</b>				<b>USA</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>						
Aptiv PLC				Svenska Handelsbanken AB	\$	3.600	3.605	0,18	Towd Point Mortgage Funding PLC	£	10.000	12.659	0,63	
2,396 % fällig am 18.02.2025	\$	2.841	2.780	0,14	6,031 % fällig am 28.05.2027				0,000 % fällig am 20.07.2053		3.618	4.577	0,23	
									6,583 % fällig am 20.07.2045					
									Tudor Rose Mortgages					
									5,834 % fällig am 20.06.2048		2.285	2.886	0,15	
<b>LUXEMBURG</b>				<b>SCHWEIZ</b>				<b>USA</b>						
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>						
Compartment Driver UK Eight	£	7.700	9.756	0,49	UBS AG				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust	\$	20	19	0,00	
5,810 % fällig am 25.09.2031					3,625 % fällig am 09.09.2024	2.000	1.991	0,10	5,850 % fällig am 25.03.2034					
Silver Arrow S.A.					4,750 % fällig am 09.08.2024	1.000	999	0,05	6,585 % fällig am 25.03.2035		202	200	0,01	
5,761 % fällig am 31.01.2031		11.196	14.175	0,71	UBS AG				College Avenue Student Loans LLC					
					5,279 % fällig am 30.07.2025AUD	7.225	4.840	0,24	7,110 % fällig am 26.11.2046		739	746	0,04	
Summe Luxemburg			23.931	1,20	UBS Group AG				Commonbond Student Loan Trust					
					2,593 % fällig am 11.09.2025	\$	2.000	1.987	0,10	2,730 % fällig am 25.10.2040		267	253	0,01
					4,490 % fällig am 05.08.2025		1.000	998	0,05	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				
					6,944 % fällig am 12.05.2026		15.000	15.126	0,76	6,960 % fällig am 25.10.2034		354	350	0,02
					Summe Schweiz			25.941	1,30	EquiFirst Mortgage Loan Trust				
									8,460 % fällig am 25.10.2034		582	509	0,03	
									Finance America Mortgage Loan Trust					
									6,285 % fällig am 25.08.2034		709	666	0,03	
									First NLC Trust					
									5,530 % fällig am 25.08.2037		221	109	0,01	
									Fremont Home Loan Trust					
									6,195 % fällig am 25.01.2035		162	158	0,01	
									Home Equity Asset Trust					
									6,405 % fällig am 25.06.2034		405	399	0,02	
									Long Beach Mortgage Loan Trust					
									6,435 % fällig am 25.04.2035		739	729	0,04	
									MASTR Asset-Backed Securities Trust					
									6,160 % fällig am 25.09.2034		734	656	0,03	
									Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					
									6,510 % fällig am 25.09.2033		510	506	0,02	
									NaviNet Private Education Loan Trust					
									6,163 % fällig am 15.12.2059		2.085	2.079	0,10	
									6,893 % fällig am 16.07.2040		1.780	1.788	0,09	
									7,043 % fällig am 15.10.2031		3.131	3.141	0,16	
									7,143 % fällig am 15.11.2030		4.041	4.055	0,20	
									7,593 % fällig am 15.12.2045		235	237	0,01	
									Netnet Student Loan Trust					
									6,050 % fällig am 27.02.2051		623	620	0,03	
									NovaStar Mortgage Funding Trust					
									6,120 % fällig am 25.01.2036		378	374	0,02	
									SBA Tower Trust					
									3,869 % fällig am 15.10.2049		3.000	2.981	0,15	
									SLC Student Loan Trust					
									5,669 % fällig am 15.05.2029		351	351	0,02	
									SLM Private Credit Student Loan Trust					
									5,891 % fällig am 15.06.2039		5.039	4.895	0,24	
									5,931 % fällig am 15.06.2039		4.580	4.490	0,22	
									SLM Student Loan Trust					
									6,100 % fällig am 27.12.2038		839	830	0,04	
									6,209 % fällig am 25.10.2029		425	425	0,02	
									6,509 % fällig am 25.07.2023		518	514	0,03	
									7,309 % fällig am 25.07.2023		108	109	0,01	
									SMB Private Education Loan Trust					
									2,340 % fällig am 15.09.2034		734	723	0,04	
									2,820 % fällig am 15.10.2035		1.971	1.914	0,10	
									3,600 % fällig am 15.01.2037		2.737	2.658	0,13	
									3,630 % fällig am 15.11.2035		5.219	5.069	0,25	
									6,193 % fällig am 15.10.2035		1.130	1.128	0,06	
									6,193 % fällig am 15.11.2035		1.116	1.113	0,06	
									6,893 % fällig am 17.02.2032		27	27	0,00	
									SoFi Professional Loan Program LLC					
									2,650 % fällig am 25.09.2040		1.464	1.419	0,07	
									Structured Asset Investment Loan Trust					
									6,010 % fällig am 25.09.2034		1.581	1.484	0,07	
									Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust					
									7,185 % fällig am 25.11.2035		1.380	1.369	0,07	
											49.093	2.46		
									<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
									Air Lease Corp.					
									5,300 % fällig am 25.06.2026		1.900	1.894	0,09	



BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,920 % fällig am 25.04.2045 \$	1	\$	0,00	5,850 % fällig am 25.07.2050 \$	8.320	\$ 8.129	0,41	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
6,000 % fällig am 25.12.2045	23		0,00	5,858 % fällig am 15.06.2037	510	504	0,03	<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
		59.566	2,98	5,898 % fällig am 15.10.2036 - 15.06.2042	38	37	0,00	Crown Castle, Inc.			
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				5,928 % fällig am 15.10.2040	61	59	0,00	5,840 % fällig am 30.07.2024 \$	1.750	\$ 1.741	0,09
Fannie Mae				5,948 % fällig am 15.11.2050	75	71	0,00	5,840 % fällig am 01.08.2024	3.250	3.232	0,16
2,000 % fällig am 25.08.2038	4.412	3.974	0,20	5,968 % fällig am 15.05.2036 - 15.12.2041	160	158	0,01	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.			
3,602 % fällig am 25.08.2050	1.438	1.388	0,07	6,226 % fällig am 15.04.2049	7.270	7.139	0,36	5,570 % fällig am 13.08.2024 (b)	13.400	13.305	0,67
5,700 % fällig am 25.01.2037	29	29	0,00	6,553 % fällig am 25.07.2044	3	3	0,00	VW Credit, Inc.			
5,760 % fällig am 25.04.2037	2	2	0,00	Ginnie Mae				5,701 % fällig am 21.08.2024	1.600	1.586	0,08
5,780 % fällig am 25.04.2037	7	7	0,00	2,500 % fällig am 20.01.2049 - 20.10.2049	668	574	0,03			19.864	1,00
5,793 % fällig am 25.11.2047	2.227	2.193	0,11	3,625 % fällig am 20.08.2024	0	0	0,00	<b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>			
5,800 % fällig am 25.07.2037	29	29	0,00	3,750 % fällig am 20.11.2029	1	1	0,00	American Honda Finance Corp.			
5,820 % fällig am 25.05.2037	24	23	0,00	4,625 % fällig am 20.03.2027 - 20.03.2030	15	15	0,00	5,822 % fällig am 13.06.2025	5.900	5.903	0,30
5,840 % fällig am 25.04.2037	288	284	0,01	5,610 % fällig am 20.04.2069	1.409	1.409	0,07	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
5,843 % fällig am 25.03.2049	552	546	0,03	5,633 % fällig am 20.09.2071	1.638	1.620	0,08	5,365 % fällig am 30.07.2024 (b)(c)(d)	285.000	283.796	14,21
5,850 % fällig am 25.05.2037 - 25.10.2040	28	28	0,00	5,897 % fällig am 20.02.2067	346	346	0,02	5,377 % fällig am 27.08.2024 (b)(c)(d)	135.000	133.880	6,71
5,870 % fällig am 25.05.2037	46	45	0,00	5,953 % fällig am 20.10.2037	122	122	0,01	5,385 % fällig am 29.10.2024 (b)(c)(d)	206.000	202.450	10,14
5,893 % fällig am 25.09.2046	1.580	1.566	0,08	6,033 % fällig am 20.02.2074	398	397	0,02			620.126	31,06
5,900 % fällig am 25.10.2030 - 25.06.2060	17.022	16.658	0,84	6,084 % fällig am 20.12.2068	943	932	0,05	Summe kurzfristige Instrumente		645.893	32,36
5,923 % fällig am 25.07.2056	2.794	2.776	0,14	6,187 % fällig am 20.12.2065 - 20.08.2067	2.507	2.511	0,13				
5,950 % fällig am 25.08.2037	43	43	0,00	6,233 % fällig am 20.01.2074	5.053	5.072	0,25	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>	<b>\$ 2.345.757</b>		<b>117,51</b>
6,000 % fällig am 25.01.2041	59	57	0,00	6,237 % fällig am 20.01.2066	312	312	0,02	<b>AKTIEN</b>			
6,104 % fällig am 25.12.2047	1.858	1.838	0,09	6,283 % fällig am 20.10.2073	1.520	1.530	0,08	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
6,120 % fällig am 25.03.2038	47	47	0,00	6,287 % fällig am 20.11.2066	677	677	0,03	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
6,124 % fällig am 25.01.2051	7.762	7.765	0,39	6,333 % fällig am 20.05.2073	4.269	4.306	0,22	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (f)	319.368	3.183	0,16
6,130 % fällig am 25.12.2037	34	34	0,00	6,433 % fällig am 20.05.2073	1.014	1.029	0,05	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
6,228 % fällig am 25.12.2050	4.472	4.601	0,23	6,522 % fällig am 20.04.2067	2.851	2.867	0,14	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	1.949.172	195.024	9,77
6,340 % fällig am 01.10.2037	71	74	0,00	6,833 % fällig am 20.06.2071	7.065	7.194	0,36	<b>Summe Investmentfonds</b>		<b>\$ 198.207</b>	<b>9,93</b>
6,450 % fällig am 25.05.2037	152	152	0,01	7,043 % fällig am 20.09.2066	1.207	1.234	0,06				
Federal Home Loan Bank				7,575 % fällig am 20.06.2071	3.793	3.886	0,20				
5,500 % fällig am 20.02.2026	20.000	19.992	1,00	7,581 % fällig am 20.05.2071	3.668	3.771	0,19				
Freddie Mac				Uniform Mortgage-Backed Security							
0,553 % fällig am 15.01.2038 (a)	505	29	0,00	4,000 % fällig am 01.09.2049	3.330	3.086	0,16				
2,000 % fällig am 01.03.2028	4.591	4.367	0,22			243.158	12,18				
2,500 % fällig am 25.10.2048	676	598	0,03	<b>US-SCHATZ Obligationen</b>							
3,000 % fällig am 25.09.2045	1.909	1.651	0,08	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)							
4,000 % fällig am 01.08.2048	1.305	1.216	0,06	0,125 % fällig am 15.10.2024	12.097	11.977	0,60				
5,375 % fällig am 24.04.2025	10.000	9.993	0,50	2,125 % fällig am 15.04.2029	44.192	44.257	2,22				
5,500 % fällig am 13.02.2026	18.000	17.985	0,90			56.234	2,82				
5,520 % fällig am 28.05.2025	22.400	22.397	1,12	Summe USA		925.115	46,34				
5,550 % fällig am 20.02.2026	19.000	18.994	0,95								
5,650 % fällig am 06.03.2026	18.000	17.998	0,90								
5,748 % fällig am 15.05.2037	37	36	0,00								
5,793 % fällig am 15.01.2038 - 15.10.2040	18.515	18.556	0,93								
5,848 % fällig am 15.02.2034 - 15.08.2056	6.347	6.196	0,31								

## PENSIONSGESCHÄFTEN

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,340 %	28.06.2024	01.07.2024	\$ 62.400	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.07.2026	\$ (63.625)	\$ 62.400	\$ 62.428	3,13
FICC	2,600	28.06.2024	01.07.2024	371	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026	(378)	371	371	0,01
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (64.003)</b>	<b>\$ 62.771</b>	<b>\$ 62.799</b>	<b>3,14</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2024	148	\$ (95)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2024	1.467	28	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2024	366	99	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2024	181	(156)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2024	11	0	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2024	171	(168)	(0,01)
				\$ (292)	(0,01)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (292)</b>	<b>(0,01)</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,900 %	09.09.2024	171.300	\$ 154	\$ 174	0,01

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	AUD 1.013	\$ 673	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
BPS	07.2024	£ 46.659	\$ 59.602	621	0	621	0,03
	07.2024	\$ 33.717	AUD 50.603	78	0	78	0,00
	07.2024	€ 6.758	€ 6.318	14	0	14	0,00
	08.2024	AUD 50.603	\$ 33.746	0	(78)	(78)	0,00
	08.2024	€ 6.318	€ 6.768	0	(14)	(14)	0,00
BRC	07.2024	€ 6.318	€ 6.761	0	(11)	(11)	0,00
	07.2024	\$ 14.717	AUD 22.239	135	0	135	0,01
	09.2024	15	MXN 273	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	AUD 4.361	\$ 2.904	0	(8)	(8)	0,00
	07.2024	£ 3.157	€ 4.019	29	0	29	0,00
	07.2024	\$ 4.756	€ 3.719	0	(55)	(55)	0,00
FAR	07.2024	AUD 63.848	\$ 42.540	0	(101)	(101)	(0,01)
	07.2024	€ 96.232	104.812	1.674	0	1.674	0,09
	07.2024	\$ 1.251	AUD 1.876	2	0	2	0,00
	08.2024	AUD 1.876	\$ 1.252	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07.2024	\$ 6.186	€ 5.674	0	(105)	(105)	(0,01)
	07.2024	€ 1.108	€ 875	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2024	AUD 3.620	\$ 2.407	0	(10)	(10)	0,00
	04.2025	DKK 44.700	€ 6.594	66	0	66	0,00
MYI	07.2024	€ 6	€ 7	0	0	0	0,00
	07.2024	\$ 1.248	€ 985	0	(3)	(3)	0,00
RBC	07.2024	AUD 1.876	\$ 1.250	0	(3)	(3)	0,00
	07.2024	\$ 56.097	€ 44.237	0	(177)	(177)	(0,01)
	08.2024	£ 44.237	\$ 56.107	176	0	176	0,01
	01.2025	DKK 5.600	€ 822	8	0	8	0,00
RYL	01.2025	€ 34.000	€ 4.984	43	0	43	0,00
SCX	07.2024	\$ 97.024	€ 90.558	32	0	32	0,00
	08.2024	€ 90.558	\$ 97.167	0	(31)	(31)	0,00
TOR	04.2025	DKK 33.500	€ 4.917	24	0	24	0,00
UAG	07.2024	\$ 48	ILS 179	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 2.902	\$ (604)	\$ 2.298	0,11

#### ABGESICHERTE DEWISENTERMIKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2024	\$ 28.348	€ 26.110	\$ 0	(365)	(365)	(0,02)
BPS	07.2024	€ 25.096	\$ 26.842	0	(54)	(54)	0,00
	07.2024	\$ 25.241	€ 23.313	0	(255)	(255)	(0,01)
	08.2024	€ 26.882	€ 25.096	54	0	54	0,00
BRC	07.2024	€ 6	\$ 7	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	\$ 139	€ 128	0	(2)	(2)	0,00
FAR	07.2024	€ 27.419	€ 25.175	0	(438)	(438)	(0,02)
GLM	07.2024	55	€ 51	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2024	25	€ 23	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	€ 25.155	\$ 26.898	1	(62)	(61)	0,00
	07.2024	\$ 149	€ 138	0	(1)	(1)	0,00
	08.2024	€ 26.912	€ 25.131	62	0	62	0,00
MYI	07.2024	3	€ 3	0	0	0	0,00
RBC	07.2024	€ 47	\$ 52	1	0	1	0,00
RYL	07.2024	\$ 188	€ 176	0	0	0	0,00
SCX	07.2024	€ 25.117	\$ 26.911	0	(9)	(9)	0,00
	07.2024	\$ 95	€ 89	0	0	0	0,00
	08.2024	€ 26.950	€ 25.117	8	0	8	0,00
SSB	07.2024	235	€ 216	0	(3)	(3)	0,00
UAG	08.2024	5	€ 5	0	0	0	0,00
				\$ 126	\$ (1.190)	\$ (1.064)	(0,05)

Zum 30. Juni 2024 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2024	£ 73	\$ 92	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2024	\$ 289	£ 227	0	(2)	(2)	0,00
	08.2024	92	73	0	0	0	0,00
CBK	07.2024	2	2	0	0	0	0,00
	08.2024	£ 73	\$ 92	0	0	0	0,00
MBC	07.2024	\$ 92	£ 73	0	0	0	0,00
	08.2024	£ 10	\$ 13	0	0	0	0,00
MYI	07.2024	73	92	0	0	0	0,00
	08.2024	\$ 92	£ 73	0	0	0	0,00
RBC	07.2024						
	08.2024						
				\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ 1.406</b>	<b>0,07</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>\$ 2.607.849</b>	<b>130,64</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>\$ (611.630)</b>	<b>(30,64)</b>
<b>Nettovermögen</b>						<b>\$ 1.996.219</b>	<b>100,00</b>

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- Wertpapier per Emissionstermin.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- Mit dem Fonds verbunden.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2023: 43.306 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 4.457 USD (31. Dezember 2023: 9.098 USD) wurden zum 30. Juni 2024 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 270 USD (31. Dezember 2023: 3.460 USD) wurden zum 30. Juni 2024 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2024 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.345.522	\$ 235	\$ 2.345.757
Investmentfonds	198.207	0	0	198.207
Pensionsgeschäfte	0	62.771	0	62.771
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(168)	1.282	0	1.114
<b>Summen</b>	<b>\$ 198.039</b>	<b>\$ 2.409.575</b>	<b>\$ 235</b>	<b>\$ 2.607.849</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.682.857	\$ 228	\$ 1.683.085
Investmentfonds	67	184.415	0	184.482
Pensionsgeschäfte	0	4.561	0	4.561
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	(7.719)	0	(7.719)
<b>Summen</b>	<b>\$ 67</b>	<b>\$ 1.864.114</b>	<b>\$ 228</b>	<b>\$ 1.864.409</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2024			Zum 31. Dez. 2023		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ (1.179)	\$ 1.230	\$ 51
BOA	(368)	270	(98)	(20)	0	(20)
BPS	364	(350)	14	(66)	0	(66)
BRC	124	0	124	(3)	0	(3)
CBK	(36)	0	(36)	6	0	6
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	(24)	0	(24)
FAR	1.309	(1.760)	(451)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(1)	0	(1)	2	0	2
JPM	(107)	0	(107)	(21)	0	(21)
MBC	56	0	56	211	(390)	(179)
MYI	(3)	0	(3)	175	(370)	(195)
RBC	5	0	5	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	43	0	43	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	0	0	0	(222)	280	58
SSB	(3)	0	(3)	1	0	1
TOR	24	0	24	(932)	870	(62)
UAG	(1)	0	(1)	(585)	1.080	495

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023:

	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	41,14	48,81
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere*	74,76	41,02
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,61	0,93
Investmentfonds	9,93	9,95
Pensionsgeschäfte	3,14	0,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	(0,20)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	k. A.	(0,07)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,07	(0,14)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(2,37)

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2024 (%)	31. Dez. 2023 (%)
Australien	1,67	1,05
Kanada	0,79	0,04
Cayman-Inseln	3,72	6,85
Dänemark	1,38	0,58
Finnland	0,32	0,15
Frankreich	2,86	2,89
Deutschland	1,92	1,13
Irland	4,48	6,41
Israel	0,98	0,63
Japan	5,20	4,78
Jersey, Kanalinseln	0,14	k. A.
Luxemburg	1,20	k. A.
Multinational	k. A.	0,44
Niederlande	3,12	3,03
Norwegen	0,18	0,14
Saudi-Arabien	0,10	0,11
Singapur	0,17	0,18
Südkorea	0,44	0,92
Spanien	k. A.	0,80
Supranational	0,47	0,50
Schweden	0,86	0,46
Schweiz	1,30	1,35
Vereinigte Arabische Emirate	0,03	0,04
Großbritannien	7,48	8,94
USA	46,34	46,61
Kurzfristige Instrumente	32,36	2,73
Investmentfonds	9,93	9,95
Pensionsgeschäfte	3,14	0,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	(0,20)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,07)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,01	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,11	(0,16)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,05)	0,02
Sonstige Aktiva und Passiva	(30,64)	(0,55)
Nettovermögen	100,00	100,00

## 1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die einzelnen in diesem Bericht beschriebenen Fonds (nachfolgend jeweils als ein „Fonds“ und gemeinsam als die „Fonds“ bezeichnet) sind Teilfonds der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und mit gesonderter Haftung zwischen den Fonds und mit beschränkter Haftung, die gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 in Irland eingetragen und von der Zentralbank von Irland (die „Zentralbank“) nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren („OGAW“)) (Verordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinien“) genehmigt wurde. Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine Umbrella-Gesellschaft, die aus verschiedenen Fonds besteht, die jeweils eine oder mehrere Anteilklassen („Klassen“) umfassen. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“ oder die „Verwaltungsratsmitglieder“) dürfen für einen Fonds mehrere Anteilklassen („Klassen“) ausgegeben werden. Für jeden einzelnen Fonds wird ein gesondertes Vermögenswertportfolio geführt, welches in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die auf diesen Fonds zutreffen, angelegt wird. Der Verwaltungsrat darf mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Fonds auflegen. Die Gesellschaft wurde am 10. Dezember 1997 gegründet.

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) ist die Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft.

Wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft vorgesehen, wurden Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd und PIMCO Europe GmbH (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) als Anlageberatungsgesellschaften für verschiedene Fonds der Gesellschaft bestellt. PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) haben von der Zentralbank die Genehmigung erhalten, als Anlageberatungsgesellschaft für irische Fonds zu agieren.

Gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft kann jede Anlageberatungsgesellschaft die diskretionäre Anlageverwaltung der Fonds vorbehaltlich aller gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen einer oder mehreren Unter-Anlageberatungsgesellschaften übertragen. Wenn für einen bestimmten Fonds eine Anlageberatungsgesellschaft bestellt wurde, hat die Anlageberatungsgesellschaft die jeweils übrigen Anlageberatungsgesellschaften (PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd.) als Unter-Anlageberatungsgesellschaft bezüglich des bzw. der jeweiligen Fonds bestellt. Die Gebühren der einzelnen entsprechend bestellten Unter-Anlageberatungsgesellschaften sind von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften im Namen der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr zu begleichen.

Der Sitz der Gesellschaft befindet sich in 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irland.

## 2. WICHTIGE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Die bei der Erstellung dieses Abschlusses verwendeten wesentlichen Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden sind mit denen konform, die die Gesellschaft für den geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (der „geprüfte Jahresabschluss“) verwendet hat. Der Abschluss wird für alle Fonds auf der Grundlage der Unternehmensfortführung erstellt.

### Erstellungsgrundlage

Bei dem vorliegenden Abschluss handelt es sich um den ungeprüften verkürzten Abschluss für den Sechsmonatszeitraum zum 30. Juni 2024. Er wurde gemäß Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Zwischenberichterstattung“, wie vom Financial Reporting Council („FRC“) veröffentlicht, und den OGAW-Richtlinien veröffentlicht.

Der ungeprüfte verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Jahresabschluss, der von den Abschlussprüfern einen uneingeschränkten Bestätigungsvermerk erhalten hat und der im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen (FRS 102), dem Irischen Statut, bestehend aus dem Companies Act (Gesetz über Aktiengesellschaften) von 2014 und den OGAW-Richtlinien erstellt wurde, gelesen werden. Bei den in Irland allgemein für die Erstellung von Rechnungsabschlüssen anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen handelt es sich um diejenigen, die vom FRC herausgegeben werden.

Die in der Aufstellung der ausgewiesenen Gesamtgewinne und -verluste sowie in einer Überleitung der Eigenkapitalveränderungen aufzuführenden Angaben sind nach Meinung des Verwaltungsrats in der Betriebsergebnisrechnung sowie im Ausweis der Nettovermögensänderungen enthalten.

Die Gesellschaft hat von der für offene Investmentfonds, die einen erheblichen Anteil ihres Vermögens in äußerst liquiden und zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen halten, verfügbaren Ausnahmeregelung gemäß Section 7 von FRS 102 Gebrauch gemacht und legt daher keine Kapitalflussrechnung vor.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, modifiziert durch die erfolgswirksame Neubewertung der gehaltenen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert.

Die Gesellschaft verwendet den US-Dollar als Präsentationswährung. Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden in der jeweiligen Funktionswährung erstellt. Der Finanzstatus der Gesellschaft wird mithilfe von Wechselkursen zum Ende des Berichtszeitraums umgerechnet und die Betriebsergebnisrechnung und der Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen der Gesellschaft werden zum durchschnittlichen Wechselkurs (als Annäherung an die tatsächlichen Kurse) des Berichtszeitraums umgerechnet, um diese in den Abschluss der Gesellschaft einzubeziehen.

Alle Beträge wurden, sofern nicht anders angegeben, auf die nächsten Tausend gerundet. Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Die Aufstellung des Wertpapierbestands bestimmter Fonds kann übertragbare Wertpapiere halten, die sowohl einen Nennwert von Null als auch einen Marktwert von Null aufweisen, wenn der tatsächliche Nennwert und der Marktwert auf den nächsten Tausender gerundet werden.

Die von der Gesellschaft während des Berichtszeitraums angewandte Swing-Pricing-Methode entspricht der im geprüften Jahresabschluss angewandten Methode.

Bis zum 30. Juni 2024 wurde für keinen der Fonds ein Swing Pricing angewandt. Zum 31. Dezember 2023 wurde Swing Pricing auf den Income Fund II angewandt. Bis zum 31. Dezember 2023 wurde für keinen der anderen Fonds ein Swing Pricing angewandt.

Der NIW je Anteil wird in Erläuterung 16 angegeben und kann eine Swing-Pricing-Anpassung beinhalten. Swing-Price-Anpassungen werden nicht in der Aufstellung der Aktiva und Passiva, der Betriebsergebnisrechnung oder der Aufstellung über die Nettovermögensänderungen ausgewiesen.

## 3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT UND MARKTBEWERTUNGSHIERARCHIE

Die Gesellschaft muss Angaben bezüglich der Marktbewertungshierarchie machen, in die die Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingestuft werden. Die Angaben beruhen auf einer dreistufigen Marktbewertungshierarchie für die in Bewertungsverfahren zur Bemessung des beizulegenden Zeitwerts verwendeten Inputfaktoren.

Der beizulegende Zeitwert ist definiert als der Betrag, zu dem in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ein Vermögenswert ausgetauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein Eigenkapitalinstrument gewährt würde. Es sind getrennte Angaben zur Marktbewertungshierarchie für jede Hauptklasse von Aktiva und Passiva erforderlich, die die Bewertung zum Marktwert in Stufen teilt (Stufen 1, 2 und 3). Diese Inputfaktoren oder Verfahren zur Bewertung von Wertpapieren geben nicht unbedingt das Risiko wieder, dass mit der Anlage in diesen Wertpapieren verbunden ist. Die Stufen 1, 2 und 3 der Marktbewertungshierarchie sind wie folgt definiert:

- Stufe 1 – Quotierte Preise auf aktiven Märkten oder Börsen für identische Aktiva und Passiva.
- Stufe 2 – Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren. Hierzu können insbesondere quotierte Preise für ähnliche Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten an Märkten, die aktiv sind, quotierte Preise für identische oder ähnliche Vermögenswerte und Verbindlichkeiten an Märkten, die nicht aktiv sind, andere Inputfaktoren als quotierte Preise, die für die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zu beobachten sind (wie zum Beispiel Zinssätze, Renditekurven, Volatilitäten, Tilgungsgeschwindigkeit, Verlustquoten, Kreditrisiken und Ausfallraten) oder andere bestätigte Inputfaktoren vom Markt zählen.
- Stufe 3 – Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren, die unter diesen Umständen auf bestmöglich verfügbaren Informationen beruhen, wenn beobachtbare Inputfaktoren nicht verfügbar sind, was zur Bestimmung des Marktwerts von Anlagen verwendete Annahmen des Verwaltungsrats oder anderer Personen, die nach seinem Ermessen handeln, einschließen kann.

Eine Analyse der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands. Die von den Fonds zur Klassifizierung von zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten anhand einer Zeitwerthierarchie verwendete Methode ist mit derjenigen konform, die im geprüften Jahresabschluss angewandt wurde.

#### 4. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Innerhalb der durch die Anlageziele und Anlagepolitik der Fonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs können Finanzderivate und Anlagetechniken von allen Fonds für eine effiziente Portfolioverwaltung eingesetzt werden. Die Fonds können diese Finanzderivate und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Zinsänderungen, Devisenkursänderungen in anderen Währungen als der Funktionswährung, gegen Änderungen in Wertpapierkursen oder als Teil ihrer allgemeinen Anlagestrategie einsetzen.

Der durch die Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 195.146.977 USD/(250 USD) (30. Juni 2023: 277.072.633 USD/(139.559 USD)).

Der durch die umgekehrten Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 13.999 USD/(89.899.986 USD) (30. Juni 2023: USD 204.499/(USD 66.620.552)).

Der durch die Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt null USD/(10.160.992 USD) (30. Juni 2023: 1.074 USD/(2.626.118 USD)).

#### 5. DIVIDENDENAUSCHÜTTUNGSPOLITIK

Wie in der jeweiligen Fondsergänzung angegeben, können Dividendenausschüttungen festgesetzt werden auf:

- (i) Nettokapitalerträge, die aus Zinsen und Dividenden abzüglich Aufwendungen bestehen.
- (ii) Realisierte Gewinne aus der Veräußerung von Anlagen abzüglich realisierter und nicht realisierter Verluste (einschließlich Gebühren und Aufwendungen). Für den Fall, dass die bei der Veräußerung von Anlagen realisierten Gewinne abzüglich der realisierten und nicht realisierten Verluste negativ sind, können die Fonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
- (iii) Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Fonds bzw. der betreffenden Anteilsklasse des betreffenden Fonds ausgeschüttet werden können.

Verwaltungsgebühren und andere Gebühren oder ein Teil davon können dem Kapital belastet werden. Das kann dazu führen, dass das Kapital sinkt und Erträge mit einem verminderten Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erwirtschaftet werden. Dieser Zyklus kann sich solange fortsetzen, bis das Kapital aufgezehrt ist. Der Grund für die Belastung des Kapitals ist, den an die Anteilhaber ausschüttbaren Betrag zu maximieren.

Für die Anteilsklassen Ausschüttend II kann der Verwaltungsrat in seinem Ermessen entscheiden, die Gebühren aus dem Kapital zu bezahlen und die Renditedifferenz zwischen den jeweiligen abgesicherten Anteilsklassen und den grundlegenden Anteilsklassen zu berücksichtigen (was einer Ausschüttung aus dem Kapital entspricht). Die Renditedifferenz kann positiv oder negativ sein und wird unter Berücksichtigung des Beitrags der Anteilsklassenbesicherung aus den besicherten Klassen berechnet.

Im Fall der Anteilsklassen M Retail und des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, des Asia Strategic Interest Bond Fund, des Euro Income Bond Fund, des Euro Short-Term Fund, des Income Fund, des Low Duration Income Fund, des Mortgage Opportunities Fund und des US Short-Term Fund werden, mit Ausnahme der Anteilsklassen G Institutional, G Retail, Class E ausschüttend Q, Class E ausschüttend II Q und Investor ausschüttend A, Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Anteile der Administrative-Klassen des Diversified Income Fund sowie die Anteilsklassen BE Retail, BM Retail, M Retail und N Retail Share werden Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Bei den Anteilsklassen G Institutional, G Retail, Investor ausschüttend A und UM Retail werden Dividendenausschüttungen jährlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilhabers jährlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Im Falle aller anderen Fonds mit ausschüttenden Anteilsklassen werden Ausschüttungen vierteljährlich festgesetzt und abhängig von der Entscheidung des Anteilhabers, in bar ausgezahlt oder nach der Erklärung in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Bei den Anteilsklassen BM Retail nichtkumulierend und M Retail nichtkumulierend kann der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen Ausschüttungen und Gebühren aus dem Kapital zahlen. Die Verwaltungsgebühr und sonstige Gebühren oder ein Teil davon können aus dem Kapital der Anteilsklassen BM Retail nichtkumulierend und M Retail nichtkumulierend gezahlt werden. Dies kann dazu führen, dass das Kapital sinkt und Erträge unter Verzicht auf das Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erwirtschaftet werden.

Dividendenausschüttungen an Inhaber rückgabeberechtigter Anteile werden in der Betriebsergebnisrechnung als Finanzierungskosten klassifiziert. Die auf die

thesaurierenden Anteile entfallenden Erträge oder Kapitalzuwachs werden weder festgesetzt noch ausgeschüttet. Statt dessen wird der NIW je Anteil der thesaurierenden Anteile entsprechend dieser Erträge oder dieses Wertzuwachses erhöht. Dividendenausschüttungen, die nicht in Anteile reinvestiert werden, werden den Anteilhabern per Banküberweisung ausgezahlt. Dividendenausschüttungen, die nach Ablauf von sechs Jahren ab dem Datum ihrer Erklärung nicht eingefordert werden, verfallen und fließen an den jeweiligen Fonds zurück. Die Anteilhaber können sich entscheiden, die Dividendenausschüttungen in zusätzliche Anteile zu reinvestieren oder sich die Dividendenausschüttungen bar auszahlen zu lassen, indem sie das entsprechende Kästchen im Antragsformular auswählen. Für die nachfolgenden Fonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

Fonds	Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024	Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 4	\$ 0
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	2,339	729
PIMCO Capital Securities Fund	239	311
PIMCO Climate Bond Fund	16	94
Diversified Income Fund	5,512	2,113
Diversified Income Duration Hedged Fund	0	1,240
Dynamic Bond Fund	1,184	811
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 345	€ 725
Emerging Markets Bond Fund	\$ 752	\$ 0
Emerging Markets Bond ESG Fund	260	0
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	0	2
Global Bond Fund	776	549
Global Bond ESG Fund	1,437	209
Global High Yield Bond Fund	488	501
Global Investment Grade Credit Fund	5,101	1,892
Global Investment Grade Credit ESG Fund	0	461
Global Low Duration Real Return Fund	0	1,172
Global Real Return Fund	0	5,083
Income Fund	10,489	5,888
Low Average Duration Fund	23	15
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	25	13
Low Duration Income Fund	0	3
Low Duration Opportunities Fund	6,096	1,716
Strategic Income Fund	0	1
Total Return Bond Fund	106	0
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	155	0
UK Corporate Bond Fund	£ 1,595	£ 363
UK Long Term Corporate Bond Fund	0	9
US High Yield Bond Fund	\$ 0	\$ 1

#### 6. SOFT COMMISSIONS

Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann Transaktionen im Namen der Fonds über oder mit Unterstützung von Ausführungsmaklern durchführen, die zusätzlich zur routinemäßigen Order-Ausführung gelegentlich Güter, Dienstleistungen oder andere Vorteile wie etwa Research- und Beratungsdienste für die Gesellschaft oder ihre Beauftragten bereitstellen oder beschaffen können. Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann diesen Brokern Full-Service-Provisionssätze zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden können. Diejenigen Anlageberatungsgesellschaften, bei denen es sich um Anlagegesellschaften gemäß der Verordnung über Märkte für Finanzinstrumente (Markets in Financial Instruments Directive, „MiFID“) handelt oder die gleichwertigen aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterliegen, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Fonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

#### 7. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und Haftungstrennung zwischen ihren Teilfonds. Dementsprechend sind etwaige Verbindlichkeiten, die im Namen eines Fonds der Gesellschaft entstanden oder diesem zuzuordnen sind, ausschließlich aus den Vermögenswerten des betreffenden Fonds zu begleichen, und weder die Gesellschaft noch ein Verwaltungsratsmitglied, Konkursverwalter, Revisor, Insolvenzverwalter, kommissarischer Insolvenzverwalter oder eine sonstige Personen dürfen die Vermögenswerte dieses Fonds zum Ausgleich von Verbindlichkeiten im Namen eines anderen Fonds der Gesellschaft verwenden oder sind verpflichtet, sie hierzu zu verwenden, unabhängig davon, wann diese Verbindlichkeit entstanden ist.

## 8. ÄNDERUNGEN AM VERKAUFSPROSPEKT, AN DER ERGÄNZUNG, DER GRÜNDUNGSURKUNDE UND DER SATZUNG

Am 02. Januar 2024 wurde die Prospektergänzung des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund dahingehend geändert, dass die Gesamtgebühr für alle Anteilsklassen um 25 Basispunkte gesenkt wird, mit Ausnahme von Class R und Class T, bei denen die Gesamtgebühr um 14 bzw. 15 Basispunkte verringert wird.

Am 10. Januar 2024 wurde der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für die betreffenden Anteilsklassen des Euro Short-Term Fund und des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund bis zum 18. Januar 2025 bzw. 17. Januar 2025 verlängert. Am selben Tag wurde eine überarbeitete Ergänzung für den Asia Strategic Interest Bond Fund herausgegeben, um die bisherigen Angaben besser an die meisten anderen Fonds der Gesellschaft anzugleichen und festzulegen, welche Anlagen mindestens zwei Drittel des Portfolios ausmachen müssen.

Am 01. Februar 2024 wurde die Prospektergänzung des Emerging Markets Bond ESG Fund dahingehend geändert, dass die Gesamtgebühr für die institutionellen Anteilsklassen um 7 Basispunkte verringert und die anteilige Senkung auf die anderen relevanten Anteilsklassen des Fonds angewendet wird.

Am 21. März 2024 wurde der Prospekt aktualisiert, um bestimmte geringfügige Änderungen aufzunehmen, einschließlich, aber nicht beschränkt auf folgende Punkte: Aktualisierungen der Risikofaktoren, Klarstellungen zu den Offenlegungen der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, erweiterte allgemeine Angaben zu ESG-Anlagen, Aktualisierungen des Abschnitts über die Besteuerung, Aktualisierungen der Biografien der Verwaltungsratsmitglieder, Änderungen der Bestimmungen zur Geldwäscheprävention und Aufnahme von Angaben zu ereignisgebundenen Anleihen in die Ergänzungen bestimmter Fonds, die ebenfalls zu diesem Datum aktualisiert wurden.

Am 08. April 2024 wurde die Prospektergänzung des PIMCO Climate Bond Fund aktualisiert, um die Ausschlussstrategie des Fonds mit der auf der Website von PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (PGAIL) veröffentlichten Richtlinie bezüglich des Ausschlusses nicht nachhaltiger Anlagen in Einklang zu bringen und die bisherigen Angaben in Bezug auf das Engagement der Emittenten weiter zu präzisieren. Darüber hinaus wurde der Anhang der Fondsergänzung aktualisiert, um diese Änderungen widerzuspiegeln und bestimmte geringfügige Änderungen aufzunehmen, darunter folgende: Klarstellungen zum nachhaltigen Investitionsziel des Fonds; Aktualisierung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die zur Messung der Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels des Fonds herangezogen werden; Änderungen, um zu präzisieren, wie die Bewertung der nachhaltigen Investitionen des Fonds erfolgt, um sicherzustellen, dass sie das nachhaltige Investitionsziel des Fonds nicht erheblich beeinträchtigen, und zur Bestätigung, dass die Investitionen des Fonds keine taxonomiekonformen Aktivitäten im Bereich Gas und Kernenergie umfassen.

Zu diesem Datum wurde auch die Prospektergänzung des Low Duration Income Fund aktualisiert, um die Anlagepolitik zu ändern und das maximal zulässige nicht auf USD lautende Währungsengagement des Fonds von 10 % auf 15 % des Gesamtvermögens zu erhöhen.

Am 23. April 2024 wurde der Global High Yield Bond ESG Fund von der Zentralbank zugelassen, und die Ergänzung dieses Fonds wurde in den konsolidierten Verkaufsprospekt aufgenommen.

Am 30. Mai 2024 wurde die Prospektergänzung des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund aktualisiert, um den Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für alle relevanten Anteilsklassen um ein Jahr bis zum 1. Juni 2025 zu verlängern, und die Prospektergänzung des Euro Credit Fund wurde aktualisiert, um den Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse H Institutional um ein Jahr bis zum 30. Juni 2025 zu verlängern.

An der Gründungsurkunde und der Satzung der Gesellschaft wurden während des Berichtszeitraums keine Änderungen vorgenommen.

## 9. GEBÜHREN UND KOSTEN

### (a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren

Mit Ausnahme der Anteile der Klassen BN Retail und BE Retail, wie in der entsprechenden Ergänzung des Fonds angegeben, darf die Gesamtgebühr 2,50 % p. a. des NIW jedes Fonds nicht übersteigen. Die Gesamtgebühr ist die Verwaltungsgebühr zzgl. einer etwaigen Servicegebühr, Bestandspflegegebühr oder Vertriebsgebühr, wie in der Fondsergänzung in Bezug auf eine Anteilsklasse angegeben.

### (b) Verwaltungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder liefert für jeden Fonds, wie im Prospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste, für die jeder Fonds eine einzige Verwaltungsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr (wie im Verkaufsprospekt definiert) für jeden Fonds läuft an jedem Handelstag (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Verwaltungsgebühr vollständig oder teilweise an die Anlageberatungsgesellschaften entrichten, um die von diesen erbrachten Anlageberatungs- und anderen Dienste zu bezahlen und damit die Anlageberatungsgesellschaften die Kosten für die Administrations-, Verwahr- und anderen Dienste begleichen können, die die Verwaltungsgesellschaft für die Fonds erbracht hat.

Die Verwaltungsgebühr für die einzelnen Klassen der einzelnen Fonds (angegeben in Prozent pro Jahr ihres NIW) lautet wie folgt:

	Inst'l, Inv, Admin Classes (%)	H Inst'l (%)	BE Retail, BM Retail, E Class, G Retail, M Retail, N Retail, T Class (%)	R Class (%)	UM Retail, Class (%)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	0,65	0,82	1,55	k. A.	k. A.
Asia Strategic Interest Bond Fund	0,65	k. A.	1,50	k. A.	k. A.
PIMCO Balanced Income and Growth Fund <sup>(1)</sup>	0,95	1,12	2,15	k. A.	1,60
PIMCO Capital Securities Fund	0,79	k. A.	1,69	0,93	k. A.
PIMCO Climate Bond Fund	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.
Commodity Real Return Fund	0,74	0,91	1,64	k. A.	k. A.
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	0,65	0,82	1,55	k. A.	k. A.
Diversified Income Fund	0,69	0,86	1,59	k. A.	0,55
Diversified Income Duration Hedged Fund	0,69	k. A.	1,59	k. A.	k. A.
Diversified Income ESG Fund	0,72	k. A.	1,62	k. A.	k. A.
Dynamic Bond Fund	0,90	1,07	1,80	0,99	k. A.
Dynamic Multi-Asset Fund	0,85	1,02	1,85	k. A.	k. A.
Emerging Local Bond Fund	0,89	1,06	1,89	k. A.	k. A.
Emerging Local Bond ESG Fund	0,92	k. A.	1,92	k. A.	k. A.
Emerging Markets Bond Fund	0,79	0,96	1,69	k. A.	k. A.
Emerging Markets Bond ESG Fund	0,82	k. A.	1,72	k. A.	k. A.
Emerging Markets Corporate Bond Fund	0,95	k. A.	1,85	k. A.	k. A.
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund <sup>(2)</sup>	0,80	k. A.	1,70	k. A.	k. A.
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	0,85	k. A.	1,75	k. A.	k. A.
PIMCO ESG Income Fund	0,59	k. A.	1,49	0,82	k. A.
Euro Bond Fund	0,46	k. A.	1,36	k. A.	k. A.
Euro Credit Fund <sup>(3)</sup>	0,46	0,38	1,36	k. A.	k. A.
Euro Income Bond Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.
Euro Long Average Duration Fund	0,46	k. A.	1,36	k. A.	k. A.
Euro Short-Term Fund <sup>(4)</sup>	0,29	k. A.	1,04	k. A.	k. A.

	Inst'l, Inv, Admin Classes (%)	H Inst'l (%)	BE Retail BM Retail E Class, G Retail, M Retail, N Retail, T Class (%)	R Class (%)	UM Retail, Class (%)
PIMCO European High Yield Bond Fund	0,55	k. A.	1,45	k. A.	k. A.
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund <sup>(5)</sup>	0,32	0,49	0,82	k. A.	k. A.
Global Advantage Fund	0,70	k. A.	1,70	k. A.	k. A.
Global Bond Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39
Global Bond ESG Fund	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.
Global Bond Ex-US Fund	0,49	0,66	1,39	k. A.	k. A.
Global High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.
Global High Yield Bond ESG Fund	0,58	k. A.	1,48	k. A.	k. A.
Global Investment Grade Credit Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39
Global Investment Grade Credit ESG Fund	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.
Global Low Duration Real Return Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.
Global Real Return Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	k. A.
Income Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.
Income Fund II	0,59	k. A.	1,49	k. A.	k. A.
Inflation Multi-Asset Fund	0,79	0,96	1,69	k. A.	k. A.
Low Average Duration Fund	0,46	0,63	1,36	0,75	k. A.
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.
Low Duration Income Fund	0,55	0,72	1,45	k. A.	k. A.
Low Duration Opportunities Fund	0,49	k. A.	1,20	k. A.	k. A.
Low Duration Opportunities ESG Fund	0,52	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	0,99	k. A.	1,89	k. A.	k. A.
Mortgage Opportunities Fund	0,69	0,86	1,59	k. A.	k. A.
StocksPLUS™ Fund	0,55	0,72	1,45	k. A.	k. A.
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	0,69	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
Strategic Income Fund	0,79	k. A.	1,69	k. A.	k. A.
Total Return Bond Fund	0,50	0,67	1,40	0,77	k. A.
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	1,40	1,57	2,50	k. A.	k. A.
UK Corporate Bond Fund	0,46	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
UK Long Term Corporate Bond Fund	0,46	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
US High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.
US Investment Grade Corporate Bond Fund	0,49	0,66	1,39	k. A.	k. A.
US Short-Term Fund <sup>(6)</sup>	0,45	0,62	0,85	k. A.	k. A.

- (1) Die obige Zahl für Class M Retail berücksichtigt nicht den Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,55 %, wodurch sich die Verwaltungsgebühr von Class M Retail auf 1,60 % reduziert. Die obige Zahl für den Satz von Class BM Retail berücksichtigt nicht den Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,55 %, wodurch sich die Verwaltungsgebühr von Class BM Retail auf 1,60 % reduziert. Der Gebührenverzicht endet am 29. November 2028.
- (2) Diese Zahl berücksichtigt für alle Klassen einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,15 % p.a. Der Verzicht auf die Gebühr läuft zum 01. Juni 2025 ab und kann bis zu dem Zeitpunkt verlängert werden, zu dem die Verwaltungsgesellschaft durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Fonds entscheidet, diese Gebühr aufzuheben oder künftig nicht mehr anzuwenden.
- (3) Der Satz von Class H Institutional berücksichtigt einen Gebührenverzicht durch die Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,25 % p.a. Der Gebührenverzicht endet am 1. Juli 2025 und kann verlängert werden, bis die Verwaltungsgesellschaft nach vorheriger schriftlicher Mitteilung an die Anteilseigner des Fonds beschließt, diese Gebühr für einen zukünftigen Zeitraum aufzuheben, nicht mehr anzuwenden oder zu senken.
- (4) Diese Zahl berücksichtigt für alle Klassen einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,11 % p.a. Der Gebührenverzicht endet am 19. Januar 2025.
- (5) In den Gebühren der Klassen Institutional und H Institutional ist ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,14 % p.a. berücksichtigt. In den Gebühren der Class E wird ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,54 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht endet am 18. Januar 2025.
- (6) Der Satz von Class E berücksichtigt einen Gebührenverzicht durch die Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,30 % p.a. Die Gebührenverzicht verlängern sich bis zu dem Zeitpunkt, zu dem die Verwaltungsgesellschaft durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Fonds entscheidet, diese Gebühr aufzuheben oder künftig nicht mehr anzuwenden.

Der Global High Yield Bond ESG Fund wurde während des Berichtszeitraums aufgelegt.

Die Verwaltungsgebühren für alle Fonds (mit Ausnahme des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund und des Emerging Markets Bond ESG Fund) blieben während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2024 unverändert, mit Ausnahme der oben beschriebenen Änderungen zum Gebührenverzicht.

Die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen H Institutional, BE Retail, BM Retail, E Class, G Retail, M Retail, N Retail, T Class und UM Retail fällt allgemein höher aus als die Verwaltungsgebühr für die anderen Anteilsklassen. Aus dieser höheren Gebühr kann die Verwaltungsgesellschaft die Kosten für Vertriebs-, Mittler- oder andere Dienste begleichen, die Vertriebsstellen, Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder andere Intermediäre den Anteilinhabern dieser Anteilsklassen der Fonds direkt oder indirekt erbringen. Da es sich bei der Verwaltungsgebühr um einen festen Betrag handelt, wird das Risiko von Preiserhöhungen bei den Kosten für durch die Verwaltungsgesellschaft abgedeckte Dienste von der Verwaltungsgesellschaft und nicht von den Anteilinhabern getragen. Die Verwaltungsgesellschaft trägt darüber hinaus das Risiko, dass das Ausgabenniveau für diese Dienste aufgrund eines sinkenden Nettovermögens die Höhe der Verwaltungsgebühr übersteigt. Auf der anderen Seite kämen alle Preissenkungen für von der Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste der Verwaltungsgesellschaft und nicht den Anteilinhabern zugute. Dies betrifft u.a. geringere Kosten (in Prozent des Nettovermögens) aufgrund eines steigenden Nettovermögens.

Aufgrund der Art der Emission von Class Z wird in der Betriebsergebnisrechnung keine Verwaltungsgebühr ausgewiesen (die Class Z werden primär für andere Fonds der Gesellschaft oder für Direktanlagen durch institutionelle Anleger angeboten, die mit den Anlageberatungsgesellschaften oder einem verbundenen Unternehmen von PIMCO eine Anlageverwaltungsvereinbarung oder sonstige Vereinbarung abgeschlossen haben). Um doppelte Gebühren zu vermeiden, wird die Verwaltungsgebühr für die Class Z auf 0,00 % pro Jahr festgesetzt.

#### (c) Anlageberatungsdienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte jedes Fonds. Die Gebühren der Anlageberatungsgesellschaften (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr beglichen.

#### (d) Administrations-, Verwahr- sowie sonstige Dienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste. Diese Dienste beinhalten Administrations-, Übertragungsstellen-, Fondsbuchhaltungs-, Verwahr- und Unterverwahrungsstellen für die jeweiligen Fonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Verwahrstelle (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr bzw. von den Anlageberatungsgesellschaften gezahlt.

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft bestimmte sonstige Dienste. Diese können enthalten: Dienste von Notierungsmaklern, Zahlstellen und anderen Vertretern vor Ort sowie Buchhaltungs-, Prüf-, Rechts- sowie sonstige Dienste qualifizierter Berater, Gesellschaftssekretärsdienste, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungsdienste sowie die Erbringung und Koordination bestimmter Aufsichts-, Administrations- und Anteilinhaberdienste, die für den Betrieb der Teilfonds erforderlich sind. Gebühren und ordentliche Aufwendungen für diese Dienste (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften für die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr gezahlt.

Die Fonds übernehmen sonstige Aufwendungen im Zusammenhang mit ihrem Betrieb, die nicht von der Verwaltungsgebühr abgedeckt werden und die variieren und die Gesamthöhe der Aufwendungen der Fonds beeinflussen können. Hierzu zählen unter anderem Steuern und staatliche Abgaben, Maklergebühren, Provisionen und sonstige Transaktionskosten (einschließlich u. a. Gebühren und Aufwendungen im Zusammenhang mit Due-Diligence-Prüfungen von Anlagen und potenziellen Anlagen und/oder im Zusammenhang mit Verhandlungen über solche Transaktionen), Fremdfinanzierungskosten einschließlich Zinsaufwand, Gründungskosten, außerordentliche Aufwendungen (wie Prozesskosten und Schadenersatzleistungen) sowie die Gebühren und Aufwendungen der unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sowie ihrer Berater.

Die Gesellschaft bezahlte den unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2024 Honorare in Höhe von 75.000 EUR (30. Juni 2023: 90.000 EUR). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Nicht unabhängige Verwaltungsratsmitglieder haben keinen Anspruch auf eine separate Vergütung für ihre Verwaltungsratsmandat der Gesellschaft. Die Verwaltungsrats Honorare sind in den „Sonstigen Aufwendungen“ der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

**Servicegebühr** Die Servicegebühr, die ausschließlich für die Investor Classes anfällt, ist an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen und darf verwendet werden, um Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu vergüten, die Dienste im Zusammenhang mit dem Vertrieb und der Vermarktung von Anteilen erbringen und/oder für die Erbringung bestimmter Anteilinhaberdienstleistungen oder für die Verwaltung von Plänen oder Programmen, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, und um sonstige verbundene Aufwendungen (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) zu erstatten. Die Verwaltungsgesellschaft erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Anteilinhaber der Investor Classes. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten identische Dienstleistungen für die erhobenen Gebühren. Diese Dienste können beinhalten: die Beantwortung von Anteilinhaberanfragen zu den Fonds und ihrer Wertentwicklung, die Unterstützung von Anteilhabern beim Erwerb, der Rücknahme und dem Tausch von Anteilen, die Führung individueller Kontoinformationen und die Bereitstellung von Kontoauszügen an die Anteilinhaber sowie die Führung sonstiger Unterlagen, die für die Anlage der Anteilinhaber der Fonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, können fondsgebundene Versicherungsprodukte sowie Pensions-, Altersvorsorgungs- oder Sparpläne von Arbeitgebern beinhalten. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten Dienstleistungen entsprechend der Vereinbarungen mit den Finanzintermediären, mit denen die Anteilinhaber ein Dienstleistungsverhältnis unterhalten. Die Servicegebühr errechnet sich jährlich aus 0,35 % des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die Investor Classes entfällt. Der Servicegebührensatz blieb während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 unverändert. Die Servicegebühr wird aus dem NIW gezahlt, der auf den NIW der Investor Classes dieser Fonds entfällt. Die Servicegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Servicegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

**Bestandspflegegebühr:** Die Bestandspflegegebühr für Administrative-Klassen ist zahlbar an die Vertriebsstelle für persönliche Dienste, die sie den Anteilhabern der Fonds erbringt, und für die Führung der Anteilhaberkonten, einschließlich der Vergütung und der Aufwendungen (einschließlich Telefon- und Gemeinkosten) von Finanzberatern und sonstigen Mitarbeitern beteiligter oder involvierter Händler, bestimmter Banken oder anderer Finanzintermediäre, die bei der Abwicklung von Kauf- oder Rücknahmeanträgen oder der Abwicklung von Dividendenzahlungen unterstützend tätig sind, den Anteilhabern regelmäßig Informationen über ihre Beteiligung an den Fondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilinhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Fonds angebotener Anlagemöglichkeiten vor dem Hintergrund der Anteilhaberanforderungen erbringen, Anfragen der Anteilinhaber zu diesen Diensten beantworten oder Mitarbeiter für die Erbringung derartiger Dienste schulen.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Administrative-Klassen. Die Bestandspflegegebühr wird auf der Grundlage von jährlich 0,50 % des NIW jedes Fonds berechnet, mit Ausnahme des StocksPLUS™ Fund, dessen Berechnung auf der Grundlage von jährlich 0,75 % erfolgt und der den Administrative-Klassen zuzuordnen ist. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Bestandspflegegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Der Bestandspflegegebührensatz blieb während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 unverändert.

#### (e) Vertriebsgebühr

Die anwendbare Vertriebsgebühr für die Anteilsklassen T Class, BN Retail, BM Retail und BE Retail wird an die Vertriebsstelle für Dienste bezahlt, die diese für Anteilinhaber des Fonds erbracht hat.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Anteilen der T Class. Die Vertriebsgebühr errechnet sich aus 0,40 % p. a. des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die T Class entfällt, außer in Bezug auf den PIMCO Asia High Yield Bond Fund, PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, Dynamic Bond Fund, Euro Bond Fund, Global Bond Fund, Global Bond ESG Fund, Global Bond Ex-US Fund, Global Low Duration Real Return Fund, Global Real Return Fund, Low Duration Opportunities Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und Total Return Bond Fund. Für diese Fonds wird eine Vertriebsgebühr in Höhe von 0,30 % p. a. auf den NIW der T Class dieser Fonds bezahlt.

Nur in Bezug auf die Anteilsklassen BE Retail, BM Retail und BN Retail kann die Vertriebsgebühr, sofern in der entsprechenden Ergänzung angegeben, bis zu 1 % des NIW betragen. Daher kann die Vertriebsgebühr 2,50 % des NIW übersteigen.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Vertriebsgebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

#### (f) Ausgabenbegrenzung (einschließlich Verzicht auf und Nachzahlung von Verwaltungsgebühren)

Gemäß der geltenden Fassung des Verwaltungsvertrags zwischen der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft vom 28. Januar 1998 ist die Verwaltungsgesellschaft mit der Gesellschaft übereingekommen, die gesamten jährlichen Betriebskosten eines Fonds für alle Klassen des Fonds zu verwalten, wobei sie auf ihre Verwaltungsgebühr ganz oder teilweise verzichtet bzw. diese ganz oder teilweise reduziert oder erstattet, falls (und für den Zeitraum, in dem) diese Betriebskosten aufgrund gezahlter Gründungskosten sowie anteiliger Verwaltungsrats Honorare die Summe aus der Verwaltungsgebühr der Klasse dieses Fonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Dienst- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Fondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsrats Honorare) zzgl. 0,0049 % p. a. (täglich auf Basis des Fonds-NIW berechnet) überschreiten.

In jedem Monat, in dem der Verwaltungsvertrag gilt, darf die Verwaltungsgesellschaft von einem Fonds einen beliebigen Anteil der Verwaltungsgebühr wiedererlangen, auf die sie verzichtet, die sie reduziert oder erstattet hat, und dies gemäß dem Verwaltungsvertrag (der „Erstattungsbeitrag“) während der vorangegangenen 36 Monate, vorausgesetzt dieser an die Verwaltungsgesellschaft gezahlte Betrag erfüllt folgende Bedingungen: 1) er darf pro Jahr 0,0049 % vom durchschnittlichen (täglich berechneten) Nettovermögen der Klasse des betreffenden Fonds nicht überschreiten; 2) er liegt nicht über dem Gesamterstattungsbeitrag; 3) enthält keine der Verwaltungsgesellschaft zuvor erstatteten Beträge; bzw. 4) führt nicht dazu, dass eine Klasse eines Fonds einen negativen Ertrag behält.

Die in der Betriebsergebnisrechnung angegebene Verwaltungsgebühr wird vor Berücksichtigung des jeweils gegebenenfalls gewährten Verzichts auf Verwaltungsgebühren angegeben. Die Verzichte auf Verwaltungsgebühren werden in der Betriebsergebnisrechnung unter Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen. Die Verwaltungsgebühr wird der Verwaltungsgesellschaft nach Berücksichtigung des Verzichts gezahlt.

## 10. TRANSAKTIONEN ZWISCHEN VERBUNDENEN PARTEIEN

Bei der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften, den Vertriebsstellen und den Verwaltungsratsmitgliedern handelt es sich um verbundene Parteien der Gesellschaft. An diese Parteien gegebenenfalls zahlbare Gebühren werden in Erläuterung 9 offengelegt.

Zum 30. Juni 2024 hielt die Verwaltungsgesellschaft 1.226.060 (31. Dezember 2023: 1.193.662) Anteile des US Short-Term Fund.

Jeder der Fonds kann in die anderen Fonds der Gesellschaft und/oder andere Organismen für gemeinsame Anlagen investieren, die von der Verwaltungsgesellschaft oder mit dieser verbundenen Unternehmen verwaltet werden („verbundene Fonds“).

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Die folgenden Fonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Fonds der Gesellschaft eliminiert.

Fonds	30. Jun. 2024 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income ESG Fund	Emerging Markets Bond ESG Fund
Diversified Income ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	Emerging Local Bond ESG Fund
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Low Duration Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Low Duration Opportunities Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Total Return Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund

Die folgenden Fonds hielten zum 31. Dezember 2023 Umbrellafonds-interne Überkreuzinvestitionen. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft im vergleichenden Finanzstatus der Fonds eliminiert.

Fonds	31. Dez. 2023 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income ESG Fund	Emerging Markets Bond ESG Fund
Diversified Income ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund

Fonds	31. Dez. 2023 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	Emerging Local Bond ESG Fund
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Low Duration Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Low Duration Opportunities Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Total Return Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund

Die folgenden Fonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft in der vergleichenden Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen der Fonds eliminiert.

Fonds	30. Jun. 2023 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Emerging Local Bond Fund	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	Emerging Local Bond ESG Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund

	30. Jun. 2023
	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Low Duration Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Low Duration Opportunities Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Einige Fonds legen in die Z Class des PIMCO China Bond Fund, einem Fonds von PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c., und PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, einem Fonds von PIMCO Select Funds plc an, die als verbundene Fonds gelten. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Z Class und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Z Class beider Fonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Fonds investieren in den PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, den PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF, den PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF und den PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, die alle Fonds von PIMCO ETFs plc sind und als mit der Gesellschaft verbunden gelten. Da diese Fonds keine gebührenfreien Anteilsklassen haben, wird die Verwaltungsgebühr vom anlegenden Fonds und dem zugrunde liegenden verbundenen Zielfonds bezahlt. Ein Verzicht auf die Anlageberatungsgebühr wird daher vor der Zahlung durch den Fonds an die Verwaltungsgesellschaft ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen wird.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 kauften und verkauften die unten angegebenen Fonds Wertpapiere verbundener Fonds und tätigten Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen sowie Käufe und Verkäufe von Anlagen in verbundenen Fonds (Angaben in Tausend):

	30. Jun. 2024	
Fonds	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 880.701	\$ 947.500
Asia Strategic Interest Bond Fund	49.642	49.600
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	145.683	105.480
PIMCO Capital Securities Fund	2.042	7.037
Commodity Real Return Fund	2	100
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	42.749	43.180
Diversified Income Fund	636.699	620.993
Diversified Income Duration Hedged Fund	16.455	18.849
Diversified Income ESG Fund	243	1.202
Dynamic Bond Fund	367.491	360.343
Dynamic Multi-Asset Fund	107.783	194.828
Emerging Local Bond Fund	1.372.991	1.315.194
Emerging Local Bond ESG Fund	1.672	0
Emerging Markets Bond Fund	1.278.090	1.350.461
Emerging Markets Bond ESG Fund	17.418	104.264
Emerging Markets Corporate Bond Fund	50.025	51.800
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	244.585	229.674
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	105	100
PIMCO ESG Income Fund	0	173
Euro Bond Fund	35.561	53.398
Euro Credit Fund	0	10.359
Euro Income Bond Fund	7.105	25.855
Euro Long Average Duration Fund	1.659	43.239
PIMCO European High Yield Bond Fund	17.265	6.904
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	76.632	2.307
Global Advantage Fund	69.804	76.400
Global Bond Fund	1.866.023	1.659.511
Global Bond ESG Fund	11.134	10.396

	30. Jun. 2024	
Fonds	Käufe	Verkäufe
Global Bond Ex-US Fund	\$ 377.793	\$ 338.453
Global High Yield Bond Fund	909.062	797.434
Global Investment Grade Credit Fund	1.443.302	2.044.216
Global Investment Grade Credit ESG Fund	3.239	26.173
Global Low Duration Real Return Fund	253.608	250.900
Global Real Return Fund	761.717	783.500
Income Fund	4.402.867	3.084.335
Income Fund II	75.984	75.200
Inflation Multi-Asset Fund	45.218	45.770
Low Average Duration Fund	101.560	111.651
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	258.128	315.768
Low Duration Income Fund	115.075	80.409
Low Duration Opportunities Fund	34.280	34.328
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	4.833	3.600
StocksPLUS™ Fund	230.114	78.300
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	215	100
Strategic Income Fund	90.854	90.985
Total Return Bond Fund	806.949	825.700
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	19.326	16.149
UK Corporate Bond Fund	20.273	15.732
UK Long Term Corporate Bond Fund	2.471	2.044
US High Yield Bond Fund	558.596	581.416
US Investment Grade Corporate Bond Fund	106.231	114.600
US Short-Term Fund	99.052	78.743

	30. Jun. 2023	
Fonds	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 423.569	\$ 391.337
Asia Strategic Interest Bond Fund	92.981	99.053
PIMCO Capital Securities Fund	115.634	34.102
PIMCO Climate Bond Fund	294	5.057
Commodity Real Return Fund	549	0
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	6.342	6.452
Diversified Income Fund	262.747	405.020
Diversified Income Duration Hedged Fund	9.813	20.783
Diversified Income ESG Fund	5.821	833
Dynamic Bond Fund	78.348	82.000
Dynamic Multi-Asset Fund	5.681	97.503
Emerging Local Bond Fund	1.053.732	924.477
Emerging Markets Bond Fund	925.922	895.848
Emerging Markets Bond ESG Fund	12.330	11.043
Emerging Markets Corporate Bond Fund	35.549	35.460
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	112.961	116.241
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	101	199
Euro Bond Fund	53.170	107.866
Euro Credit Fund	3.412	416
Euro Income Bond Fund	3.560	25.568
Euro Long Average Duration Fund	22.448	12.114
Euro Short-Term Fund	0	19.129
PIMCO European High Yield Bond Fund	17.655	3.018
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	16.916	38.750
Global Advantage Fund	89.176	85.406
Global Bond Fund	611.120	554.590
Global Bond ESG Fund	11.942	7.052
Global Bond Ex-US Fund	230.398	227.009
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	125.641	140.601
Global High Yield Bond Fund	240.825	313.197
Global Investment Grade Credit Fund	291.803	313.554
Global Investment Grade Credit ESG Fund	106.586	14.830
Global Low Duration Real Return Fund	264.567	276.800
Global Real Return Fund	253.215	250.100
Income Fund	1.014.864	682.726

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	30. Jun. 2023	
	Käufe	Verkäufe
Income Fund II	\$ 60.466	\$ 54.600
Inflation Multi-Asset Fund	52.735	59.781
Low Average Duration Fund	161.690	201.129
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	159.590	142.383
Low Duration Income Fund	62.826	24.129
Low Duration Opportunities Fund	176.229	206.029
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	1.116	3.600
Mortgage Opportunities Fund	0	665
StocksPLUS™ Fund	78.848	8.600
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	412	200
Strategic Income Fund	110.199	116.600
Total Return Bond Fund	705.326	744.063
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	141.935	153.703
UK Corporate Bond Fund	13.291	7.714
UK Long Term Corporate Bond Fund	12.962	1.046
US High Yield Bond Fund	441.483	425.114
US Investment Grade Corporate Bond Fund	9.748	4.779
US Short-Term Fund	51.202	103.402

In der folgenden Tabelle ist der Wert der umlaufenden Anteile im Besitz der Allianz-Gruppe, von Fonds der Gesellschaft, von verbundenen Fonds und von Mitarbeitern der Anlageberatungsgesellschaften in ihrer Eigenschaft als verbundene Parteien der Gesellschaft angegeben. Dabei handelt es sich zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023 um über 20 % des Nettovermögens des Fonds.

Fonds	30. Juni 2024 % gehalten	31. Dez. 2023 % gehalten
Asia Strategic Interest Bond Fund	47,32	59,45
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	57,69	66,02
PIMCO Capital Securities Fund	N/A	20,61
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	24,01	28,67
Emerging Markets Bond ESG Fund	99,93	k. A.
Diversified Income ESG Fund	31,98	100,00
Dynamic Multi-Asset Fund	26,22	36,16
Emerging Local Bond ESG Fund	23,75	k. A.
Emerging Markets Bond Fund	54,99	26,97
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	30,40	54,67
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	21,10	28,10
Euro Credit Fund	29,39	24,54
Euro Income Bond Fund	24,33	26,70
Euro Short-Term Fund	69,13	36,04
PIMCO European High Yield Bond Fund	90,25	70,58
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	20,85	27,59
Global Bond Ex-US Fund	22,18	21,50
Global High Yield Bond ESG Fund	100,00	k. A.
Global Low Duration Real Return Fund	20,56	23,27
Income Fund II	N/A	20,21
Inflation Multi-Asset Fund	22,60	26,11
Low Duration Opportunities Fund	38,79	35,72
Low Duration Opportunities ESG Fund	100,00	100,00
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	57,46	56,87
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	75,16	79,44
Strategic Income Fund	46,45	46,69
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	43,43	25,56
UK Corporate Bond Fund	22,28	k. A.
US Short-Term Fund	33,32	35,03

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2024 verkaufte der Income Fund Wertpapiere im Wert von 53.558 USD (31. Dezember 2023: 119.273 USD) an Repack Bond Collateral Ltd. (die „Körperschaft“), eine nach dem Recht der Kaimaninseln gegründete befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung und verbundene Partei der Anlageberatungsgesellschaften. Es wurden keine Gebühren von der Körperschaft an die Anlageberatungsgesellschaften gezahlt. Zum 30. Juni 2024 hielt der Income Fund 9.694 Schuldverschreibungen (31. Dezember 2023: 9.694 Schuldverschreibungen) von BNP Paribas Issuance BV., die durch von der Körperschaft begebene Schuldverschreibungen besichert sind. Während des Berichtszeitraums zahlte die Körperschaft an den Income Fund Ausschüttungen in Höhe von insgesamt 37.545 USD (31. Dezember 2023): 73.836 USD).

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2024 investierte der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund in zwei strukturierte Schuldverschreibungen, Aries Capital DAC und Greenleaves Capital Designated Activity Co, die beide rücknehmbare, gewinnberechtigende Anteile von PIMCO Commodities Diversified SP, einem getrennten Portfolio von PIMCO Diversified Strategies SPC, halten. PIMCO Diversified Strategies SPC, eine nach dem Recht der Kaimaninseln gegründete befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung, ist eine verbundene Partei der Anlageberatungsgesellschaft. Es wurden keine Gebühren von PIMCO Diversified Strategies SPC an die Anlageberatungsgesellschaft gezahlt. Zum 30. Juni 2024 belief sich der Wert der vom PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund gehaltenen strukturierten Schuldverschreibungen auf 27.769 USD.

### Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs an Anteilen und Verträgen

Zum 30. Juni 2024 hielt V. Mangala Ananthanarayanan null (31. Dezember 2023: 8.187,77) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 5.319,15 (31. Dezember 2023: 5.319,15) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 3.619,69 (31. Dezember 2023: 3.619,69) Anteile des Global Bond Fund und 27.543,65 (31. Dezember 2023: 27.543,65) Anteile des Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2024 hielt Ryan P. Blute 28.827,68 (31. Dezember 2023: 28.827,68) Anteile des Low Average Duration Fund und 50.751,14 (31. Dezember 2023: 50.751,14) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2024 hielt Craig A. Dawson 18.118,23 (31. Dezember 2023: 18.118,23) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 8.164,92 (31. Dezember 2023: 97.370,98) Anteile des Low Duration Income Fund und 1.775,83 (31. Dezember 2023: 92.850,51) Anteile des Low Duration Opportunities Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2024 hielt David M. Kennedy 16.786,79 (31. Dezember 2023: 16.786,79) Anteile des PIMCO Balanced Income and Growth Fund, 4.061,00 (31. Dezember 2023: 4.186,59) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 21.030,49 (31. Dezember 2023: null) Anteile des Global Investment Grade Credit Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 hielt kein anderes Verwaltungsratsmitglied eine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Die Gesellschaft hatte zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 keine Mitarbeiter.

## 11. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Transaktionen, die mit der Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle eines OGAW, den Beauftragten oder Unterbeauftragten einer solchen Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (unter Ausschluss von konzernfremden, von einer Verwahrstelle bestellten Unterverwahrstellen) oder angeschlossenen Unternehmen oder Konzerngesellschaften einer solchen Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle oder von entsprechenden Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Personen“) durchgeführt werden, müssen so durchgeführt werden, als wären sie unter gewöhnlichen geschäftlichen Bedingungen ausgehandelt worden, und nur dann, wenn sie im besten Interesse der Anteilhaber sind. Der Verwaltungsrat ist davon überzeugt, dass Vorkehrungen (durch schriftliche Verfahren nachgewiesen) getroffen wurden, um sicherzustellen, dass Transaktionen mit verbundenen Parteien wie oben beschrieben durchgeführt werden, und dass diese Vorkehrungen während des Berichtszeitraums eingehalten wurden.

## 12. WECHSELKURSE

Um einen gemeinsamen Abschluss für die Fonds und Gesamtbeträge für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge in der Aufstellung der Aktiva und Passiva zu dem am 30. Juni 2024 geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/EUR 0,93305) (31. Dezember 2023: USD/EUR 0,90526) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/GBP 0,79108) (31. Dezember 2023: USD/GBP 0,78444) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen wurden zu einem durchschnittlichen, für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024 geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/EUR 0,92515) (30. Juni 2023: USD/EUR 0,92567) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/GBP 0,79066) (30. Juni 2023: USD/GBP 0,81121) umgerechnet.

In der folgenden Tabelle sind die Wechselkurse angegeben, die zur Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf von der Funktionswährung des jeweiligen Fonds abweichende Währungen lauten, in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar (die Funktionswährungen von Fonds der Gesellschaft) verwendet wurden.

Der Wechselkurs für den Argentinischen Peso („ARS“) zum 30. Juni 2024 enthält einen 49%igen Abschlag (31. Dezember 2023: 21 %) aufgrund der Abweichung zwischen dem offiziellen und dem inoffiziellen Wechselkurs Argentinien.

Fremd-währung	30. Jun. 2024 Darstellungswährung		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67300
ARS	1.451,80392	k. A.	1.354,61000
AUD	1,60478	1,89279	1,49734
BRL	5,95298	k. A.	5,55445
CAD	1,46653	1,72973	1,36835
CHF	0,96307	k. A.	0,89860
CLP	1.011,65207	k. A.	943,92500
CNH	7,82469	9,22900	7,30085
CNY	7,78739	k. A.	7,26605
COP	4.441,49475	k. A.	4.144,15000
CZK	25,04552	k. A.	23,36880
DKK	7,45745	8,79586	6,95820
DOP	k. A.	k. A.	59,10000
EGP	k. A.	k. A.	48,03000
EUR (oder €)	1,00000	1,17947	0,93305
GBP (oder £)	0,84784	1,00000	0,79108
GHS	k. A.	k. A.	15,30000
HKD	8,36758	k. A.	7,80740
HUF	394,92521	465,80314	368,48615
IDR	17.549,91410	k. A.	16.375,00000
ILS	4,03750	k. A.	3,76720
INR	89,37059	k. A.	83,38750
JPY (oder ¥)	172,40178	203,34304	160,86000
KES	k. A.	k. A.	129,25000
KRW	1.475,26453	k. A.	1.376,50000
KWD	0,32876	k. A.	0,30675
KZT	k. A.	k. A.	473,61000
MXN	19,59749	23,11469	18,28550
MYR	5,05598	k. A.	4,71750
NGN	k. A.	k. A.	1.515,00000
NOK	11,41146	13,45950	10,64750
NZD	1,75884	2,07450	1,64109
PEN	k. A.	k. A.	3,83075
PHP	62,81422	k. A.	58,60900
PKR	k. A.	k. A.	278,30000
PLN	4,30849	k. A.	4,02005
PYG	k. A.	k. A.	7.539,44000
RON	k. A.	k. A.	4,64400
RSD	k. A.	k. A.	109,17500
RUB	92,43848	k. A.	86,25000
SEK	11,35005	13,38707	10,59020
SGD	1,45249	1,71317	1,35525
THB	39,33056	k. A.	36,69750
TRY	35,13573	41,44160	32,78350
TWD	34,76919	k. A.	32,44150
UGX	k. A.	k. A.	3.710,00000
USD (oder \$)	1,07175	1,26410	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	39,43500
UZS	k. A.	k. A.	12.557,67000
VND	k. A.	k. A.	25.455,00000
ZAR	19,57016	k. A.	18,26000
ZMW	k. A.	k. A.	23,97500

Fremd-währung	31. Dez. 2023 Darstellungswährung		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67275
ARS	1.077,45365	k. A.	975,38000
AUD	1,61889	1,86825	1,46552
BRL	5,36595	k. A.	4,85760
CAD	1,45659	1,68095	1,31860
CHF	0,92973	1,07294	0,84165
CLP	964,67439	k. A.	873,28500
CNH	7,86577	9,07734	7,12060
CNY	7,83440	k. A.	7,09220
COP	4.279,41462	k. A.	3.874,00000
CZK	24,68849	k. A.	22,34960
DKK	7,45457	8,60279	6,74835
DOP	k. A.	k. A.	58,06000
EGP	k. A.	k. A.	30,92500
EUR (oder €)	1,00000	1,15403	0,90526
GBP (oder £)	0,86653	1,00000	0,78444
GHS	k. A.	k. A.	11,91500
HKD	8,62572	k. A.	7,80855
HUF	382,21508	441,08775	346,00555
IDR	17.008,29813	k. A.	15.397,00000
ILS	3,97773	k. A.	3,60090
INR	91,92208	k. A.	83,21375
JPY (oder ¥)	155,73358	179,72125	140,98000
KES	k. A.	k. A.	157,00000
KRW	1.422,67891	k. A.	1.287,90000
KZT	k. A.	k. A.	455,89000
MXN	18,70670	21,58809	16,93450
MYR	k. A.	k. A.	4,59500
NGN	k. A.	k. A.	897,50000
NOK	11,21850	12,94648	10,15570
NZD	1,74469	2,01342	1,57941
PEN	4,09008	k. A.	3,70260
PHP	k. A.	k. A.	55,37500
PLN	4,34376	k. A.	3,93225
QAR	k. A.	k. A.	3,64100
RON	k. A.	k. A.	4,50360
RSD	k. A.	k. A.	106,13000
RUB	98,75572	k. A.	89,40000
SEK	11,13250	12,84724	10,07785
SGD	1,45714	1,68159	1,31910
THB	k. A.	k. A.	34,13250
TRY	32,62474	37,64993	29,53400
TWD	33,90226	k. A.	30,69050
UGX	k. A.	k. A.	3.780,00000
USD (oder \$)	1,10465	1,27480	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	39,04000
VND	k. A.	k. A.	24.262,00000
ZAR	20,20129	23,31290	18,28750
ZMW	k. A.	k. A.	25,71030

### 13. FINANZIELLE RISIKEN

Durch ihre Aktivitäten sind die Fonds verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt, z. B. dem Marktrisiko (einschließlich Preisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), dem Kreditrisiko und dem Liquiditätsrisiko.

Der allgemeine Risikomanagementprozess der Fonds konzentriert sich auf die Unvorhersehbarkeit der Finanzmärkte und versucht, potenziell nachteilige Effekte auf die finanzielle Entwicklung der Fonds zu minimieren. Weitere Einzelheiten zu den verschiedenen Risiken, denen der Fonds ausgesetzt sein kann, finden Sie im Prospekt.

Die Zielsetzungen und Richtlinien des Finanzrisikomanagements der Gesellschaft entsprechen auch weiterhin denjenigen, die im geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 angegeben sind.

## 14. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN FÜR DIE IN HONGKONG VERTRIEBENEN FONDS

Verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind jene, die im Code on Unit Trusts and Mutual Funds der Securities and Futures Commission of Hong Kong (der „SFC-Code“) definiert sind. Alle Transaktionen, die während des Geschäftsjahres zwischen den durch die SFC zugelassenen Fonds („durch die SFC zugelassene Fonds“), wie im Abschnitt zu den allgemeinen Merkmalen des Halbjahresberichts beschrieben, und der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften und/oder den Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und den Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft sowie deren jeweiligen verbundenen Personen eingegangen wurden, wurden im Rahmen der normalen Geschäftstätigkeit und zu den üblichen Geschäftsbedingungen abgeschlossen.

Die folgenden Transaktionen wurden in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 über einen Broker ausgeführt, bei dem es sich um eine verbundene Person der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft handelt:

Fonds	30. Jun. 2024		30. Jun. 2023	
	Summe Käufe und Verkäufe (Tsd.)	% der Summe Käufe und Verkäufe	Summe Käufe und Verkäufe (Tsd.)	% der Summe Käufe und Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 820.673	8,71	\$ 6.172.015	30,52
Asia Strategic Interest Bond Fund	116.470	15,69	153.280	12,91
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	413.208	4,24	k. A.	k. A.
Commodity Real Return Fund	12.740.023	27,52	528.194	2,04
Diversified Income Fund	2.710.882	1,52	11.268.415	3,34
Emerging Local Bond Fund	1.830.598	3,28	863.206	2,11
Emerging Markets Bond Fund	1.032.277	4,13	844.035	5,55
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	28.872	5,77	53.663	2,76
Global Bond Fund	2.911.740	0,90	6.877.936	2,10
Global High Yield Bond Fund	265.166	1,40	903.931	4,69
Global Investment Grade Credit Fund	1.064.468	1,21	5.551.222	3,04
Global Real Return Fund	65.620.568	36,75	356.843	0,81
Income Fund	28.327.869	1,78	248.076.525	12,74
Income Fund II	154.713	3,11	3.030	0,41
Low Average Duration Fund	2.716.346	12,45	689.689	4,27
Total Return Bond Fund	421.391	0,63	1.936.170	3,62
US High Yield Bond Fund	698.855	12,52	886.047	16,59

In den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 wurde keine Provision für die Transaktionen in der vorstehenden Tabelle erhoben.

Weitere Einzelheiten zu den Anteilen, die zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 von Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft an durch die SFC zugelassenen Fonds gehalten wurden, sind Erläuterung 10 zu entnehmen. Weitere Einzelheiten zu den Gebühren, die in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 an Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft gezahlt wurden, finden Sie in Erläuterung 9.

Einzelheiten zum Wert der umlaufenden Anteile, die in den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2024 und 31. Dezember 2023 durch verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften gehalten wurden und über 20 % des Nettovermögens von durch die SFC zugelassenen Fonds betragen, sind Erläuterung 10 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die an die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften gezahlt wurden, sind Erläuterung 9 und der Betriebsergebnisrechnung zu entnehmen.

Verwaltungsratsmitglieder und leitende Angestellte der Verwahrstelle hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024 und im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 keine Anteile der durch die SFC zugelassenen Fonds. Wie in Erläuterung 9 angegeben, wurden die Gebühren und Aufwendungen der Verwahrstelle durch die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr oder durch die Anlageberatungsgesellschaften gezahlt. Alle Bankguthaben der durch die SFC zugelassenen Fonds werden entweder von State Street Bank and Trust Co. als Beauftragte der Verwahrstelle oder direkt bei einer Unterverwahrstelle gehalten. Gegebenenfalls wurden den durch die SFC zugelassenen Fonds durch die Verwahrstelle Zinsen auf diese Barsalden gezahlt oder berechnet.

## 15. GRUNDKAPITAL

### (a) Genehmigte Anteile

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft beträgt 38.092 EUR und ist in 30.000 Zeichneranteile zu je 1,27 EUR und 500.000.000.000 gewinnberechtigten Anteile ohne Nennwert aufgeteilt, die ursprünglich als „nicht klassifizierte Anteile“ bezeichnet wurden.

### (b) Zeichneranteile

Bis auf sieben sind die ursprünglichen 30.000 Zeichneranteile zurückgenommen worden. Die Zeichneranteile sind nicht Bestandteil des NIW der Gesellschaft und werden daher im Abschluss nur in Form dieser Erläuterung erwähnt. Nach Ansicht des Verwaltungsrates geben diese Offenlegungen die Art des Geschäftes der Gesellschaft als Investmentfonds wieder.

### (c) Rückgabe- und gewinnberechtigten Anteile

Das ausgegebene gewinnberechtigte Grundkapital entspricht jederzeit dem NIW der Fonds. Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile werden auf Antrag des Anteilinhabers zurückgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert.

## 16. NETTOINVENTARWERTE

Im Folgenden sind das rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhabern zuzuschreibende Nettovermögen der einzelnen Fonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der Nettoinventarwert (NIW) je Anteil der letzten drei Berichtszeiträume (Angaben in Tausend, ausgenommen Beträge je Anteil) aufgeführt. Der in diesem Abschluss angegebene NIW je Anteil kann gemäß FRS 102 erforderliche Anpassungen enthalten. Diese können dazu führen, dass die NIW oder Gesamterlöse der Anteilinhaber von denjenigen abweichen, die in diesem Abschluss angegeben sind. Das Nettovermögen geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen und umlaufenden Anteile kann vom NIW aufgrund gerundeter Werte abweichen:

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	PIMCO Asia High Yield Bond Fund					
Nettovermögen	\$ 2.484.729	\$ 2.434.728	\$ 2.981.392			
Institutional:						
thesaurierend	\$ 1.386.896	\$ 1.472.296	\$ 1.552.047			
ausgegebene und umlaufende Anteile	141.941	164.619	174.453			
NIW je Anteil	\$ 9,77	\$ 8,94	\$ 8,90			
ausschüttend	\$ 115.092	\$ 125.117	\$ 113.734			
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.695	19.073	16.032			
NIW je Anteil	\$ 6,89	\$ 6,56	\$ 7,09			
Institutional AUD (Hedged):						
ausschüttend	AUD 134	AUD 128	AUD 203.422			
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	20	28.372			
NIW je Anteil	AUD 6,79	AUD 6,50	AUD 7,17			
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 2.557	CHF 2.735	CHF 4.094			
ausgegebene und umlaufende Anteile	319	365	527			
NIW je Anteil	CHF 8,02	CHF 7,49	CHF 7,77			
ausschüttend	CHF 1.419	CHF 1.582	CHF 1.912			
ausgegebene und umlaufende Anteile	228	262	281			
NIW je Anteil	CHF 6,22	CHF 6,04	CHF 6,81			
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 376.766	€ 275.717	€ 498.977			
ausgegebene und umlaufende Anteile	45.138	35.835	63.739			
NIW je Anteil	€ 8,35	€ 7,69	€ 7,83			

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)</b>			
ausschüttend	€ 19.026	€ 20.415	€ 27.728
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.949	3.301	4.056
NIW je Anteil	€ 6,45	€ 6,18	€ 6,84
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 13.625	£ 13.169	£ 14.369
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.598	1.685	1.836
NIW je Anteil	£ 8,53	£ 7,82	£ 7,83
ausschüttend	£ 29.609	£ 17.555	£ 20.785
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.533	2.820	3.068
NIW je Anteil	£ 6,53	£ 6,22	£ 6,77
Institutional SGD (Hedged): ausschüttend	SGD 10.863	SGD 6.313	SGD 385
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.583	959	53
NIW je Anteil	SGD 6,86	SGD 6,58	SGD 7,23
Investor: thesaurierend	\$ 9.184	\$ 6.472	\$ 8.727
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.121	862	1.164
NIW je Anteil	\$ 8,19	\$ 7,51	\$ 7,50
ausschüttend	\$ 40.770	\$ 48.069	\$ 71.688
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.030	7.472	10.304
NIW je Anteil	\$ 6,76	\$ 6,43	\$ 6,96
Investor AUD (Hedged): ausschüttend	AUD 3.632	AUD 3.657	AUD 3.889
ausgegebene und umlaufende Anteile	549	578	557
NIW je Anteil	AUD 6,61	AUD 6,33	AUD 6,99
Investor EUR (Hedged): ausschüttend	€ 870	€ 996	€ 873
ausgegebene und umlaufende Anteile	138	164	130
NIW je Anteil	€ 6,31	€ 6,05	€ 6,69
Investor RMB (Hedged): ausschüttend	CNH 1.804	CNH 1.683	CNH 13.234
ausgegebene und umlaufende Anteile	27	26	182
NIW je Anteil	CNH 67,89	CNH 65,29	CNH 72,74
Investor SGD (Hedged): ausschüttend	SGD 3.089	SGD 2.963	SGD 4.112
ausgegebene und umlaufende Anteile	468	467	591
NIW je Anteil	SGD 6,61	SGD 6,34	SGD 6,96
Administrative: ausschüttend	\$ 29.621	\$ 22.518	\$ 28.245
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.294	3.431	3.980
NIW je Anteil	\$ 6,90	\$ 6,56	\$ 7,10
Class E: thesaurierend	\$ 50.841	\$ 51.171	\$ 61.585
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.745	6.290	7.540
NIW je Anteil	\$ 8,85	\$ 8,14	\$ 8,17
ausschüttend	\$ 49.516	\$ 47.824	\$ 56.633
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.181	7.288	7.981
NIW je Anteil	\$ 6,90	\$ 6,56	\$ 7,10
Class E CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 771	CHF 690	CHF 1.012
ausgegebene und umlaufende Anteile	99	95	133
NIW je Anteil	CHF 7,77	CHF 7,28	CHF 7,63
ausschüttend	CHF 203	CHF 198	CHF 245
ausgegebene und umlaufende Anteile	33	33	36
NIW je Anteil	CHF 6,22	CHF 6,04	CHF 6,81
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 45.932	€ 41.927	€ 48.877
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.687	5.605	6.365
NIW je Anteil	€ 8,08	€ 7,48	€ 7,68
ausschüttend	€ 8.739	€ 8.111	€ 8.314
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.355	1.312	1.217
NIW je Anteil	€ 6,45	€ 6,18	€ 6,83

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)</b>			
Class E HKD (Unhedged): ausschüttend	HKD 5.545	HKD 5.306	HKD 6.334
ausgegebene und umlaufende Anteile	807	812	897
NIW je Anteil	HKD 6,87	HKD 6,54	HKD 7,06
Class E SGD (Hedged): ausschüttend	SGD 24.159	SGD 12.291	SGD 15.239
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.620	1.919	2.168
NIW je Anteil	SGD 6,67	SGD 6,40	SGD 7,03
H Institutional: thesaurierend	\$ 171	\$ 1.327	\$ 1.323
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	172	172
NIW je Anteil	\$ 8,42	\$ 7,71	\$ 7,69
ausschüttend	\$ 317	\$ 328	\$ 547
ausgegebene und umlaufende Anteile	47	51	79
NIW je Anteil	\$ 6,71	\$ 6,38	\$ 6,90
M Retail: ausschüttend II	\$ 15.456	\$ 18.245	\$ 17.613
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.436	2.999	2.637
NIW je Anteil	\$ 6,34	\$ 6,08	\$ 6,68
M Retail HKD (Unhedged): ausschüttend II	HKD 1.872	HKD 1.741	HKD 1.797
ausgegebene und umlaufende Anteile	297	288	270
NIW je Anteil	HKD 6,31	HKD 6,05	HKD 6,65
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II	SGD 8.308	SGD 7.118	SGD 8.881
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.353	1.199	1.342
NIW je Anteil	SGD 6,14	SGD 5,94	SGD 6,62
Class Z: thesaurierend	\$ 205.024	\$ 187.047	\$ 230.136
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.248	20.248	25.207
NIW je Anteil	\$ 10,13	\$ 9,24	\$ 9,13
<b>Asia Strategic Interest Bond Fund</b>			
Nettvermögen	\$ 214.250	\$ 177.208	\$ 313.987
Institutional: thesaurierend	\$ 1.098	\$ 64	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	102	6	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,73	\$ 10,26	k. A.
ausschüttend	\$ 78.601	\$ 34.211	\$ 54.459
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.736	4.306	6.776
NIW je Anteil	\$ 8,07	\$ 7,94	\$ 8,04
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 10	€ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,50	€ 10,13	k. A.
ausschüttend	€ 194	€ 10.955	€ 97.916
ausgegebene und umlaufende Anteile	25	1.445	12.495
NIW je Anteil	€ 7,64	€ 7,58	€ 7,84
Institutional GBP (Hedged): ausschüttend	£ 390	£ 351	£ 205
ausgegebene und umlaufende Anteile	49	44	26
NIW je Anteil	£ 7,98	£ 7,89	£ 8,04
Institutional SGD (Hedged): ausschüttend	SGD 25.186	SGD 15.313	SGD 3.799
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.158	1.934	467
NIW je Anteil	SGD 7,98	SGD 7,92	SGD 8,13
Investor: thesaurierend	\$ 11	\$ 265	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	26	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,69	\$ 10,25	k. A.
ausschüttend	\$ 11	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,24	\$ 10,11	k. A.

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 10	€ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,46	€ 10,11	k. A.
ausschüttend	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,07	€ 10,03	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 2.459	\$ 2.472	\$ 806
ausgegebene und umlaufende Anteile	265	277	94
NIW je Anteil	\$ 9,30	\$ 8,93	\$ 8,62
ausschüttend	\$ 17.192	\$ 17.469	\$ 24.409
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.443	2.511	3.450
NIW je Anteil	\$ 7,04	\$ 6,96	\$ 7,08
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 6.202	€ 5.955	€ 5.640
ausgegebene und umlaufende Anteile	714	708	680
NIW je Anteil	€ 8,68	€ 8,41	€ 8,29
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 15.757	€ 18.078	€ 21.244
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.036	1.275	1.500
NIW je Anteil	€ 15,21	€ 14,18	€ 14,17
Class E HKD (Unhedged):			
ausschüttend	HKD 1.694	HKD 2.994	HKD 2.973
ausgegebene und umlaufende Anteile	211	377	367
NIW je Anteil	HKD 8,04	HKD 7,95	HKD 8,09
Class E SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 3.868	SGD 3.298	SGD 300
ausgegebene und umlaufende Anteile	490	419	37
NIW je Anteil	SGD 7,89	SGD 7,87	SGD 8,13
M Retail HKD (Unhedged):			
ausschüttend	HKD 28.522	HKD 29.265	HKD 31.879
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.654	4.830	5.174
NIW je Anteil	HKD 6,13	HKD 6,06	HKD 6,16
Class Z:			
thesaurierend	\$ 65.302	\$ 65.348	\$ 93.351
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.732	7.062	10.610
NIW je Anteil	\$ 9,70	\$ 9,25	\$ 8,80
	<b>PIMCO Balanced Income and Growth Fund</b>		
Nettovermögen	\$ 992.729	\$ 670.116	\$ 750.076
Institutional:			
thesaurierend	\$ 33.005	\$ 31.079	\$ 30.140
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.389	1.413	1.526
NIW je Anteil	\$ 23,75	\$ 22,00	\$ 19,74
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 305.817	€ 148.956	€ 204.979
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.680	7.756	11.632
NIW je Anteil	€ 20,83	€ 19,21	€ 17,62
Institutional GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 511	£ 477	£ 3.301
ausgegebene und umlaufende Anteile	45	45	331
NIW je Anteil	£ 11,34	£ 10,60	£ 9,99
Institutional RMB (Hedged):			
thesaurierend	CNH 8.191	CNH 7.574	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	73	73	k. A.
NIW je Anteil	CNH 111,90	CNH 103,47	k. A.
ausschüttend	CNH 82	CNH 76	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	CNH 108,42	CNH 102,34	k. A.

	PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Institutional RMB (Unhedged):			
thesaurierend	CNH 84	CNH 76	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	CNH 114,97	CNH 103,83	k. A.
ausschüttend	CNH 84	CNH 76	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	CNH 111,45	CNH 102,71	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 12.169	\$ 11.288	\$ 10.303
ausgegebene und umlaufende Anteile	695	695	704
NIW je Anteil	\$ 17,51	\$ 16,24	\$ 14,63
BM Retail:			
nichtkumulierend	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,02	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 34.610	\$ 31.174	\$ 32.627
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.744	1.686	1.942
NIW je Anteil	\$ 19,85	\$ 18,49	\$ 16,80
ausschüttend	\$ 15.702	\$ 12.347	\$ 13.011
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.577	1.302	1.448
NIW je Anteil	\$ 9,95	\$ 9,48	\$ 8,98
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 182.273	€ 230.322	€ 217.239
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.473	14.269	14.494
NIW je Anteil	€ 17,40	€ 16,14	€ 14,99
ausschüttend	€ 42.731	€ 47.057	€ 49.389
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.845	5.608	6.071
NIW je Anteil	€ 8,82	€ 8,39	€ 8,14
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 11	\$ 10	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 11,32	\$ 10,49	\$ 9,43
ausschüttend	\$ 72	\$ 10	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	7	1	1
NIW je Anteil	\$ 10,34	\$ 9,79	\$ 9,18
M Retail:			
thesaurierend	\$ 15	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,20	\$ 10,41	k. A.
nichtkumulierend	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,05	k. A.	k. A.
ausschüttend	\$ 12	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,93	\$ 10,37	k. A.
ausschüttend II	\$ 537	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	50	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,77	\$ 10,35	k. A.
M Retail HKD (Unhedged):			
thesaurierend	HKD 88	HKD 81	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	8	k. A.
NIW je Anteil	HKD 11,20	HKD 10,40	k. A.
ausschüttend	HKD 88	HKD 81	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	8	k. A.
NIW je Anteil	HKD 10,93	HKD 10,37	k. A.
ausschüttend II	HKD 88	HKD 81	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	8	k. A.
NIW je Anteil	HKD 10,76	HKD 10,34	k. A.

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Forts.)</b>			
M Retail SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 1.654	SGD 1.420	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	148	137	k. A.
NIW je Anteil	SGD 11,20	SGD 10,37	k. A.
ausschüttend	SGD 605	SGD 14	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	55	1	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,93	SGD 10,33	k. A.
ausschüttend II	SGD 4.097	SGD 14	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	381	1	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,77	SGD 10,31	k. A.
UM Retail:			
ausschüttend II	\$ 30.652	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.002	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,21	k. A.	k. A.
UM Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 231.354	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.672	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,20	k. A.	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	\$ 119.780	\$ 110.390	\$ 156.684
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.669	6.669	10.644
NIW je Anteil	\$ 17,96	\$ 16,55	\$ 14,72
<b>PIMCO Capital Securities Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 4.704.938	\$ 5.137.886	\$ 5.721.591
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.090.970	\$ 1.271.099	\$ 1.352.729
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.942	59.553	69.143
NIW je Anteil	\$ 22,29	\$ 21,34	\$ 19,56
ausschüttend	\$ 208.273	\$ 194.714	\$ 393.584
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.006	19.008	39.825
NIW je Anteil	\$ 10,41	\$ 10,24	\$ 9,88
Institutional AUD (Hedged):			
thesaurierend	AUD 16	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 10,21	k. A.	k. A.
ausschüttend	AUD 8.016	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	802	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 10,00	k. A.	k. A.
Institutional BRL (Hedged):			
thesaurierend	\$ 15.461	\$ 13.282	\$ 25.163
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.594	1.272	3.040
NIW je Anteil	\$ 9,70	\$ 10,44	\$ 8,28
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 32.243	CHF 36.703	CHF 52.485
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.996	2.326	3.478
NIW je Anteil	CHF 16,16	CHF 15,78	CHF 15,09
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 811.403	€ 1.018.876	€ 1.198.101
ausgegebene und umlaufende Anteile	53.903	70.150	88.171
NIW je Anteil	€ 15,05	€ 14,52	€ 13,59

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)</b>			
ausschüttend	€ 441.147	€ 384.027	€ 383.951
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.438	36.374	36.928
NIW je Anteil	€ 10,65	€ 10,56	€ 10,40
ausschüttend II	€ 4.905	€ 5.467	€ 31.417
ausgegebene und umlaufende Anteile	614	687	3.979
NIW je Anteil	€ 7,99	€ 7,96	€ 7,89
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 47.103	£ 47.691	£ 35.494
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.953	3.119	2.518
NIW je Anteil	£ 15,95	£ 15,29	£ 14,10
ausschüttend	£ 54.908	£ 64.345	£ 67.663
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.785	5.682	6.132
NIW je Anteil	£ 11,48	£ 11,32	£ 11,03
Institutional SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 117.610	SGD 2.530	SGD 178
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.625	295	21
NIW je Anteil	SGD 8,63	SGD 8,56	SGD 8,38
Investor:			
thesaurierend	\$ 192.636	\$ 190.106	\$ 215.127
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.777	13.146	16.173
NIW je Anteil	\$ 15,08	\$ 14,46	\$ 13,30
ausschüttend	\$ 46.994	\$ 50.228	\$ 72.649
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.534	4.925	7.387
NIW je Anteil	\$ 10,36	\$ 10,20	\$ 9,84
Investor AUD (Hedged):			
ausschüttend	AUD 6.588	AUD 14.433	AUD 12.971
ausgegebene und umlaufende Anteile	708	1.568	1.437
NIW je Anteil	AUD 9,30	AUD 9,21	AUD 9,03
Investor CAD (Hedged):			
ausschüttend	CAD 2.856	CAD 4.254	CAD 4.043
ausgegebene und umlaufende Anteile	293	442	432
NIW je Anteil	CAD 9,76	CAD 9,63	CAD 9,35
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 22.788	€ 23.439	€ 23.367
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.750	1.863	1.978
NIW je Anteil	€ 13,02	€ 12,58	€ 11,81
Investor GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 1.769	£ 2.992	£ 2.695
ausgegebene und umlaufende Anteile	200	343	319
NIW je Anteil	£ 8,85	£ 8,72	£ 8,46
Investor RMB (Hedged):			
ausschüttend	k. A.	k. A.	CNH 31.763
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	313
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CNH 101,51
Investor SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 5.035	SGD 3.958	SGD 5.849
ausgegebene und umlaufende Anteile	526	417	630
NIW je Anteil	SGD 9,56	SGD 9,49	SGD 9,29
Administrative:			
thesaurierend	\$ 133.965	\$ 140.565	\$ 141.400
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.366	6.959	7.599
NIW je Anteil	\$ 21,04	\$ 20,20	\$ 18,61
ausschüttend	\$ 72.389	\$ 75.290	\$ 98.383
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.171	5.466	7.402
NIW je Anteil	\$ 14,00	\$ 13,77	\$ 13,29
ausschüttend II	\$ 11	\$ 11	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 9,92	\$ 9,82	\$ 9,60
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 10.567	€ 11.090	€ 13.449
ausgegebene und umlaufende Anteile	603	654	843
NIW je Anteil	€ 17,54	€ 16,96	€ 15,95

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)					
Administrative SGD (Hedged): ausschüttend II	SGD	15	SGD	15	SGD	14
ausgegebene und umlaufende Anteile		2		1		1
NIW je Anteil	SGD	9,68	SGD	9,67	SGD	9,59
Class E: thesaurierend	\$	291.890	\$	305.773	\$	352.622
ausgegebene und umlaufende Anteile		18.997		20.690		25.798
NIW je Anteil	\$	15,37	\$	14,78	\$	13,67
ausschüttend	\$	62.381	\$	60.223	\$	64.556
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.014		5.900		6.556
NIW je Anteil	\$	10,37	\$	10,21	\$	9,85
Class E CHF (Hedged): thesaurierend	CHF	5.724	CHF	5.686	CHF	8.252
ausgegebene und umlaufende Anteile		521		527		793
NIW je Anteil	CHF	10,99	CHF	10,78	CHF	10,41
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€	410.518	€	414.817	€	402.295
ausgegebene und umlaufende Anteile		31.880		33.239		34.146
NIW je Anteil	€	12,88	€	12,48	€	11,78
ausschüttend	€	61.814	€	63.510	€	62.789
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.050		7.303		7.332
NIW je Anteil	€	8,77	€	8,70	€	8,56
M Retail: ausschüttend II	\$	200.615	\$	205.669	\$	218.883
ausgegebene und umlaufende Anteile		22.228		22.969		24.922
NIW je Anteil	\$	9,03	\$	8,95	\$	8,78
M Retail GBP (Hedged): ausschüttend	£	8		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	£	10,01		k. A.		k. A.
M Retail HKD (Unhedged): ausschüttend	HKD	2.506	HKD	2.466	HKD	2.801
ausgegebene und umlaufende Anteile		253		253		298
NIW je Anteil	HKD	9,91	HKD	9,76	HKD	9,40
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II	SGD	59.893	SGD	99.440	SGD	100.715
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.894		11.442		11.653
NIW je Anteil	SGD	8,69	SGD	8,69	SGD	8,64
Class R: ausschüttend	\$	4.540	\$	5.033	\$	4.980
ausgegebene und umlaufende Anteile		434		489		501
NIW je Anteil	\$	10,47	\$	10,30	\$	9,94
Class R EUR (Hedged): ausschüttend	€	2.149	€	2.214	€	3.708
ausgegebene und umlaufende Anteile		252		262		445
NIW je Anteil	€	8,54	€	8,47	€	8,33
Class R GBP (Hedged): ausschüttend	£	1.961	£	2.544	£	2.795
ausgegebene und umlaufende Anteile		212		279		315
NIW je Anteil	£	9,27	£	9,13	£	8,86
Class T: ausschüttend	\$	8.833	\$	8.281	\$	8.517
ausgegebene und umlaufende Anteile		826		787		839
NIW je Anteil	\$	10,69	\$	10,52	\$	10,15
Class T EUR (Hedged): thesaurierend	€	59.785	€	63.046	€	65.092
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.162		5.606		6.106
NIW je Anteil	€	11,58	€	11,25	€	10,66
Class Z: ausschüttend	\$	51.579	\$	73.778	\$	78.203
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.508		6.554		7.202
NIW je Anteil	\$	11,44	\$	11,26	\$	10,86

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)					
Class Z AUD (Hedged): ausschüttend	AUD	68.237	AUD	81.358	AUD	104.790
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.955		8.377		11.002
NIW je Anteil	AUD	9,81	AUD	9,71	AUD	9,52
Nettovermögen	\$	295.492	\$	262.316	\$	292.655
Institutional: thesaurierend	\$	41.528	\$	26.436	\$	27.502
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.308		2.759		3.116
NIW je Anteil	\$	9,64	\$	9,58	\$	8,83
Institutional AUD (Hedged): ausschüttend	AUD	3.079	AUD	2.219		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		304		216		k. A.
NIW je Anteil	AUD	10,14	AUD	10,28		k. A.
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF	117	CHF	819	CHF	940
ausgegebene und umlaufende Anteile		14		94		112
NIW je Anteil	CHF	8,63	CHF	8,76	CHF	8,42
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€	37.484	€	40.309	€	62.757
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.136		4.440		7.351
NIW je Anteil	€	9,06	€	9,08	€	8,54
ausschüttend	€	74.652	€	75.831	€	73.780
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.882		8.881		8.951
NIW je Anteil	€	8,40	€	8,54	€	8,24
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£	34.485	£	28.218	£	32.441
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.653		3.004		3.720
NIW je Anteil	£	9,44	£	9,39	£	8,72
ausschüttend	£	50.309	£	35.033	£	25.204
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.733		3.955		2.978
NIW je Anteil	£	8,78	£	8,86	£	8,46
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend	SEK	45.852	SEK	18.846	SEK	290.215
ausgegebene und umlaufende Anteile		507		208		3.406
NIW je Anteil	SEK	90,39	SEK	90,57	SEK	85,22
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	SGD	5.585	SGD	5.652	SGD	5.576
ausgegebene und umlaufende Anteile		596		602		635
NIW je Anteil	SGD	9,37	SGD	9,39	SGD	8,78
Investor: thesaurierend	\$	11	\$	11		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	10,77	\$	10,72		k. A.
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend	€	2.401		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		239		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	€	10,03		k. A.		k. A.
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK	77	SEK	77	SEK	73
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	SEK	89,30	SEK	89,71	SEK	84,84
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€	12.462	€	16.552	€	15.976
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.422		1.877		1.909
NIW je Anteil	€	8,77	€	8,82	€	8,37
Class Z: thesaurierend	\$	10	\$	10	\$	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	\$	9,83	\$	9,75	\$	8,93

	Commodity Real Return Fund		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Nettovermögen	\$ 798.565	\$ 858.902	\$ 1.369.877
Institutional:			
thesaurierend	\$ 333.196	\$ 311.581	\$ 397.781
ausgegebene und umlaufende Anteile	35.911	35.010	41.220
NIW je Anteil	\$ 9,28	\$ 8,90	\$ 9,65
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 78.420	€ 112.842	€ 225.302
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.960	13.338	23.996
NIW je Anteil	€ 8,75	€ 8,46	€ 9,39
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 49.358	€ 55.160	€ 87.086
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.863	4.639	6.527
NIW je Anteil	€ 12,78	€ 11,89	€ 13,34
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 18.558	£ 18.532	£ 39.019
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.479	1.537	2.963
NIW je Anteil	£ 12,55	£ 12,06	£ 13,17
Institutional GBP (Unhedged):			
ausschüttend	£ 22.256	£ 18.467	£ 17.587
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.744	2.340	1.881
NIW je Anteil	£ 8,11	£ 7,89	£ 9,35
Investor:			
thesaurierend	\$ 20.408	\$ 21.974	\$ 50.111
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.563	2.873	6.022
NIW je Anteil	\$ 7,96	\$ 7,65	\$ 8,32
Class E:			
thesaurierend	\$ 149.265	\$ 162.379	\$ 260.353
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.385	23.016	33.734
NIW je Anteil	\$ 7,32	\$ 7,06	\$ 7,72
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 94.857	€ 111.508	€ 238.920
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.356	17.383	33.254
NIW je Anteil	€ 6,61	€ 6,41	€ 7,18
Class E SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 1.892	SGD 1.207	SGD 2.069
ausgegebene und umlaufende Anteile	181	119	183
NIW je Anteil	SGD 10,48	SGD 10,18	SGD 11,30
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 4.099	\$ 6.125	\$ 3.614
ausgegebene und umlaufende Anteile	505	786	427
NIW je Anteil	\$ 8,11	\$ 7,79	\$ 8,46

	PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022

H Institutional:						
thesaurierend	\$ 10		k. A.			k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1		k. A.			k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,18		k. A.			k. A.
				<b>Diversified Income Fund</b>		
Nettovermögen	\$ 7.746.818	\$ 7.439.798	\$ 8.751.796			
Institutional:						
thesaurierend	\$ 509.553	\$ 624.037	\$ 824.847			
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.357	24.230	35.047			
NIW je Anteil	\$ 26,32	\$ 25,76	\$ 23,54			
ausschüttend	\$ 281.638	\$ 297.569	\$ 352.231			
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.504	22.611	27.897			
NIW je Anteil	\$ 13,10	\$ 13,16	\$ 12,63			
Institutional CAD (Hedged):						
thesaurierend	CAD 491.731	CAD 465.402	CAD 441.412			
ausgegebene und umlaufende Anteile	45.566	43.934	45.218			
NIW je Anteil	CAD 10,79	CAD 10,59	CAD 9,76			
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 8.463	CHF 13.431	CHF 15.646			
ausgegebene und umlaufende Anteile	670	1.065	1.299			
NIW je Anteil	CHF 12,63	CHF 12,61	CHF 12,04			
ausschüttend	CHF 5.178	CHF 5.215	CHF 8.022			
ausgegebene und umlaufende Anteile	737	724	1.111			
NIW je Anteil	CHF 7,02	CHF 7,20	CHF 7,22			
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 870.533	€ 889.868	€ 998.452			
ausgegebene und umlaufende Anteile	52.404	54.327	65.216			
NIW je Anteil	€ 16,61	€ 16,38	€ 15,31			
ausschüttend	€ 199.778	€ 201.004	€ 330.342			
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.640	25.470	42.647			
NIW je Anteil	€ 7,79	€ 7,89	€ 7,75			
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 517.734	£ 519.724	£ 572.158			
ausgegebene und umlaufende Anteile	36.739	37.644	44.993			
NIW je Anteil	£ 14,09	£ 13,81	£ 12,72			
ausschüttend	£ 257.747	£ 267.079	£ 391.080			
ausgegebene und umlaufende Anteile	43.574	44.733	67.375			
NIW je Anteil	£ 5,92	£ 5,97	£ 5,80			
Institutional MXN (Hedged):						
thesaurierend	MXN 639.807	MXN 407.573	MXN 270.310			
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.519	3.696	2.863			
NIW je Anteil	MXN 115,94	MXN 110,27	MXN 94,40			
Institutional SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK 185.488	SEK 180.061	SEK 168.340			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.075	1.058	1.058			
NIW je Anteil	SEK 172,55	SEK 170,25	SEK 159,10			
Institutional SGD (Hedged):						
ausschüttend	SGD 5.249	SGD 8.210	SGD 43.716			
ausgegebene und umlaufende Anteile	637	982	5.366			
NIW je Anteil	SGD 8,25	SGD 8,36	SGD 8,15			

**Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)**

	Diversified Income Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Investor:			
thesaurierend	\$ 33.030	\$ 37.372	\$ 53.597
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.488	2.872	4.492
NIW je Anteil	\$ 13,27	\$ 13,01	\$ 11,93
ausschüttend	\$ 68.053	\$ 97.875	\$ 89.559
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.687	11.003	10.495
NIW je Anteil	\$ 8,85	\$ 8,89	\$ 8,53
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 16.345	€ 18.112	€ 21.418
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.044	1.171	1.477
NIW je Anteil	€ 15,65	€ 15,46	€ 14,50
ausschüttend	€ 8.610	€ 9.072	€ 10.066
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.169	1.216	1.375
NIW je Anteil	€ 7,37	€ 7,46	€ 7,32
Administrative:			
ausschüttend	\$ 66.533	\$ 70.001	\$ 87.885
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.886	7.208	9.431
NIW je Anteil	\$ 9,66	\$ 9,71	\$ 9,32
Administrative AUD (Hedged):			
ausschüttend	k. A.	k. A.	AUD 2.794
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	341
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	AUD 8,18
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 3.103	€ 3.265	€ 4.330
ausgegebene und umlaufende Anteile	203	217	306
NIW je Anteil	€ 15,25	€ 15,08	€ 14,16
Administrative GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 7.859	£ 7.739	£ 8.358
ausgegebene und umlaufende Anteile	889	870	972
NIW je Anteil	£ 8,84	£ 8,89	£ 8,60
Administrative JPY (Hedged):			
thesaurierend	¥ 390.722	¥ 367.541	¥ 354.957
ausgegebene und umlaufende Anteile	474	441	438
NIW je Anteil	¥ 825,00	¥ 833,00	¥ 811,00
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 74	SEK 73	SEK 78
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	SEK 86,95	SEK 86,00	SEK 80,78
Administrative SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 84.785	SGD 63.405	SGD 55.693
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.988	7.369	6.640
NIW je Anteil	SGD 8,49	SGD 8,60	SGD 8,39
BM Retail:			
nichtkumulierend	\$ 164.437	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.089	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,62	\$ 9,95	k. A.
ausschüttend II	\$ 127.337	\$ 33.787	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.888	3.628	1
NIW je Anteil	\$ 9,17	\$ 9,31	\$ 9,17
BN Retail:			
ausschüttend II	k. A.	k. A.	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,17
Class E:			
thesaurierend	\$ 547.767	\$ 577.044	\$ 655.637
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.487	26.246	32.342
NIW je Anteil	\$ 22,37	\$ 21,99	\$ 20,27
ausschüttend	\$ 279.382	\$ 300.411	\$ 372.507
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.889	25.563	33.038
NIW je Anteil	\$ 11,69	\$ 11,75	\$ 11,28
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 5.756	CHF 5.734	CHF 7.655
ausgegebene und umlaufende Anteile	667	663	918
NIW je Anteil	CHF 8,63	CHF 8,65	CHF 8,34

	Diversified Income Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 883.724	€ 949.425	€ 1.292.425
ausgegebene und umlaufende Anteile	61.548	66.761	96.369
NIW je Anteil	€ 14,36	€ 14,22	€ 13,41
ausschüttend	€ 547.774	€ 618.912	€ 781.155
ausgegebene und umlaufende Anteile	61.605	68.720	88.377
NIW je Anteil	€ 8,89	€ 9,01	€ 8,84
Class E SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 14.299	SGD 17.307	SGD 22.377
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.740	2.078	2.757
NIW je Anteil	SGD 8,22	SGD 8,33	SGD 8,12
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 977.466	\$ 456.350	\$ 385.630
ausgegebene und umlaufende Anteile	49.347	23.526	21.717
NIW je Anteil	\$ 19,81	\$ 19,40	\$ 17,76
ausschüttend	\$ 198	\$ 197	\$ 118
ausgegebene und umlaufende Anteile	22	22	14
NIW je Anteil	\$ 8,93	\$ 8,98	\$ 8,61
M Retail:			
nichtkumulierend	\$ 27.763	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.870	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,67	\$ 9,95	k. A.
ausschüttend	\$ 123.024	\$ 129.257	\$ 150.260
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.300	12.858	15.573
NIW je Anteil	\$ 10,00	\$ 10,05	\$ 9,65
ausschüttend II	\$ 163.359	\$ 164.458	\$ 183.635
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.832	20.705	23.717
NIW je Anteil	\$ 7,84	\$ 7,94	\$ 7,74
M Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend	AUD 43.611	AUD 43.631	AUD 49.591
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.846	4.793	5.574
NIW je Anteil	AUD 9,00	AUD 9,10	AUD 8,90
N Retail:			
ausschüttend II	\$ 10	\$ 9	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 9,50	\$ 9,34	\$ 8,61
Class T:			
thesaurierend	\$ 22.674	\$ 24.098	\$ 25.356
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.890	2.039	2.318
NIW je Anteil	\$ 12,00	\$ 11,82	\$ 10,94
ausschüttend	\$ 5.395	\$ 6.268	\$ 6.829
ausgegebene und umlaufende Anteile	588	679	771
NIW je Anteil	\$ 9,18	\$ 9,23	\$ 8,85
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 34.373	€ 36.498	€ 36.445
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.442	3.682	3.883
NIW je Anteil	€ 9,99	€ 9,91	€ 9,38
ausschüttend	€ 17.902	€ 18.999	€ 19.507
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.350	2.463	2.576
NIW je Anteil	€ 7,62	€ 7,71	€ 7,57
W Class:			
thesaurierend	\$ 30.193	\$ 29.812	\$ 64.400
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.087	3.117	7.380
NIW je Anteil	\$ 9,78	\$ 9,56	\$ 8,73
ausschüttend	\$ 9.931	\$ 11.290	\$ 45.458
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.195	1.352	5.672
NIW je Anteil	\$ 8,31	\$ 8,35	\$ 8,01
W Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 1.409	CHF 1.522	CHF 10.994
ausgegebene und umlaufende Anteile	161	174	1.317
NIW je Anteil	CHF 8,78	CHF 8,76	CHF 8,35

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	Diversified Income Fund (Forts.)					
ausschüttend	CHF	417	CHF	428	CHF	699
ausgegebene und umlaufende Anteile		56		56		91
NIW je Anteil	CHF	7,46	CHF	7,65	CHF	7,67
W Class EUR (Hedged): thesaurierend	€	4.392	€	4.968	€	11.937
ausgegebene und umlaufende Anteile		481		552		1.420
NIW je Anteil	€	9,14	€	9,01	€	8,40
ausschüttend	€	956	€	1.078	€	3.382
ausgegebene und umlaufende Anteile		123		137		438
NIW je Anteil	€	7,77	€	7,87	€	7,72
W Class GBP (Hedged): thesaurierend	£	287	£	281	£	2.089
ausgegebene und umlaufende Anteile		30		30		243
NIW je Anteil	£	9,54	£	9,34	£	8,59
ausschüttend	£	138	£	334	£	2.895
ausgegebene und umlaufende Anteile		17		41		367
NIW je Anteil	£	8,10	£	8,16	£	7,89
W Class SGD (Hedged): ausschüttend	SGD	1.554	SGD	1.574	SGD	3.079
ausgegebene und umlaufende Anteile		192		192		385
NIW je Anteil	SGD	8,10	SGD	8,21	SGD	8,00
	Diversified Income Duration Hedged Fund					
Nettovermögen	\$	380.360	\$	412.839	\$	564.684
Institutional:						
thesaurierend	\$	23.921	\$	18.800	\$	23.243
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.442		1.197		1.617
NIW je Anteil	\$	16,59	\$	15,70	\$	14,38
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€	23.980	€	13.663	€	87.225
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.680		1.004		6.863
NIW je Anteil	€	14,27	€	13,61	€	12,71
ausschüttend II	€	9.028	€	9.164	€	9.995
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.240		1.266		1.372
NIW je Anteil	€	7,28	€	7,24	€	7,29
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£	152.585	£	153.980	£	182.935
ausgegebene und umlaufende Anteile		9.551		10.174		13.134
NIW je Anteil	£	15,98	£	15,14	£	13,93
ausschüttend	£	2.866	£	41.868	£	63.760
ausgegebene und umlaufende Anteile		351		5.208		7.894
NIW je Anteil	£	8,17	£	8,04	£	8,08
Investor: thesaurierend	\$	5.356	\$	5.078	\$	5.125
ausgegebene und umlaufende Anteile		389		389		428
NIW je Anteil	\$	13,76	\$	13,04	\$	11,98
Class E: thesaurierend	\$	24.276	\$	18.689	\$	24.033
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.822		1.475		2.054
NIW je Anteil	\$	13,33	\$	12,67	\$	11,70
ausschüttend	\$	31.703	\$	30.961	\$	33.306
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.282		3.261		3.579
NIW je Anteil	\$	9,66	\$	9,49	\$	9,30
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€	40.927	€	40.505	€	54.593
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.177		3.284		4.696
NIW je Anteil	€	12,88	€	12,34	€	11,63
ausschüttend	€	18.061	€	17.818	€	18.931
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.373		2.363		2.511
NIW je Anteil	€	7,61	€	7,54	€	7,54

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	Diversified Income ESG Fund					
Nettovermögen	\$	52.862	\$	57.563	\$	9.854
Institutional: thesaurierend	\$	10.437	\$	10.289	\$	9.367
ausgegebene und umlaufende Anteile		947		947		947
NIW je Anteil	\$	11,02	\$	10,87	\$	9,89
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€	39.320	€	42.539	€	226
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.725		4.056		23
NIW je Anteil	€	10,56	€	10,49	€	9,76
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£	208	£	205	£	188
ausgegebene und umlaufende Anteile		19		19		19
NIW je Anteil	£	10,85	£	10,71	£	9,83
Class E: thesaurierend	\$	11	\$	11	\$	10
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	\$	10,84	\$	10,73	\$	9,85
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€	10	€	10	€	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	€	10,38	€	10,36	€	9,73
	Dynamic Bond Fund					
Nettovermögen	\$	3.498.953	\$	3.445.573	\$	3.483.601
Institutional: thesaurierend	\$	319.885	\$	339.706	\$	470.460
ausgegebene und umlaufende Anteile		21.434		23.366		34.671
NIW je Anteil	\$	14,92	\$	14,54	\$	13,57
ausschüttend	\$	84.890	\$	84.564	\$	81.771
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.063		8.063		8.057
NIW je Anteil	\$	10,53	\$	10,49	\$	10,15
Institutional CAD (Hedged): thesaurierend	CAD	10.979	CAD	10.727	CAD	11.952
ausgegebene und umlaufende Anteile		999		999		1.186
NIW je Anteil	CAD	10,99	CAD	10,73	CAD	10,08
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF	2.617	CHF	2.845	CHF	70.173
ausgegebene und umlaufende Anteile		255		279		7.073
NIW je Anteil	CHF	10,26	CHF	10,20	CHF	9,92
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€	38.424	€	92.451	€	187.622
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.036		7.438		15.837
NIW je Anteil	€	12,66	€	12,43	€	11,85
ausschüttend	€	3.630	€	5.783	€	11.318
ausgegebene und umlaufende Anteile		408		648		1.283
NIW je Anteil	€	8,90	€	8,93	€	8,82
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£	2.073.706	£	1.929.593	£	1.840.373
ausgegebene und umlaufende Anteile		157.504		150.264		152.611
NIW je Anteil	£	13,17	£	12,84	£	12,06
ausschüttend	£	90.548	£	95.339	£	94.155
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.290		10.814		10.906
NIW je Anteil	£	8,80	£	8,82	£	8,63

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Dynamic Bond Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 3.470	NOK 3.465	NOK 4.066
ausgegebene und umlaufende Anteile	267	273	337
NIW je Anteil	NOK 12,99	NOK 12,72	NOK 12,07
Investor:			
thesaurierend	\$ 37.340	\$ 44.681	\$ 46.677
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.975	3.648	4.069
NIW je Anteil	\$ 12,55	\$ 12,25	\$ 11,47
ausschüttend	\$ 1.114	\$ 1.272	\$ 2.830
ausgegebene und umlaufende Anteile	118	136	312
NIW je Anteil	\$ 9,42	\$ 9,38	\$ 9,08
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.597	€ 2.053	€ 2.013
ausgegebene und umlaufende Anteile	149	195	200
NIW je Anteil	€ 10,72	€ 10,54	€ 10,08
Administrative:			
thesaurierend	\$ 12.544	\$ 15.191	\$ 21.094
ausgegebene und umlaufende Anteile	904	1.121	1.659
NIW je Anteil	\$ 13,88	\$ 13,56	\$ 12,72
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 962	€ 959	€ 1.170
ausgegebene und umlaufende Anteile	82	83	105
NIW je Anteil	€ 11,79	€ 11,60	€ 11,11
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 52.221	SEK 55.239	SEK 61.257
ausgegebene und umlaufende Anteile	479	515	597
NIW je Anteil	SEK 108,91	SEK 107,23	SEK 102,58
Class E:			
thesaurierend	\$ 66.397	\$ 67.914	\$ 69.989
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.555	5.807	6.354
NIW je Anteil	\$ 11,95	\$ 11,70	\$ 11,01
ausschüttend	\$ 12.740	\$ 13.906	\$ 14.979
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.324	1.451	1.615
NIW je Anteil	\$ 9,62	\$ 9,59	\$ 9,28
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 7.248	CHF 7.671	CHF 8.868
ausgegebene und umlaufende Anteile	801	850	1.000
NIW je Anteil	CHF 9,05	CHF 9,03	CHF 8,86
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 62.797	€ 66.769	€ 73.068
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.652	6.094	6.936
NIW je Anteil	€ 11,11	€ 10,96	€ 10,54
Class E GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 1.633	£ 1.882	£ 3.354
ausgegebene und umlaufende Anteile	144	169	318
NIW je Anteil	£ 11,36	£ 11,13	£ 10,55
G Retail EUR (Hedged):			
ausschüttend	€ 5.643	€ 5.890	€ 7.061
ausgegebene und umlaufende Anteile	696	736	896
NIW je Anteil	€ 8,11	€ 8,00	€ 7,88
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 46.173	\$ 44.168	\$ 11.541
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.137	4.058	1.135
NIW je Anteil	\$ 11,16	\$ 10,88	\$ 10,17
ausschüttend	k. A.	k. A.	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,12
Class R:			
thesaurierend	\$ 4.354	\$ 4.839	\$ 6.385
ausgegebene und umlaufende Anteile	358	408	577
NIW je Anteil	\$ 12,16	\$ 11,85	\$ 11,07

	Dynamic Bond Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Class Z:			
thesaurierend	\$ 21.199	\$ 15.699	\$ 6.683
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.063	1.576	725
NIW je Anteil	\$ 10,27	\$ 9,96	\$ 9,22
Class Z AUD (Hedged):			
ausschüttend	AUD 13.470	AUD 16.551	AUD 27.023
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.442	1.767	2.938
NIW je Anteil	AUD 9,34	AUD 9,36	AUD 9,20
Nettovermögen	€ 2.497.739	€ 3.262.045	€ 5.115.170
Institutional:			
thesaurierend	€ 754.745	€ 1.030.988	€ 1.644.656
ausgegebene und umlaufende Anteile	62.368	86.743	137.719
NIW je Anteil	€ 12,10	€ 11,89	€ 11,94
ausschüttend II	€ 366	€ 120.582	€ 158.729
ausgegebene und umlaufende Anteile	34	11.229	14.419
NIW je Anteil	€ 10,83	€ 10,74	€ 11,01
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 13	CHF 2.459	CHF 3.063
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	245	297
NIW je Anteil	CHF 10,07	CHF 10,04	CHF 10,31
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 401.342	£ 407.097	£ 552.226
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.749	31.957	43.745
NIW je Anteil	£ 13,05	£ 12,74	£ 12,62
ausschüttend	£ 4.449	£ 10.386	£ 33.675
ausgegebene und umlaufende Anteile	416	955	3.025
NIW je Anteil	£ 10,69	£ 10,88	£ 11,13
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	ILS 17.174	ILS 16.594	ILS 4.206
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.695	1.668	423
NIW je Anteil	ILS 10,13	ILS 9,95	ILS 9,93
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 83.307	SGD 81.668	SGD 109.428
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.328	9.303	12.486
NIW je Anteil	SGD 8,93	SGD 8,78	SGD 8,76
Institutional USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 59.906	\$ 113.739	\$ 156.343
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.190	8.164	11.438
NIW je Anteil	\$ 14,30	\$ 13,93	\$ 13,67
ausschüttend II	\$ 4.400	\$ 4.415	\$ 4.450
ausgegebene und umlaufende Anteile	522	531	531
NIW je Anteil	\$ 8,43	\$ 8,31	\$ 8,38
Investor:			
thesaurierend	€ 7.966	€ 9.375	€ 10.626
ausgegebene und umlaufende Anteile	848	1.014	1.140
NIW je Anteil	€ 9,40	€ 9,25	€ 9,32
Investor USD (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 8,94

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)</b>			
BM Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend II	AUD 168	AUD 161	AUD 12
ausgegebene und umlaufende Anteile	19	18	1
NIW je Anteil	AUD 8,72	AUD 8,75	AUD 9,19
BM Retail USD (Hedged):			
ausschüttend II	\$ 927	\$ 604	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	103	67	1
NIW je Anteil	\$ 9,00	\$ 8,97	\$ 9,25
Class E:			
thesaurierend	€ 848.322	€ 1.109.492	€ 1.913.579
ausgegebene und umlaufende Anteile	76.353	101.172	171.934
NIW je Anteil	€ 11,11	€ 10,97	€ 11,13
ausschüttend	€ 2.347	€ 3.256	€ 4.679
ausgegebene und umlaufende Anteile	259	361	506
NIW je Anteil	€ 9,06	€ 9,02	€ 9,25
Class E USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 98.875	\$ 125.652	\$ 192.230
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.315	10.789	16.657
NIW je Anteil	\$ 11,89	\$ 11,65	\$ 11,54
ausschüttend	k. A.	k. A.	\$ 32
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	4
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 8,84
ausschüttend II	k. A.	k. A.	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 8,27
H Institutional USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 650	\$ 656	\$ 2.298
ausgegebene und umlaufende Anteile	65	67	240
NIW je Anteil	\$ 9,99	\$ 9,74	\$ 9,58
M Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend II	AUD 335	AUD 325	AUD 321
ausgegebene und umlaufende Anteile	43	41	39
NIW je Anteil	AUD 7,86	AUD 7,85	AUD 8,17
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 7.816	SGD 9.292	SGD 12.812
ausgegebene und umlaufende Anteile	974	1.158	1.538
NIW je Anteil	SGD 8,02	SGD 8,02	SGD 8,33
M Retail USD (Hedged):			
ausschüttend II	\$ 39.506	\$ 45.217	\$ 65.622
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.383	5.059	7.183
NIW je Anteil	\$ 9,01	\$ 8,94	\$ 9,14
Class T:			
thesaurierend	€ 54.349	€ 67.018	€ 83.511
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.332	6.648	8.130
NIW je Anteil	€ 10,19	€ 10,08	€ 10,27
Class T USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 1.094	\$ 3.019	\$ 3.396
ausgegebene und umlaufende Anteile	125	353	399
NIW je Anteil	\$ 8,72	\$ 8,56	\$ 8,51
Class Z:			
thesaurierend	€ 92.098	€ 104.488	€ 151.534
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.342	9.677	14.087
NIW je Anteil	€ 11,04	€ 10,80	€ 10,76

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Emerging Local Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 2.672.230	\$ 2.880.941	\$ 1.919.668
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.846.837	\$ 1.787.853	\$ 1.295.760
ausgegebene und umlaufende Anteile	130.046	122.115	102.499
NIW je Anteil	\$ 14,20	\$ 14,64	\$ 12,64
ausschüttend	\$ 96.860	\$ 86.891	\$ 67.645
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.388	12.960	11.061
NIW je Anteil	\$ 6,29	\$ 6,70	\$ 6,12
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 351.020	€ 409.418	€ 172.199
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.019	28.009	13.181
NIW je Anteil	€ 14,61	€ 14,62	€ 13,06
ausschüttend	€ 156.647	€ 160.464	€ 133.001
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.152	22.947	20.143
NIW je Anteil	€ 6,77	€ 6,99	€ 6,60
Institutional GBP (Unhedged):			
thesaurierend	£ 13.666	£ 6.345	£ 3.791
ausgegebene und umlaufende Anteile	616	280	183
NIW je Anteil	£ 22,20	£ 22,69	£ 20,76
Investor:			
thesaurierend	\$ 4.138	\$ 8.219	\$ 19.075
ausgegebene und umlaufende Anteile	388	747	2.001
NIW je Anteil	\$ 10,66	\$ 11,00	\$ 9,53
Investor EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 80	€ 664	€ 698
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	64	75
NIW je Anteil	€ 10,33	€ 10,34	€ 9,28
Class E:			
thesaurierend	\$ 36.587	\$ 41.451	\$ 35.736
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.005	3.286	3.249
NIW je Anteil	\$ 12,17	\$ 12,61	\$ 11,00
ausschüttend	\$ 13.818	\$ 15.039	\$ 12.985
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.344	2.395	2.266
NIW je Anteil	\$ 5,90	\$ 6,28	\$ 5,73
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 76.384	€ 76.314	€ 65.014
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.882	4.853	4.579
NIW je Anteil	€ 15,64	€ 15,73	€ 14,20
ausschüttend	€ 1.454	€ 1.590	€ 1.510
ausgegebene und umlaufende Anteile	158	167	168
NIW je Anteil	€ 9,19	€ 9,50	€ 8,97
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 616	\$ 189.970	\$ 48.210
ausgegebene und umlaufende Anteile	62	18.463	5.416
NIW je Anteil	\$ 9,98	\$ 10,29	\$ 8,90
Class Z:			
ausschüttend	\$ 28.500	\$ 27.121	\$ 38.228
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.780	3.377	5.218
NIW je Anteil	\$ 7,54	\$ 8,03	\$ 7,33
<b>Emerging Local Bond ESG Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 113.387	\$ 102.408	\$ 6.609
Institutional:			
thesaurierend	\$ 5.744	\$ 5.975	\$ 5.169
ausgegebene und umlaufende Anteile	489	489	489
NIW je Anteil	\$ 11,75	\$ 12,22	\$ 10,57
ausschüttend	\$ 21	\$ 12	\$ 11
ausgegebene und umlaufende Anteile	2	1	1
NIW je Anteil	\$ 10,51	\$ 11,26	\$ 10,34
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 91.912	€ 85.778	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.286	7.664	1
NIW je Anteil	€ 11,09	€ 11,19	€ 10,02

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2022	
	<b>Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)</b>					
ausschüttend	€	10	€	10	€	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	€	9,92	€	10,31	€	9,81
Institutional GBP (Unhedged):						
ausschüttend	£	8	£	8		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	£	9,51	£	10,13		k. A.
Investor:						
thesaurierend	\$	12	\$	12	\$	11
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	\$	11,67	\$	12,16	\$	10,56
ausschüttend	\$	12	\$	12	\$	11
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	\$	10,51	\$	11,26	\$	10,34
Investor EUR (Unhedged):						
thesaurierend	€	10	€	10	€	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	€	11,02	€	11,14	€	10,01
ausschüttend	€	10	€	10	€	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	€	9,91	€	10,31	€	9,81
Class E:						
thesaurierend	\$	12	\$	12	\$	11
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	\$	11,53	\$	12,05	\$	10,53
ausschüttend	\$	12	\$	12	\$	11
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	\$	10,51	\$	11,25	\$	10,34
Class E EUR (Unhedged):						
thesaurierend	€	10	€	10	€	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	€	10,88	€	11,03	€	9,98
ausschüttend	€	10	€	10	€	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	€	9,92	€	10,31	€	9,80
Class Z:						
thesaurierend	\$	9.003	\$	1.550	\$	1.329
ausgegebene und umlaufende Anteile		742		123		123
NIW je Anteil	\$	12,14	\$	12,57	\$	10,77
	<b>Emerging Markets Bond Fund</b>					
Nettovermögen	\$	4.134.117	\$	3.846.285	\$	3.305.979
Institutional:						
thesaurierend	\$	1.304.682	\$	1.269.939	\$	1.097.175
ausgegebene und umlaufende Anteile		25.101		25.159		24.303
NIW je Anteil	\$	51,98	\$	50,48	\$	45,15
ausschüttend	\$	122.155	\$	91.725	\$	56.849
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.891		5.909		3.860
NIW je Anteil	\$	15,48	\$	15,52	\$	14,73
Institutional CHF (Hedged):						
ausschüttend	CHF	77.587	CHF	77.520	CHF	77.505
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.479		5.347		5.390
NIW je Anteil	CHF	14,16	CHF	14,50	CHF	14,38
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	696.845	€	705.340	€	694.951
ausgegebene und umlaufende Anteile		17.641		18.243		19.643
NIW je Anteil	€	39,50	€	38,66	€	35,38
ausschüttend	€	439.816	€	438.978	€	401.157
ausgegebene und umlaufende Anteile		63.295		62.494		58.854
NIW je Anteil	€	6,95	€	7,02	€	6,82

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2022	
	<b>Emerging Markets Bond Fund (Forts.)</b>					
Institutional EUR (Unhedged):						
thesaurierend	€	169.267	€	179.735	€	135.251
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.129		14.796		12.028
NIW je Anteil	€	12,89	€	12,15	€	11,24
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	21.027	£	20.841	£	23.424
ausgegebene und umlaufende Anteile		785		800		997
NIW je Anteil	£	26,80	£	26,06	£	23,50
ausschüttend	£	38.992	£	26.761	£	28.487
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.743		7.338		8.167
NIW je Anteil	£	3,63	£	3,65	£	3,49
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	25.145	SGD	24.108	SGD	31.394
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.265		2.217		3.178
NIW je Anteil	SGD	11,10	SGD	10,87	SGD	9,88
Investor:						
thesaurierend	\$	3.821	\$	4.491	\$	3.988
ausgegebene und umlaufende Anteile		79		96		95
NIW je Anteil	\$	48,11	\$	46,80	\$	42,01
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	3.608	€	3.537	€	3.248
ausgegebene und umlaufende Anteile		398		398		398
NIW je Anteil	€	9,06	€	8,88	€	8,16
Administrative:						
thesaurierend	\$	27.836	\$	30.109	\$	22.981
ausgegebene und umlaufende Anteile		593		659		560
NIW je Anteil	\$	46,92	\$	45,68	\$	41,06
BM Retail:						
nichtkumulierend	\$	2.842	\$	10		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		297		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	9,58	\$	9,94		k. A.
ausschüttend II	\$	2.252	\$	862	\$	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		245		92		1
NIW je Anteil	\$	9,19	\$	9,35	\$	9,11
Class E:						
thesaurierend	\$	129.917	\$	135.062	\$	114.186
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.938		3.131		2.933
NIW je Anteil	\$	44,22	\$	43,14	\$	38,93
ausschüttend	\$	44.337	\$	66.773	\$	61.547
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.753		7.136		6.932
NIW je Anteil	\$	9,33	\$	9,36	\$	8,88
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	125.377	€	134.655	€	125.229
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.737		4.082		4.112
NIW je Anteil	€	33,55	€	32,99	€	30,46
Class E SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	9.031	SGD	9.601	SGD	10.020
ausgegebene und umlaufende Anteile		147		159		181
NIW je Anteil	SGD	61,24	SGD	60,26	SGD	55,23
H Institutional:						
thesaurierend	\$	691.452	\$	417.764	\$	302.479
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.687		8.507		6.875
NIW je Anteil	\$	50,52	\$	49,11	\$	44,00
ausschüttend	\$	272	\$	272	\$	217
ausgegebene und umlaufende Anteile		34		34		29
NIW je Anteil	\$	7,93	\$	7,96	\$	7,55
M Retail:						
nichtkumulierend	\$	30.083	\$	10		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.124		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	9,63	\$	9,94		k. A.

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	<b>Emerging Markets Bond Fund (Forts.)</b>					
ausschüttend	\$	9.537	\$	8.479	\$	8.675
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.135		1.006		1.085
NIW je Anteil	\$	8,40	\$	8,43	\$	8,00
ausschüttend II	\$	14.342	\$	4.243	\$	3.190
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.074		606		473
NIW je Anteil	\$	6,91	\$	7,00	\$	6,75
M Retail AUD (Hedged):						
ausschüttend	AUD	4.780	AUD	5.240	AUD	1.510
ausgegebene und umlaufende Anteile		647		702		209
NIW je Anteil	AUD	7,39	AUD	7,47	AUD	7,22
Class Z:						
ausschüttend	\$	22.098	\$	19.360	\$	5.279
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.147		1.876		540
NIW je Anteil	\$	10,29	\$	10,32	\$	9,78
	<b>Emerging Markets Bond ESG Fund</b>					
Nettovermögen	\$	2.883.625	\$	2.693.921	\$	2.492.475
Institutional:						
thesaurierend	\$	755.976	\$	714.848	\$	640.128
ausgegebene und umlaufende Anteile		47.051		45.724		45.303
NIW je Anteil	\$	16,07	\$	15,63	\$	14,13
ausschüttend	\$	280.996	\$	276.510	\$	306.128
ausgegebene und umlaufende Anteile		35.637		34.964		40.679
NIW je Anteil	\$	7,88	\$	7,91	\$	7,53
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	493.917	CHF	257.904	CHF	53.384
ausgegebene und umlaufende Anteile		59.229		31.142		6.825
NIW je Anteil	CHF	8,34	CHF	8,28	CHF	7,82
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	884.369	€	915.574	€	1.011.465
ausgegebene und umlaufende Anteile		82.504		87.099		104.063
NIW je Anteil	€	10,72	€	10,51	€	9,72
ausschüttend	€	154.636	€	146.989	€	132.184
ausgegebene und umlaufende Anteile		22.937		21.564		19.921
NIW je Anteil	€	6,74	€	6,82	€	6,64
Institutional GBP (Hedged):						
ausschüttend	£	101.500	£	108.520	£	162.630
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.525		14.385		22.478
NIW je Anteil	£	7,50	£	7,54	£	7,24
Institutional GBP (Unhedged):						
ausschüttend	£	5.975	£	5.452	£	3.960
ausgegebene und umlaufende Anteile		755		692		499
NIW je Anteil	£	7,91	£	7,88	£	7,94
Investor NOK (Hedged):						
thesaurierend	NOK	4.635	NOK	4.544	NOK	5.222
ausgegebene und umlaufende Anteile		40		40		50
NIW je Anteil	NOK	114,63	NOK	112,37	NOK	103,95
Investor SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK	27.147	SEK	27.789	SEK	27.736
ausgegebene und umlaufende Anteile		260		271		292
NIW je Anteil	SEK	104,28	SEK	102,52	SEK	95,02

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	<b>Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)</b>					
Administrative:						
thesaurierend	\$	354	\$	345	\$	314
ausgegebene und umlaufende Anteile		37		37		37
NIW je Anteil	\$	9,63	\$	9,39	\$	8,53
ausschüttend	\$	753	\$	755	\$	718
ausgegebene und umlaufende Anteile		95		95		95
NIW je Anteil	\$	7,89	\$	7,91	\$	7,53
Administrative EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	1.193		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		115		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	€	10,33		k. A.		k. A.
Administrative SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK	970	SEK	250	SEK	105
ausgegebene und umlaufende Anteile		11		3		1
NIW je Anteil	SEK	84,97	SEK	83,60	SEK	77,61
Class E:						
thesaurierend	\$	3.677	\$	3.444	\$	924
ausgegebene und umlaufende Anteile		425		407		120
NIW je Anteil	\$	8,66	\$	8,46	\$	7,71
ausschüttend	\$	541	\$	512	\$	676
ausgegebene und umlaufende Anteile		71		67		94
NIW je Anteil	\$	7,57	\$	7,59	\$	7,23
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	32.114	€	58.741	€	57.844
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.479		6.460		6.822
NIW je Anteil	€	9,23	€	9,09	€	8,48
Class Z:						
thesaurierend	\$	3.477	\$	3.909		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		305		353		k. A.
NIW je Anteil	\$	11,41	\$	11,06		k. A.
	<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>					
Nettovermögen	\$	150.824	\$	157.713	\$	168.986
Institutional:						
thesaurierend	\$	10.503	\$	12.120	\$	8.279
ausgegebene und umlaufende Anteile		618		733		535
NIW je Anteil	\$	17,00	\$	16,54	\$	15,48
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	92.021	€	90.459	€	102.077
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.660		6.680		7.881
NIW je Anteil	€	13,82	€	13,54	€	12,95
Class E:						
thesaurierend	\$	10.918	\$	11.521	\$	15.703
ausgegebene und umlaufende Anteile		861		930		1.342
NIW je Anteil	\$	12,68	\$	12,39	\$	11,70
Class E CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	8.392	CHF	8.772	CHF	10.121
ausgegebene und umlaufende Anteile		854		895		1.048
NIW je Anteil	CHF	9,83	CHF	9,80	CHF	9,66
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	20.006	€	21.477	€	23.540
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.672		1.824		2.072
NIW je Anteil	€	11,96	€	11,78	€	11,36
	<b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b>					
Nettovermögen	\$	318.949	\$	282.790	\$	205.131
Institutional:						
thesaurierend	\$	80.659	\$	64.011	\$	25.166
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.856		5.588		2.449
NIW je Anteil	\$	11,77	\$	11,46	\$	10,28

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)</b>			
Institutional EUR (Partially Hedged): thesaurierend	€ 91.745	€ 77.402	€ 72.560
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.317	7.282	7.427
NIW je Anteil	€ 11,03	€ 10,63	€ 9,77
Institutional GBP (Partially Hedged): ausschüttend	£ 877	£ 829	£ 760
ausgegebene und umlaufende Anteile	91	85	81
NIW je Anteil	£ 9,64	£ 9,70	£ 9,37
Class E: thesaurierend	\$ 11	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,02	\$ 10,78	k. A.
ausschüttend	\$ 144	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	14	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,54	\$ 10,65	k. A.
Class E EUR (Partially Hedged): thesaurierend	€ 3.037	€ 759	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	291	75	1
NIW je Anteil	€ 10,45	€ 10,12	€ 9,38
Class Z: thesaurierend	\$ 135.445	\$ 131.360	\$ 101.602
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.633	11.634	10.102
NIW je Anteil	\$ 11,64	\$ 11,29	\$ 10,06
<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 17.396	\$ 19.946	\$ 20.937
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend	€ 5.023	€ 6.118	€ 6.154
ausgegebene und umlaufende Anteile	326	408	437
NIW je Anteil	€ 15,39	€ 14,99	€ 14,08
Class E: thesaurierend	\$ 3.510	\$ 4.075	\$ 4.388
ausgegebene und umlaufende Anteile	274	315	371
NIW je Anteil	\$ 12,82	\$ 12,93	\$ 11,84
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend	€ 7.933	€ 8.249	€ 9.351
ausgegebene und umlaufende Anteile	551	586	700
NIW je Anteil	€ 14,40	€ 14,09	€ 13,36
<b>PIMCO ESG Income Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 288.622	\$ 271.208	\$ 237.961
Institutional: thesaurierend	\$ 28.785	\$ 44.067	\$ 23.414
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.841	4.416	2.486
NIW je Anteil	\$ 10,13	\$ 9,98	\$ 9,42
ausschüttend	\$ 6	\$ 6	\$ 3.575
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	393
NIW je Anteil	\$ 9,19	\$ 9,28	\$ 9,10
Institutional AUD (Hedged): ausschüttend	AUD 70.099	AUD 71.681	AUD 57.036
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.898	7.954	6.338
NIW je Anteil	AUD 8,87	AUD 9,01	AUD 9,00
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 1.044	CHF 1.264	CHF 7.316
ausgegebene und umlaufende Anteile	114	137	803
NIW je Anteil	CHF 9,20	CHF 9,24	CHF 9,11
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 43.912	€ 43.366	€ 105.509
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.589	4.567	11.509
NIW je Anteil	€ 9,57	€ 9,50	€ 9,17

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>PIMCO ESG Income Fund (Forts.)</b>			
ausschüttend	€ 42.477	€ 42.423	€ 1.925
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.897	4.808	217
NIW je Anteil	€ 8,67	€ 8,82	€ 8,85
Institutional GBP (Hedged): ausschüttend	£ 1.153	£ 382	£ 405
ausgegebene und umlaufende Anteile	128	42	44
NIW je Anteil	£ 9,00	£ 9,10	£ 9,00
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend	NOK 458.690	NOK 286.985	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.382	2.768	k. A.
NIW je Anteil	NOK 104,69	NOK 103,69	k. A.
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 424.734	SEK 177.546	SEK 122.486
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.438	1.868	1.335
NIW je Anteil	SEK 95,71	SEK 95,05	SEK 91,73
Institutional SGD (Hedged): ausschüttend	SGD 404	SGD 411	SGD 367
ausgegebene und umlaufende Anteile	45	45	40
NIW je Anteil	SGD 8,97	SGD 9,13	SGD 9,09
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 31.522	SEK 52.396	SEK 79.369
ausgegebene und umlaufende Anteile	313	523	816
NIW je Anteil	SEK 100,70	SEK 100,24	SEK 97,22
Class E: thesaurierend	\$ 2.615	\$ 2.429	\$ 1.433
ausgegebene und umlaufende Anteile	265	249	155
NIW je Anteil	\$ 9,85	\$ 9,74	\$ 9,28
ausschüttend	\$ 642	\$ 444	\$ 387
ausgegebene und umlaufende Anteile	70	48	43
NIW je Anteil	\$ 9,13	\$ 9,25	\$ 9,10
Class E CHF (Hedged): ausschüttend	CHF 594	CHF 9	CHF 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	72	1	1
NIW je Anteil	CHF 8,28	CHF 8,57	CHF 8,81
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 6.514	€ 6.379	€ 4.811
ausgegebene und umlaufende Anteile	703	691	535
NIW je Anteil	€ 9,26	€ 9,23	€ 8,99
ausschüttend	€ 2.592	€ 1.798	€ 1.016
ausgegebene und umlaufende Anteile	301	204	115
NIW je Anteil	€ 8,62	€ 8,81	€ 8,86
Class R AUD (Hedged): ausschüttend	AUD 26.459	AUD 26.623	AUD 31.770
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.987	2.955	3.530
NIW je Anteil	AUD 8,86	AUD 9,01	AUD 9,00
<b>Euro Bond Fund</b>			
Nettovermögen	€ 1.567.844	€ 1.671.713	€ 1.913.275
Institutional: thesaurierend	€ 1.129.997	€ 1.122.219	€ 1.386.127
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.949	48.219	64.252
NIW je Anteil	€ 23,08	€ 23,27	€ 21,57

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	<b>Euro Bond Fund (Forts.)</b>		
ausschüttend	€ 21.924	€ 31.807	€ 68.589
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.534	2.175	4.956
NIW je Anteil	€ 14,29	€ 14,63	€ 13,84
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 248.061	CHF 327.426	CHF 313.292
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.134	10.517	10.631
NIW je Anteil	CHF 30,50	CHF 31,13	CHF 29,47
Investor:			
thesaurierend	€ 21.335	€ 20.023	€ 16.885
ausgegebene und umlaufende Anteile	998	927	841
NIW je Anteil	€ 21,38	€ 21,59	€ 20,08
Class E:			
thesaurierend	€ 113.395	€ 120.775	€ 101.050
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.795	6.094	5.451
NIW je Anteil	€ 19,57	€ 19,82	€ 18,54
ausschüttend	€ 23.622	€ 24.717	€ 23.340
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.291	2.342	2.337
NIW je Anteil	€ 10,31	€ 10,55	€ 9,99
Nettovermögen	€ 514.761	€ 537.186	€ 610.008
	<b>Euro Credit Fund</b>		
Institutional:			
thesaurierend	€ 345.611	€ 347.915	€ 348.784
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.270	22.389	24.516
NIW je Anteil	€ 15,52	€ 15,54	€ 14,23
ausschüttend II	€ 4.292	€ 6.860	€ 16.940
ausgegebene und umlaufende Anteile	460	719	1.879
NIW je Anteil	€ 9,33	€ 9,54	€ 9,02
Class E:			
thesaurierend	€ 31.613	€ 40.494	€ 11.194
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.628	3.346	1.001
NIW je Anteil	€ 12,03	€ 12,10	€ 11,18
H Institutional:			
thesaurierend	€ 133.159	€ 141.817	€ 232.926
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.215	15.125	27.156
NIW je Anteil	€ 9,37	€ 9,38	€ 8,58
ausschüttend II	€ 86	€ 100	€ 164
ausgegebene und umlaufende Anteile	10	11	20
NIW je Anteil	€ 8,50	€ 8,68	€ 8,14
Nettovermögen	€ 1.475.613	€ 1.387.227	€ 1.352.980
	<b>Euro Income Bond Fund</b>		
Institutional:			
thesaurierend	€ 373.492	€ 323.024	€ 332.727
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.471	21.389	23.944
NIW je Anteil	€ 15,26	€ 15,10	€ 13,90
ausschüttend	€ 62.914	€ 65.612	€ 79.523
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.493	6.705	8.533
NIW je Anteil	€ 9,69	€ 9,79	€ 9,32
Investor:			
thesaurierend	€ 12.060	€ 14.845	€ 10.138
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.236	1.536	1.136
NIW je Anteil	€ 9,75	€ 9,67	€ 8,93

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
	<b>Euro Income Bond Fund (Forts.)</b>		
ausschüttend	€ 8.057	€ 8.086	€ 8.520
ausgegebene und umlaufende Anteile	858	851	939
NIW je Anteil	€ 9,39	€ 9,50	€ 9,08
Administrative:			
thesaurierend	€ 1.814	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	179	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,11	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	€ 588.390	€ 573.864	€ 540.713
ausgegebene und umlaufende Anteile	43.465	42.654	43.285
NIW je Anteil	€ 13,54	€ 13,45	€ 12,49
ausschüttend	€ 379.196	€ 359.021	€ 347.514
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.443	41.468	41.763
NIW je Anteil	€ 8,53	€ 8,66	€ 8,32
Class T:			
thesaurierend	€ 34.533	€ 30.390	€ 24.746
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.334	2.946	2.573
NIW je Anteil	€ 10,36	€ 10,32	€ 9,62
ausschüttend	€ 15.157	€ 12.385	€ 9.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.016	1.620	1.234
NIW je Anteil	€ 7,52	€ 7,64	€ 7,38
Nettovermögen	€ 1.157.308	€ 923.969	€ 110.048
	<b>Euro Long Average Duration Fund</b>		
Nettovermögen	€ 1.157.308	€ 923.969	€ 110.048
Institutional:			
thesaurierend	€ 1.156.946	€ 923.958	€ 110.048
ausgegebene und umlaufende Anteile	59.772	44.105	5.786
NIW je Anteil	€ 19,36	€ 20,95	€ 19,02
Class E:			
thesaurierend	€ 362	€ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	35	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,42	€ 11,33	k. A.
Nettovermögen	€ 207.708	€ 193.514	€ 353.095
	<b>Euro Short-Term Fund</b>		
Nettovermögen	€ 207.708	€ 193.514	€ 353.095
Institutional:			
thesaurierend	€ 146.998	€ 165.347	€ 339.031
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.641	13.404	28.689
NIW je Anteil	€ 12,63	€ 12,34	€ 11,82
Investor:			
thesaurierend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,02	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	€ 60.701	€ 28.167	€ 14.064
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.511	2.608	1.350
NIW je Anteil	€ 11,01	€ 10,80	€ 10,42
Nettovermögen	€ 341.983	€ 367.767	€ 174.162
	<b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>		
Nettovermögen	€ 341.983	€ 367.767	€ 174.162
Institutional:			
thesaurierend	€ 186.825	€ 219.781	€ 32.875
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.499	19.847	3.379
NIW je Anteil	€ 11,32	€ 11,07	€ 9,73
Class E:			
thesaurierend	€ 7.486	€ 4.061	€ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	652	360	1
NIW je Anteil	€ 11,48	€ 11,28	€ 10,00
ausschüttend	€ 114	€ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	11	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,55	€ 10,61	k. A.

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>PIMCO European High Yield Bond Fund (Forts.)</b>			
Class Z:			
thesaurierend	€ 147.558	€ 143.915	€ 141.277
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.727	12.727	14.301
NIW je Anteil	€ 11,59	€ 11,31	€ 9,88
<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b>			
Nettovermögen	€ 942.107	€ 130.610	€ 211.172
Institutional:			
thesaurierend	€ 884.140	€ 67.680	€ 127.942
ausgegebene und umlaufende Anteile	75.206	5.907	11.637
NIW je Anteil	€ 11,76	€ 11,46	€ 10,99
Class E:			
thesaurierend	€ 11.979	€ 11.471	€ 7.775
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.198	1.175	826
NIW je Anteil	€ 10,00	€ 9,77	€ 9,42
H Institutional:			
thesaurierend	€ 45.988	€ 51.459	€ 75.455
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.517	5.184	7.907
NIW je Anteil	€ 10,18	€ 9,93	€ 9,54
<b>Global Advantage Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 421.145	\$ 432.290	\$ 410.459
Institutional:			
thesaurierend	\$ 7.610	\$ 7.698	\$ 7.716
ausgegebene und umlaufende Anteile	540	540	582
NIW je Anteil	\$ 14,10	\$ 14,26	\$ 13,28
Institutional CHF (Partially Hedged):			
ausschüttend	CHF 108.171	CHF 108.735	CHF 111.046
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.443	12.443	12.487
NIW je Anteil	CHF 8,69	CHF 8,74	CHF 8,89
Institutional EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 212.513	€ 206.079	€ 203.446
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.558	15.268	15.828
NIW je Anteil	€ 13,66	€ 13,50	€ 12,85
Institutional NOK (Partially Hedged):			
thesaurierend	NOK 632.886	NOK 620.678	NOK 577.381
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.109	4.106	4.099
NIW je Anteil	NOK 154,04	NOK 151,18	NOK 140,84
E Class EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 5.559	€ 6.009	€ 6.540
ausgegebene und umlaufende Anteile	468	509	576
NIW je Anteil	€ 11,89	€ 11,80	€ 11,36
<b>Global Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 15.343.059	\$ 13.077.262	\$ 11.420.112
Institutional:			
thesaurierend	\$ 7.083.905	\$ 4.616.460	\$ 3.410.090
ausgegebene und umlaufende Anteile	205.063	134.931	107.593
NIW je Anteil	\$ 34,55	\$ 34,21	\$ 31,69

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Global Bond Fund (Forts.)</b>			
ausschüttend	\$ 252.743	\$ 210.566	\$ 172.513
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.807	11.420	9.898
NIW je Anteil	\$ 18,30	\$ 18,44	\$ 17,43
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 322.820	\$ 307.999	\$ 326.665
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.632	9.940	11.261
NIW je Anteil	\$ 30,36	\$ 30,99	\$ 29,01
ausschüttend	\$ 18.480	\$ 19.480	\$ 19.875
ausgegebene und umlaufende Anteile	995	1.011	1.080
NIW je Anteil	\$ 18,56	\$ 19,27	\$ 18,41
Institutional AUD (Hedged):			
thesaurierend	AUD 41.717	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.138	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 10,08	k. A.	k. A.
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 51.209	CAD 50.875	CAD 54.563
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.696	4.696	5.395
NIW je Anteil	CAD 10,90	CAD 10,83	CAD 10,11
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 355.262	CHF 365.291	CHF 440.925
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.579	11.784	14.706
NIW je Anteil	CHF 30,68	CHF 31,00	CHF 29,98
ausschüttend	CHF 137.169	CHF 142.984	CHF 175.781
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.989	8.104	10.095
NIW je Anteil	CHF 17,17	CHF 17,64	CHF 17,41
Institutional EUR (Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 173.349	€ 191.275	€ 190.480
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.932	14.411	14.810
NIW je Anteil	€ 13,41	€ 13,27	€ 12,86
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.875.131	€ 1.986.158	€ 1.974.600
ausgegebene und umlaufende Anteile	70.250	74.563	78.287
NIW je Anteil	€ 26,69	€ 26,64	€ 25,22
ausschüttend	€ 528.684	€ 597.513	€ 512.652
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.725	36.436	32.355
NIW je Anteil	€ 16,16	€ 16,40	€ 15,84
Institutional GBP (Currency Exposure):			
thesaurierend	£ 2.439	£ 2.186	£ 3.343
ausgegebene und umlaufende Anteile	229	203	313
NIW je Anteil	£ 10,64	£ 10,76	£ 10,68
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 199.901	£ 189.318	£ 162.896
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.946	8.545	7.879
NIW je Anteil	£ 22,35	£ 22,16	£ 20,68
ausschüttend	£ 113.444	£ 117.923	£ 132.242
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.028	9.288	10.904
NIW je Anteil	£ 12,57	£ 12,70	£ 12,13
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 2.319.528	NOK 2.483.411	NOK 2.918.045
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.620	11.421	14.215
NIW je Anteil	NOK 218,40	NOK 217,44	NOK 205,28

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	Global Bond Fund (Forts.)					
Institutional NZD (Hedged):						
ausschüttend	NZD	113.204	NZD	148.154	NZD	167.929
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.685		3.487		4.162
NIW je Anteil	NZD	42,16	NZD	42,48	NZD	40,35
Institutional SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK	432.256	SEK	458.269	SEK	1.120.588
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.083		2.212		5.712
NIW je Anteil	SEK	207,56	SEK	207,22	SEK	196,17
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	663.516	SGD	229.722	SGD	217.237
ausgegebene und umlaufende Anteile		36.327		12.592		12.665
NIW je Anteil	SGD	18,27	SGD	18,24	SGD	17,15
ausschüttend	SGD	114	SGD	115		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		11		11		k. A.
NIW je Anteil	SGD	10,17	SGD	10,33		k. A.
Investor:						
thesaurierend	\$	228.184	\$	201.431	\$	94.643
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.212		6.417		3.244
NIW je Anteil	\$	31,64	\$	31,39	\$	29,18
ausschüttend	\$	41.448	\$	54.670	\$	28.517
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.695		3.529		1.948
NIW je Anteil	\$	15,38	\$	15,49	\$	14,64
Investor CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	107.633	CHF	125.907	CHF	145.814
ausgegebene und umlaufende Anteile		9.166		10.594		12.641
NIW je Anteil	CHF	11,74	CHF	11,88	CHF	11,53
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	85.009	€	84.542	€	75.495
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.411		3.393		3.189
NIW je Anteil	€	24,92	€	24,92	€	23,68
Investor GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	9.622	£	6.747	£	5.437
ausgegebene und umlaufende Anteile		460		325		280
NIW je Anteil	£	20,91	£	20,77	£	19,45
Investor NOK (Hedged):						
thesaurierend	NOK	54.667	NOK	62.521	NOK	23.662
ausgegebene und umlaufende Anteile		267		306		122
NIW je Anteil	NOK	205,02	NOK	204,47	NOK	193,71
Administrative:						
thesaurierend	\$	13.911	\$	13.375	\$	9.565
ausgegebene und umlaufende Anteile		453		439		337
NIW je Anteil	\$	30,70	\$	30,48	\$	28,38
Administrative SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK	76.477	SEK	124.505	SEK	114.069
ausgegebene und umlaufende Anteile		846		1.376		1.325
NIW je Anteil	SEK	90,40	SEK	90,48	SEK	86,08
Class E:						
thesaurierend	\$	360.515	\$	369.607	\$	326.703
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.320		12.696		12.006
NIW je Anteil	\$	29,26	\$	29,11	\$	27,21
ausschüttend	\$	132.197	\$	143.056	\$	101.393
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.000		10.742		8.054
NIW je Anteil	\$	13,22	\$	13,32	\$	12,59

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	Global Bond Fund (Forts.)					
Class E (Currency Exposure):						
thesaurierend	\$	35.412	\$	38.405	\$	34.705
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.959		3.130		2.994
NIW je Anteil	\$	11,97	\$	12,27	\$	11,59
ausschüttend	\$	17.705	\$	19.849	\$	13.040
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.782		1.925		1.324
NIW je Anteil	\$	9,94	\$	10,31	\$	9,85
Class E CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	2.471	CHF	2.398	CHF	1.921
ausgegebene und umlaufende Anteile		274		262		215
NIW je Anteil	CHF	9,01	CHF	9,14	CHF	8,92
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	662.309	€	698.781	€	685.427
ausgegebene und umlaufende Anteile		29.283		30.821		31.641
NIW je Anteil	€	22,62	€	22,67	€	21,66
ausschüttend	€	38.961	€	40.788	€	31.423
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.393		4.531		3.613
NIW je Anteil	€	8,87	€	9,00	€	8,70
G Retail EUR (Hedged):						
ausschüttend	€	91.982	€	68.720	€	66.161
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.154		7.568		7.543
NIW je Anteil	€	9,06	€	9,08	€	8,77
H Institutional:						
thesaurierend	\$	700.695	\$	743.816	\$	752.379
ausgegebene und umlaufende Anteile		21.031		22.522		24.551
NIW je Anteil	\$	33,32	\$	33,03	\$	30,65
ausschüttend	\$	2.311	\$	2.227	\$	2.035
ausgegebene und umlaufende Anteile		250		239		231
NIW je Anteil	\$	9,24	\$	9,30	\$	8,79
H Institutional (Currency Exposure):						
thesaurierend	\$	20.629	\$	150.642	\$	309.569
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.417		17.281		37.885
NIW je Anteil	\$	8,54	\$	8,72	\$	8,17
M Retail:						
ausschüttend II	\$	806	\$	854	\$	1.358
ausgegebene und umlaufende Anteile		88		92		153
NIW je Anteil	\$	9,14	\$	9,27	\$	8,89
M Retail HKD (Unhedged):						
ausschüttend II	HKD	16.243	HKD	18.703	HKD	5.118
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.773		2.013		575
NIW je Anteil	HKD	9,16	HKD	9,29	HKD	8,91
M Retail SGD (Hedged):						
ausschüttend II	SGD	22.816	SGD	13.975		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.287		1.370		k. A.
NIW je Anteil	SGD	9,98	SGD	10,20		k. A.
Class R EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	6.023	€	6.081	€	5.591
ausgegebene und umlaufende Anteile		541		547		530
NIW je Anteil	€	11,13	€	11,12	€	10,56
Class T:						
thesaurierend	\$	16.816	\$	17.137	\$	15.814
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.477		1.511		1.487
NIW je Anteil	\$	11,38	\$	11,34	\$	10,63
ausschüttend	\$	5.000	\$	5.367	\$	3.040
ausgegebene und umlaufende Anteile		474		506		303
NIW je Anteil	\$	10,54	\$	10,61	\$	10,04
Class T EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	24.361	€	24.878	€	14.560
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.522		2.566		1.567
NIW je Anteil	€	9,66	€	9,70	€	9,29
W Class:						
thesaurierend	\$	138.317	\$	118.273	\$	24.415
ausgegebene und umlaufende Anteile		14.120		12.197		2.721
NIW je Anteil	\$	9,80	\$	9,70	\$	8,97

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Global Bond Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
ausschüttend	\$ 59.610	\$ 54.179	\$ 9.498
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.608	5.964	1.106
NIW je Anteil	\$ 9,02	\$ 9,08	\$ 8,59
ausschüttend II	\$ 730	\$ 529	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	71	51	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,34	\$ 10,43	k. A.
W Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 35.881	CHF 32.887	CHF 24.828
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.067	3.691	2.884
NIW je Anteil	CHF 8,82	CHF 8,91	CHF 8,61
ausschüttend	CHF 7.043	CHF 4.389	CHF 705
ausgegebene und umlaufende Anteile	867	526	86
NIW je Anteil	CHF 8,12	CHF 8,34	CHF 8,24
W Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 53.445	€ 23.248	€ 9.594
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.812	2.535	1.106
NIW je Anteil	€ 9,20	€ 9,17	€ 8,68
ausschüttend	€ 5.184	€ 4.237	€ 2.352
ausgegebene und umlaufende Anteile	612	493	283
NIW je Anteil	€ 8,47	€ 8,59	€ 8,30
W Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 17.521	£ 16.595	£ 2.383
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.823	1.743	268
NIW je Anteil	£ 9,61	£ 9,52	£ 8,88
ausschüttend	£ 10.682	£ 8.538	£ 5.877
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.207	957	692
NIW je Anteil	£ 8,85	£ 8,92	£ 8,49
W Class NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 9.938	NOK 11.384	NOK 4.083
ausgegebene und umlaufende Anteile	106	122	46
NIW je Anteil	NOK 94,14	NOK 93,68	NOK 88,35
W Class SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 16.226	SGD 10.799	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.603	1.049	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,12	SGD 10,30	k. A.
	<b>Global Bond ESG Fund</b>		
Nettovermögen	\$ 3.892.824	\$ 3.561.180	\$ 3.106.190
Institutional:			
thesaurierend	\$ 367.947	\$ 365.875	\$ 366.227
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.079	32.142	34.584
NIW je Anteil	\$ 11,47	\$ 11,38	\$ 10,59
ausschüttend	\$ 38.093	\$ 47.502	\$ 65.549
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.005	4.956	7.213
NIW je Anteil	\$ 9,51	\$ 9,58	\$ 9,09
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 677.363	CHF 599.209	CHF 454.679
ausgegebene und umlaufende Anteile	72.584	63.416	49.550
NIW je Anteil	CHF 9,33	CHF 9,45	CHF 9,18

	Global Bond ESG Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Institutional EUR			
(Currency Exposure): thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 3.933
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	444
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 8,85
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.200.569	€ 928.944	€ 957.548
ausgegebene und umlaufende Anteile	121.546	94.043	101.940
NIW je Anteil	€ 9,88	€ 9,88	€ 9,39
ausschüttend	€ 43.989	€ 47.447	€ 92.352
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.014	5.326	10.695
NIW je Anteil	€ 8,77	€ 8,91	€ 8,63
Institutional GBP			
(Currency Exposure): ausschüttend	£ 24.136	£ 686	£ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.642	73	1
NIW je Anteil	£ 9,14	£ 9,38	£ 9,55
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 109.293	£ 101.214	£ 2.394
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.267	10.501	266
NIW je Anteil	£ 9,70	£ 9,64	£ 9,03
ausschüttend	£ 85.898	£ 79.564	£ 84.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.122	8.333	9.242
NIW je Anteil	£ 9,42	£ 9,55	£ 9,13
Institutional GBP (Unhedged):			
ausschüttend	£ 8.730	£ 8.646	£ 20.996
ausgegebene und umlaufende Anteile	942	928	2.240
NIW je Anteil	£ 9,27	£ 9,31	£ 9,37
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 6.549.025	NOK 6.352.155	NOK 5.366.868
ausgegebene und umlaufende Anteile	612.716	595.694	531.175
NIW je Anteil	NOK 10,69	NOK 10,66	NOK 10,10
Institutional NZD (Hedged):			
ausschüttend	NZD 70.668	NZD 70.237	NZD 64.722
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.086	6.984	6.755
NIW je Anteil	NZD 9,97	NZD 10,06	NZD 9,58
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 405.879	SEK 357.538	SEK 504.943
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.439	3.909	5.807
NIW je Anteil	SEK 91,43	SEK 91,47	SEK 86,95
Investor:			
thesaurierend	\$ 6.996	\$ 12.932	\$ 8.195
ausgegebene und umlaufende Anteile	643	1.195	811
NIW je Anteil	\$ 10,88	\$ 10,82	\$ 10,10
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 146.823	SEK 89.882	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.428	871	k. A.
NIW je Anteil	SEK 102,85	SEK 103,14	k. A.
Class E:			
ausschüttend	\$ 4.167	\$ 4.640	\$ 3.846
ausgegebene und umlaufende Anteile	422	467	408
NIW je Anteil	\$ 9,86	\$ 9,94	\$ 9,42

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2024		31. Dez. 2023		31. Dez. 2022	
<b>Global Bond ESG Fund (Forts.)</b>						
Class E CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	2.997	CHF	1.699	CHF	77
ausgegebene und umlaufende Anteile		309		172		8
NIW je Anteil	CHF	9,69	CHF	9,86	CHF	9,66
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	40.471	€	41.956	€	38.263
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.372		4.512		4.288
NIW je Anteil	€	9,26	€	9,30	€	8,92
Class Z AUD (Hedged):						
ausschüttend	AUD	513.054	AUD	490.444	AUD	356.037
ausgegebene und umlaufende Anteile		52.796		49.785		37.495
NIW je Anteil	AUD	9,72	AUD	9,85	AUD	9,50
<b>Global Bond Ex-US Fund</b>						
Nettovermögen	\$	884.296	\$	800.126	\$	716.022
Institutional:						
thesaurierend	\$	508.968	\$	461.455	\$	420.156
ausgegebene und umlaufende Anteile		20.491		18.846		18.790
NIW je Anteil	\$	24,84	\$	24,49	\$	22,36
ausschüttend	\$	45.584	\$	38.610	\$	32.820
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.873		2.428		2.206
NIW je Anteil	\$	15,87	\$	15,90	\$	14,88
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	19.290	€	22.817	€	45.032
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.116		1.329		2.816
NIW je Anteil	€	17,28	€	17,16	€	15,99
Investor:						
thesaurierend	\$	6.267	\$	6.785	\$	6.657
ausgegebene und umlaufende Anteile		269		295		316
NIW je Anteil	\$	23,28	\$	22,99	\$	21,07
Administrative:						
thesaurierend	\$	10.452	\$	10.238	\$	10.720
ausgegebene und umlaufende Anteile		465		460		525
NIW je Anteil	\$	22,50	\$	22,23	\$	20,41
Class E:						
ausschüttend	\$	59.519	\$	42.176	\$	23.336
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.862		2.731		1.615
NIW je Anteil	\$	15,41	\$	15,44	\$	14,45
Class E (Currency Exposure):						
ausschüttend	\$	37.881	\$	54.158	\$	62.837
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.793		6.463		7.858
NIW je Anteil	\$	7,90	\$	8,38	\$	8,00
H Institutional:						
thesaurierend	\$	77.771	\$	46.259	\$	6.714
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.978		4.207		667
NIW je Anteil	\$	11,14	\$	11,00	\$	10,06
Class Z:						
thesaurierend	\$	117.180	\$	115.239	\$	104.722
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.957		10.957		10.957
NIW je Anteil	\$	10,69	\$	10,52	\$	9,56
<b>Global High Yield Bond Fund</b>						
Nettovermögen	\$	3.005.969	\$	2.980.250	\$	3.102.868
Institutional:						
thesaurierend	\$	613.102	\$	633.820	\$	579.939
ausgegebene und umlaufende Anteile		20.365		21.624		22.368
NIW je Anteil	\$	30,11	\$	29,31	\$	25,93

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2024		31. Dez. 2023		31. Dez. 2022	
<b>Global High Yield Bond Fund (Forts.)</b>						
ausschüttend	\$	298.007	\$	298.704	\$	292.202
ausgegebene und umlaufende Anteile		28.459		28.490		29.927
NIW je Anteil	\$	10,47	\$	10,48	\$	9,76
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	24.851	CHF	24.625	CHF	22.915
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.431		1.428		1.439
NIW je Anteil	CHF	17,36	CHF	17,24	CHF	15,92
ausschüttend	CHF	3.608	CHF	3.467	CHF	3.237
ausgegebene und umlaufende Anteile		483		454		436
NIW je Anteil	CHF	7,47	CHF	7,64	CHF	7,43
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	697.104	€	698.966	€	725.182
ausgegebene und umlaufende Anteile		27.833		28.447		32.640
NIW je Anteil	€	25,05	€	24,57	€	22,22
ausschüttend	€	209.475	€	136.798	€	155.150
ausgegebene und umlaufende Anteile		20.561		13.305		15.853
NIW je Anteil	€	10,19	€	10,28	€	9,79
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	50.392	£	45.376	£	31.335
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.976		2.749		2.130
NIW je Anteil	£	16,93	£	16,51	£	14,71
ausschüttend	£	212.021	£	215.523	£	292.800
ausgegebene und umlaufende Anteile		40.590		41.123		59.445
NIW je Anteil	£	5,22	£	5,24	£	4,93
Investor:						
thesaurierend	\$	1.681	\$	2.146	\$	1.820
ausgegebene und umlaufende Anteile		119		156		149
NIW je Anteil	\$	14,08	\$	13,73	\$	12,19
ausschüttend	\$	11	\$	11		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	10,71	\$	10,72		k. A.
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	1.106	€	5.450	€	12.416
ausgegebene und umlaufende Anteile		46		232		583
NIW je Anteil	€	23,88	€	23,47	€	21,30
Administrative:						
thesaurierend	\$	21.560	\$	22.199	\$	30.795
ausgegebene und umlaufende Anteile		775		818		1.276
NIW je Anteil	\$	27,82	\$	27,15	\$	24,14
ausschüttend	\$	16.546	\$	16.634	\$	21.259
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.615		1.621		2.225
NIW je Anteil	\$	10,25	\$	10,26	\$	9,56
BM Retail:						
ausschüttend II	\$	4.882	\$	3.173	\$	10
ausgegebene und umlaufende Anteile		505		324		1
NIW je Anteil	\$	9,67	\$	9,78	\$	9,34
Class E:						
thesaurierend	\$	124.584	\$	123.931	\$	129.353
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.856		4.939		5.776
NIW je Anteil	\$	25,66	\$	25,09	\$	22,40
ausschüttend	\$	76.886	\$	96.084	\$	109.532
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.454		9.302		11.389
NIW je Anteil	\$	10,32	\$	10,33	\$	9,62
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	213.737	€	224.500	€	224.727
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.914		9.501		10.424
NIW je Anteil	€	23,98	€	23,63	€	21,56
ausschüttend	€	25.844	€	27.762	€	27.782
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.103		3.303		3.472
NIW je Anteil	€	8,33	€	8,40	€	8,00

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

		Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Global High Yield Bond Fund (Forts.)</b>				
Class E GBP (Hedged):				
ausschüttend	£	3.433	£ 3.519	£ 5.932
ausgegebene und umlaufende Anteile		311	318	572
NIW je Anteil	£	11,03	£ 11,06	£ 10,38
Class E SGD (Hedged):				
ausschüttend	SGD	12.975	SGD 8.215	SGD 6.387
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.380	865	711
NIW je Anteil	SGD	9,40	SGD 9,50	SGD 8,98
H Institutional:				
thesaurierend	\$	153.860	\$ 128.939	\$ 218.500
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.332	4.586	8.771
NIW je Anteil	\$	28,86	\$ 28,12	\$ 24,91
ausschüttend	\$	7.701	\$ 7.523	\$ 4.003
ausgegebene und umlaufende Anteile		830	809	462
NIW je Anteil	\$	9,28	\$ 9,29	\$ 8,66
M Retail:				
ausschüttend	\$	15.995	\$ 16.994	\$ 17.710
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.570	1.667	1.865
NIW je Anteil	\$	10,19	\$ 10,20	\$ 9,50
ausschüttend II	\$	53.500	\$ 34.630	\$ 35.654
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.649	4.268	4.652
NIW je Anteil	\$	8,05	\$ 8,11	\$ 7,66
Class R:				
thesaurierend	\$	2.062	\$ 2.439	\$ 2.617
ausgegebene und umlaufende Anteile		125	152	184
NIW je Anteil	\$	16,48	\$ 16,06	\$ 14,25
Class T:				
thesaurierend	\$	6.810	\$ 5.769	\$ 5.339
ausgegebene und umlaufende Anteile		501	433	448
NIW je Anteil	\$	13,58	\$ 13,31	\$ 11,93
ausschüttend	\$	1.899	\$ 2.662	\$ 1.796
ausgegebene und umlaufende Anteile		198	277	200
NIW je Anteil	\$	9,61	\$ 9,62	\$ 8,96
<b>Global High Yield Bond ESG Fund</b>				
Nettovermögen	\$	9.778	k. A.	k. A.
Institutional:				
thesaurierend	\$	9.235	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		921	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$	10,03	k. A.	k. A.
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	233	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		23	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€	10,02	k. A.	k. A.
Institutional GBP (Hedged):				
thesaurierend	£	200	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		20	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£	10,03	k. A.	k. A.
Class E:				
ausschüttend	\$	10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$	10,02	k. A.	k. A.
Class E EUR (Hedged):				
ausschüttend	€	9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€	10,01	k. A.	k. A.
Class E GBP (Hedged):				
ausschüttend	£	8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£	10,02	k. A.	k. A.
Class Z:				
thesaurierend	\$	10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$	10,03	k. A.	k. A.

		Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>				
Nettovermögen	\$	9.129.313	\$ 10.713.722	\$ 10.538.341
Institutional:				
thesaurierend	\$	2.482.595	\$ 3.012.636	\$ 2.618.560
ausgegebene und umlaufende Anteile		120.994	148.124	140.682
NIW je Anteil	\$	20,52	\$ 20,34	\$ 18,61
ausschüttend	\$	519.141	\$ 587.774	\$ 474.941
ausgegebene und umlaufende Anteile		46.318	51.901	44.276
NIW je Anteil	\$	11,21	\$ 11,32	\$ 10,73
Institutional (Currency Exposure):				
thesaurierend	\$	117.261	\$ 117.937	\$ 100.855
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.898	7.912	7.439
NIW je Anteil	\$	14,85	\$ 14,91	\$ 13,56
ausschüttend	\$	14.106	\$ 19.023	\$ 22.435
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.716	2.261	2.833
NIW je Anteil	\$	8,22	\$ 8,41	\$ 7,92
Institutional AUD (Hedged):				
ausschüttend	AUD	6.159	AUD 6.260	AUD 7.370
ausgegebene und umlaufende Anteile		706	705	861
NIW je Anteil	AUD	8,73	AUD 8,87	AUD 8,56
Institutional CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	463.030	CHF 529.814	CHF 656.465
ausgegebene und umlaufende Anteile		30.270	34.237	44.353
NIW je Anteil	CHF	15,30	CHF 15,47	CHF 14,80
ausschüttend	CHF	28.676	CHF 31.431	CHF 33.474
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.089	4.344	4.674
NIW je Anteil	CHF	7,01	CHF 7,24	CHF 7,16
Institutional CZK (Hedged):				
ausschüttend	CZK	184.605	CZK 195.936	CZK 339.010
ausgegebene und umlaufende Anteile		21.305	22.425	41.499
NIW je Anteil	CZK	8,66	CZK 8,74	CZK 8,17
Institutional EUR (Currency Exposure):				
thesaurierend	€	48.496	€ 47.238	€ 43.714
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.501	3.501	3.441
NIW je Anteil	€	13,85	€ 13,49	€ 12,70
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	872.626	€ 1.004.207	€ 1.343.974
ausgegebene und umlaufende Anteile		48.549	55.930	79.965
NIW je Anteil	€	17,97	€ 17,95	€ 16,81
ausschüttend	€	343.274	€ 365.512	€ 447.965
ausgegebene und umlaufende Anteile		35.937	37.572	47.525
NIW je Anteil	€	9,55	€ 9,73	€ 9,43
Institutional GBP (Hedged):				
thesaurierend	£	130.012	£ 125.032	£ 112.550
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.361	6.164	6.014
NIW je Anteil	£	20,44	£ 20,29	£ 18,72
ausschüttend	£	624.086	£ 637.646	£ 767.395
ausgegebene und umlaufende Anteile		54.764	55.185	69.403
NIW je Anteil	£	11,40	£ 11,55	£ 11,06

		Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)</b>				
Institutional HKD (Unhedged):				
ausschüttend	HKD	81.289	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.191	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	HKD	9,92	k. A.	k. A.
Institutional NOK (Hedged):				
thesaurierend	NOK	281.332	NOK 287.785	NOK 258.128
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.958	2.009	1.931
NIW je Anteil	NOK	143,70	NOK 143,24	NOK 133,69
Institutional SEK (Hedged):				
thesaurierend	SEK	2.822.320	SEK 2.820.196	SEK 2.527.557
ausgegebene und umlaufende Anteile		183.953	183.913	176.118
NIW je Anteil	SEK	15,34	SEK 15,33	SEK 14,35
Institutional SGD (Hedged):				
ausschüttend	SGD	22.225	SGD 98.125	SGD 11.301
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.489	10.785	1.291
NIW je Anteil	SGD	8,93	SGD 9,10	SGD 8,76
Investor:				
thesaurierend	\$	267.296	\$ 337.303	\$ 440.714
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.018	15.273	21.729
NIW je Anteil	\$	22,24	\$ 22,08	\$ 20,28
ausschüttend	\$	76.275	\$ 143.565	\$ 131.169
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.395	11.912	11.489
NIW je Anteil	\$	11,93	\$ 12,05	\$ 11,42
Investor AUD (Hedged):				
ausschüttend	AUD	1.947	AUD 8.369	AUD 10.542
ausgegebene und umlaufende Anteile		228	961	1.256
NIW je Anteil	AUD	8,56	AUD 8,70	AUD 8,39
Investor CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	4.894	CHF 4.911	CHF 5.359
ausgegebene und umlaufende Anteile		439	435	494
NIW je Anteil	CHF	11,14	CHF 11,29	CHF 10,84
ausschüttend	CHF	3.897	CHF 4.293	CHF 5.334
ausgegebene und umlaufende Anteile		431	461	578
NIW je Anteil	CHF	9,03	CHF 9,32	CHF 9,23
Investor EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	27.933	€ 31.093	€ 26.086
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.657	1.843	1.646
NIW je Anteil	€	16,86	€ 16,87	€ 15,85
ausschüttend	€	9.870	€ 10.366	€ 11.379
ausgegebene und umlaufende Anteile		986	1.016	1.151
NIW je Anteil	€	10,02	€ 10,20	€ 9,88
Investor GBP (Hedged):				
ausschüttend	£	4.736	£ 4.257	£ 4.175
ausgegebene und umlaufende Anteile		426	379	389
NIW je Anteil	£	11,11	£ 11,24	£ 10,73
Investor SGD (Hedged):				
ausschüttend	SGD	4.203	SGD 7.115	SGD 7.277
ausgegebene und umlaufende Anteile		483	802	852
NIW je Anteil	SGD	8,71	SGD 8,88	SGD 8,54

		Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)</b>				
Administrative:				
thesaurierend	\$	92.936	\$ 88.580	\$ 76.931
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.893	4.693	4.431
NIW je Anteil	\$	19,00	\$ 18,88	\$ 17,36
ausschüttend	\$	67.423	\$ 70.601	\$ 47.290
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.848	6.060	4.285
NIW je Anteil	\$	11,53	\$ 11,65	\$ 11,04
Administrative CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	167	CHF 173	CHF 391
ausgegebene und umlaufende Anteile		17	17	41
NIW je Anteil	CHF	9,78	CHF 9,92	CHF 9,54
Administrative EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	10.315	€ 10.048	€ 7.522
ausgegebene und umlaufende Anteile		649	632	503
NIW je Anteil	€	15,89	€ 15,91	€ 14,97
ausschüttend	€	8.438	€ 9.002	€ 7.846
ausgegebene und umlaufende Anteile		873	914	822
NIW je Anteil	€	9,67	€ 9,85	€ 9,54
Administrative GBP (Hedged):				
ausschüttend	£	6.475	£ 6.900	£ 4.557
ausgegebene und umlaufende Anteile		586	617	427
NIW je Anteil	£	11,05	£ 11,18	£ 10,68
Administrative HKD (Unhedged):				
ausschüttend	HKD	35.587	HKD 35.963	HKD 10.505
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.033	4.033	1.244
NIW je Anteil	HKD	8,82	HKD 8,92	HKD 8,44
Administrative SEK (Hedged):				
thesaurierend	SEK	58.401	SEK 61.831	SEK 901.901
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.426	5.733	88.869
NIW je Anteil	SEK	10,76	SEK 10,78	SEK 10,15
Administrative SGD (Hedged):				
ausschüttend	SGD	16.405	SGD 19.497	SGD 2.918
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.952	2.276	354
NIW je Anteil	SGD	8,40	SGD 8,56	SGD 8,24
BM Retail:				
nichtkumulierend	\$	5.986	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		627	1	k. A.
NIW je Anteil	\$	9,54	\$ 9,95	k. A.
Class E:				
thesaurierend	\$	714.501	\$ 726.293	\$ 605.749
ausgegebene und umlaufende Anteile		40.021	40.860	36.905
NIW je Anteil	\$	17,85	\$ 17,78	\$ 16,41
ausschüttend	\$	219.212	\$ 249.811	\$ 216.440
ausgegebene und umlaufende Anteile		18.021	20.324	18.589
NIW je Anteil	\$	12,16	\$ 12,29	\$ 11,64
Class E CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	44.879	CHF 48.855	CHF 52.629
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.467	4.786	5.342
NIW je Anteil	CHF	10,05	CHF 10,21	CHF 9,85
E Class EUR (Currency Exposure):				
ausschüttend	€	1.384	€ 1.375	€ 1.340
ausgegebene und umlaufende Anteile		148	148	148
NIW je Anteil	€	9,33	€ 9,26	€ 9,03
Class E EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	297.168	€ 350.203	€ 451.796
ausgegebene und umlaufende Anteile		19.489	22.889	31.264
NIW je Anteil	€	15,25	€ 15,30	€ 14,45
ausschüttend	€	182.685	€ 191.362	€ 197.011
ausgegebene und umlaufende Anteile		22.173	22.805	24.230
NIW je Anteil	€	8,24	€ 8,39	€ 8,13

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

		Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)</b>				
Class E GBP (Hedged):				
ausschüttend	£	19.369	£ 20.954	£ 20.979
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.678	1.795	1.881
NIW je Anteil	£	11,54	£ 11,68	£ 11,15
Class E SGD (Hedged):				
ausschüttend	SGD	52.865	SGD 48.801	SGD 30.453
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.910	5.352	3.472
NIW je Anteil	SGD	8,95	SGD 9,12	SGD 8,77
H Institutional:				
thesaurierend	\$	293.082	\$ 485.344	\$ 282.176
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.765	22.978	14.572
NIW je Anteil	\$	21,29	\$ 21,12	\$ 19,36
ausschüttend	\$	18.574	\$ 18.189	\$ 17.320
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.053	1.990	2.000
NIW je Anteil	\$	9,05	\$ 9,14	\$ 8,66
H Institutional (Currency Exposure):				
thesaurierend	\$	9.063	\$ 85.535	\$ 184.082
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.031	9.678	22.850
NIW je Anteil	\$	8,79	\$ 8,84	\$ 8,06
M Retail:				
nichtkumulierend	\$	18.312	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.908	1	k. A.
NIW je Anteil	\$	9,60	\$ 9,96	k. A.
ausschüttend	\$	27.321	\$ 28.765	\$ 25.037
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.967	3.092	2.840
NIW je Anteil	\$	9,21	\$ 9,30	\$ 8,82
ausschüttend II	\$	76.979	\$ 89.186	\$ 86.672
ausgegebene und umlaufende Anteile		9.425	10.736	10.861
NIW je Anteil	\$	8,17	\$ 8,31	\$ 7,98
M Retail HKD (Unhedged):				
ausschüttend	HKD	9.001	HKD 9.098	HKD 8.376
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.019	1.019	990
NIW je Anteil	HKD	8,84	HKD 8,93	HKD 8,46
Class R:				
thesaurierend	\$	8.713	\$ 11.284	\$ 16.316
ausgegebene und umlaufende Anteile		672	876	1.381
NIW je Anteil	\$	12,97	\$ 12,88	\$ 11,81
ausschüttend	\$	4.475	\$ 4.627	\$ 4.870
ausgegebene und umlaufende Anteile		490	502	558
NIW je Anteil	\$	9,12	\$ 9,22	\$ 8,73
Class R EUR (Hedged):				
ausschüttend	€	1.655	€ 2.174	€ 2.758
ausgegebene und umlaufende Anteile		215	278	364
NIW je Anteil	€	7,69	€ 7,83	€ 7,59
Class R GBP (Hedged):				
ausschüttend	£	5.615	£ 6.122	£ 8.117
ausgegebene und umlaufende Anteile		667	718	998
NIW je Anteil	£	8,42	£ 8,52	£ 8,14
Class T:				
thesaurierend	\$	24.568	\$ 26.285	\$ 28.595
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.214	2.375	2.786
NIW je Anteil	\$	11,10	\$ 11,07	\$ 10,26
Class T EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	3.306	€ 4.398	€ 3.508
ausgegebene und umlaufende Anteile		353	467	393
NIW je Anteil	€	9,36	€ 9,41	€ 8,92
W Class:				
thesaurierend	\$	37.135	\$ 43.413	\$ 32.822
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.906	4.609	3.811
NIW je Anteil	\$	9,51	\$ 9,42	\$ 8,61
ausschüttend	\$	19.262	\$ 20.522	\$ 11.533
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.296	2.421	1.437
NIW je Anteil	\$	8,39	\$ 8,48	\$ 8,03

		Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)</b>				
W Class CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	18.254	CHF 20.410	CHF 20.144
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.136	2.362	2.440
NIW je Anteil	CHF	8,55	CHF 8,64	CHF 8,26
W Class EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	16.231	€ 15.763	€ 14.812
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.823	1.773	1.781
NIW je Anteil	€	8,90	€ 8,89	€ 8,31
ausschüttend	€	4.835	€ 5.515	€ 2.194
ausgegebene und umlaufende Anteile		616	690	283
NIW je Anteil	€	7,84	€ 7,99	€ 7,74
W Class GBP (Hedged):				
thesaurierend	£	4.139	£ 3.652	£ 3.270
ausgegebene und umlaufende Anteile		445	396	385
NIW je Anteil	£	9,30	£ 9,22	£ 8,50
ausschüttend	£	12.818	£ 13.232	£ 6.970
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.564	1.596	881
NIW je Anteil	£	8,19	£ 8,29	£ 7,92
W Class SGD (Hedged):				
ausschüttend	SGD	12.676	SGD 14.814	SGD 4.506
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.552	1.780	563
NIW je Anteil	SGD	8,17	SGD 8,32	SGD 8,01
<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>				
Nettovermögen	\$	2.217.461	\$ 2.170.207	\$ 1.369.890
Institutional:				
thesaurierend	\$	92.420	\$ 64.347	\$ 61.632
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.122	5.695	5.924
NIW je Anteil	\$	11,38	\$ 11,30	\$ 10,40
ausschüttend	\$	130.282	\$ 121.717	\$ 10.347
ausgegebene und umlaufende Anteile		14.110	13.032	1.167
NIW je Anteil	\$	9,23	\$ 9,34	\$ 8,86
Institutional CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	169.061	CHF 190.076	CHF 190.278
ausgegebene und umlaufende Anteile		17.547	19.472	20.258
NIW je Anteil	CHF	9,63	CHF 9,76	CHF 9,39
ausschüttend	CHF	2.566	CHF 3.016	CHF 2.020
ausgegebene und umlaufende Anteile		328	374	253
NIW je Anteil	CHF	7,82	CHF 8,07	CHF 8,00
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	570.454	€ 538.219	€ 220.186
ausgegebene und umlaufende Anteile		56.325	53.109	23.072
NIW je Anteil	€	10,13	€ 10,13	€ 9,54
ausschüttend	€	250.936	€ 243.292	€ 320.757
ausgegebene und umlaufende Anteile		30.724	29.217	39.702
NIW je Anteil	€	8,17	€ 8,33	€ 8,08
Institutional GBP (Hedged):				
thesaurierend	£	46.474	£ 31.445	£ 72.284
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.320	2.940	7.283
NIW je Anteil	£	10,76	£ 10,70	£ 9,92

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)					
ausschüttend	£	232.422	£	270.851	£	87.512
ausgegebene und umlaufende Anteile		25.754		29.628		9.955
NIW je Anteil	£	9,02	£	9,14	£	8,79
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend	SEK	37.352	SEK	32.957	SEK	11.028
ausgegebene und umlaufende Anteile		340		299		106
NIW je Anteil	SEK	109,94	SEK	110,07	SEK	103,64
Investor: thesaurierend	\$	156	\$	130	\$	217
ausgegebene und umlaufende Anteile		17		14		25
NIW je Anteil	\$	9,32	\$	9,27	\$	8,56
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€	10	€	10		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	€	10,48	€	10,50		k. A.
ausschüttend	€	10	€	10		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	€	10,03	€	10,23		k. A.
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK	5.450.651	SEK	4.672.844	SEK	3.047.191
ausgegebene und umlaufende Anteile		59.509		50.829		35.030
NIW je Anteil	SEK	91,59	SEK	91,93	SEK	86,99
Class E: thesaurierend	\$	11.365	\$	10.138	\$	1.735
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.214		1.086		200
NIW je Anteil	\$	9,36	\$	9,34	\$	8,68
ausschüttend	\$	2.558	\$	3.728	\$	446
ausgegebene und umlaufende Anteile		291		419		53
NIW je Anteil	\$	8,80	\$	8,90	\$	8,45
Class E CHF (Hedged): thesaurierend	CHF	446	CHF	402	CHF	491
ausgegebene und umlaufende Anteile		54		48		60
NIW je Anteil	CHF	8,32	CHF	8,46	CHF	8,22
ausschüttend	CHF	24	CHF	24	CHF	24
ausgegebene und umlaufende Anteile		3		3		3
NIW je Anteil	CHF	7,82	CHF	8,07	CHF	8,00
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€	29.780	€	16.648	€	3.370
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.427		1.906		406
NIW je Anteil	€	8,69	€	8,73	€	8,29
ausschüttend	€	585	€	638	€	581
ausgegebene und umlaufende Anteile		72		77		72
NIW je Anteil	€	8,16	€	8,32	€	8,07
Class E GBP (Hedged): thesaurierend	£	691	£	690	£	420
ausgegebene und umlaufende Anteile		76		76		50
NIW je Anteil	£	9,08	£	9,06	£	8,49
Class Z: thesaurierend	\$	4.630	\$	4.612	\$	19.339
ausgegebene und umlaufende Anteile		431		434		1.986
NIW je Anteil	\$	10,73	\$	10,63	\$	9,74

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	Global Low Duration Real Return Fund					
Nettovermögen	\$	1.007.987	\$	1.177.052	\$	1.364.375
Institutional: thesaurierend	\$	49.466	\$	59.349	\$	136.292
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.890		4.779		11.554
NIW je Anteil	\$	12,72	\$	12,42	\$	11,80
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF	37.215	CHF	37.402	CHF	22.752
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.714		3.747		2.303
NIW je Anteil	CHF	10,02	CHF	9,98	CHF	9,88
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€	210.068	€	267.868	€	498.384
ausgegebene und umlaufende Anteile		19.552		25.334		48.614
NIW je Anteil	€	10,74	€	10,57	€	10,25
ausschüttend	€	23.890	€	24.318	€	34.131
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.745		2.748		3.856
NIW je Anteil	€	8,70	€	8,85	€	8,85
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£	36.732	£	34.278	£	55.816
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.153		3.010		5.128
NIW je Anteil	£	11,65	£	11,39	£	10,88
ausschüttend	£	35.252	£	67.020	£	62.640
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.848		7.240		6.761
NIW je Anteil	£	9,16	£	9,26	£	9,26
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	SGD	621.394	SGD	609.791	SGD	351.313
ausgegebene und umlaufende Anteile		58.638		58.427		34.943
NIW je Anteil	SGD	10,60	SGD	10,44	SGD	10,05
Investor: thesaurierend	\$	4.391	\$	4.357	\$	6.751
ausgegebene und umlaufende Anteile		359		364		591
NIW je Anteil	\$	12,25	\$	11,98	\$	11,42
Class E: thesaurierend	\$	20.221	\$	24.371	\$	34.924
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.746		2.145		3.206
NIW je Anteil	\$	11,58	\$	11,36	\$	10,89
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€	86.070	€	118.010	€	177.147
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.797		12.201		18.721
NIW je Anteil	€	9,78	€	9,67	€	9,46
Nettovermögen	\$	2.163.786	\$	2.381.093	\$	2.571.862
Institutional: thesaurierend	\$	257.449	\$	286.542	\$	272.591
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.382		12.657		12.628
NIW je Anteil	\$	22,62	\$	22,64	\$	21,59
ausschüttend	\$	5.562	\$	5.867	\$	12.328
ausgegebene und umlaufende Anteile		364		373		796
NIW je Anteil	\$	15,28	\$	15,71	\$	15,49
Institutional (Currency Exposure): thesaurierend	\$	48.401	\$	49.161	\$	47.075
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.759		4.759		4.828
NIW je Anteil	\$	10,17	\$	10,33	\$	9,75

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Global Real Return Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 49.175	CHF 52.476	CHF 56.131
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.805	3.973	4.267
NIW je Anteil	CHF 12,92	CHF 13,21	CHF 13,15
ausschüttend	CHF 25.906	CHF 27.158	CHF 33.615
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.252	3.248	3.898
NIW je Anteil	CHF 7,97	CHF 8,36	CHF 8,62
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 575.308	€ 664.628	€ 824.251
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.291	35.832	45.572
NIW je Anteil	€ 18,39	€ 18,55	€ 18,09
ausschüttend	€ 81.658	€ 84.433	€ 98.750
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.705	6.690	7.750
NIW je Anteil	€ 12,18	€ 12,62	€ 12,74
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 30.926	£ 34.169	£ 38.820
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.530	2.789	3.298
NIW je Anteil	£ 12,23	£ 12,25	£ 11,77
ausschüttend	£ 187.418	£ 185.264	£ 205.454
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.291	23.332	25.531
NIW je Anteil	£ 7,72	£ 7,94	£ 8,05
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 354.693	SGD 243.298	SGD 236.796
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.938	14.905	14.984
NIW je Anteil	SGD 16,17	SGD 16,32	SGD 15,80
Investor:			
thesaurierend	\$ 30.433	\$ 33.204	\$ 63.935
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.447	1.575	3.170
NIW je Anteil	\$ 21,03	\$ 21,08	\$ 20,17
ausschüttend	\$ 12.023	\$ 12.287	\$ 9.038
ausgegebene und umlaufende Anteile	903	898	669
NIW je Anteil	\$ 13,31	\$ 13,68	\$ 13,51
Investor CHF (Hedged):			
ausschüttend	CHF 981	CHF 1.598	CHF 2.516
ausgegebene und umlaufende Anteile	98	152	232
NIW je Anteil	CHF 10,03	CHF 10,53	CHF 10,85
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 8.105	€ 20.092	€ 22.838
ausgegebene und umlaufende Anteile	473	1.160	1.347
NIW je Anteil	€ 17,14	€ 17,32	€ 16,95
Administrative:			
thesaurierend	\$ 34.229	\$ 36.683	\$ 43.396
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.668	1.782	2.200
NIW je Anteil	\$ 20,52	\$ 20,59	\$ 19,73
Class E:			
thesaurierend	\$ 105.544	\$ 124.585	\$ 153.574
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.512	6.472	8.292
NIW je Anteil	\$ 19,15	\$ 19,25	\$ 18,52
ausschüttend	\$ 24.371	\$ 28.387	\$ 38.490
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.902	2.155	2.958
NIW je Anteil	\$ 12,81	\$ 13,17	\$ 13,01
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 151.416	€ 216.460	€ 234.441
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.717	13.708	15.090
NIW je Anteil	€ 15,58	€ 15,79	€ 15,54
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 140.495	\$ 145.477	\$ 90.138
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.423	6.639	4.307
NIW je Anteil	\$ 21,87	\$ 21,91	\$ 20,93
Class R:			
thesaurierend	\$ 310	\$ 903	\$ 1.569
ausgegebene und umlaufende Anteile	25	73	132
NIW je Anteil	\$ 12,37	\$ 12,40	\$ 11,85

	Global Real Return Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
R Class GBP (Hedged):			
Accumulation	£ 5.953	£ 6.705	£ 8.283
Shares issued and outstanding	519	583	747
NAV per share	£ 11,47	£ 11,51	£ 11,09
Net Assets	\$ 78.833.154	\$ 70.543.117	\$ 57.980.327
Institutional:			
Accumulation	\$ 12.475.169	\$ 10.887.096	\$ 9.197.801
Shares issued and outstanding	713.299	634.431	582.256
NAV per share	\$ 17,49	\$ 17,16	\$ 15,80
Income	\$ 6.024.141	\$ 5.004.823	\$ 4.597.148
Shares issued and outstanding	565.694	464.458	435.389
NAV per share	\$ 10,65	\$ 10,78	\$ 10,56
Institutional AUD (Hedged):			
Accumulation	AUD 113.679	AUD 100.109	AUD 80.591
Shares issued and outstanding	9.939	8.864	7.611
NAV per share	AUD 11,44	AUD 11,29	AUD 10,59
Income	AUD 1.466	AUD 246	k. A.
Shares issued and outstanding	146	24	k. A.
NAV per share	AUD 10,04	AUD 10,23	k. A.
Institutional BRL (Hedged):			
Accumulation	\$ 354.298	\$ 353.963	\$ 274.136
Shares issued and outstanding	22.815	20.644	20.003
NAV per share	\$ 15,53	\$ 17,15	\$ 13,70
Institutional CAD (Hedged):			
Accumulation	CAD 68.305	CAD 95.099	CAD 83.552
Shares issued and outstanding	5.096	7.208	6.821
NAV per share	CAD 13,40	CAD 13,19	CAD 12,25
Income	CAD 95.560	CAD 122.367	CAD 117.940
Shares issued and outstanding	10.537	13.288	12.956
NAV per share	CAD 9,07	CAD 9,21	CAD 9,10
Institutional CHF (Hedged):			
Accumulation	CHF 302.173	CHF 324.097	CHF 293.823
Shares issued and outstanding	26.245	28.117	26.495
NAV per share	CHF 11,51	CHF 11,53	CHF 11,09
Income	CHF 198.276	CHF 157.673	CHF 135.996
Shares issued and outstanding	26.735	20.540	17.253
NAV per share	CHF 7,42	CHF 7,68	CHF 7,88
Institutional EUR (Hedged):			
Accumulation	€ 5.259.072	€ 5.358.424	€ 4.856.302
ausgegebene und umlaufende Anteile	359.959	370.909	356.885
NIW je Anteil	€ 14,61	€ 14,45	€ 13,61
ausschüttend	€ 776.788	€ 798.611	€ 858.841
ausgegebene und umlaufende Anteile	89.616	90.229	96.621
NIW je Anteil	€ 8,67	€ 8,85	€ 8,89
ausschüttend II	€ 184.456	€ 23.567	€ 13.739
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.707	2.620	1.555
NIW je Anteil	€ 8,91	€ 8,99	€ 8,84

	Income Fund (Forts.)			Income Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 283.476	£ 249.561	£ 179.687	€ 23.326	€ 24.484	€ 29.277
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.005	22.404	17.378	2.896	3.069	3.673
NIW je Anteil	£ 11,34	£ 11,14	£ 10,34	€ 8,05	€ 7,98	€ 7,97
ausschüttend	£ 655.001	£ 583.372	£ 437.940			
ausgegebene und umlaufende Anteile	72.565	63.749	48.401			
NIW je Anteil	£ 9,03	£ 9,15	£ 9,05			
Institutional HKD (Unhedged):						
ausschüttend	HKD 460.182	HKD 300.633	HKD 448.226			
ausgegebene und umlaufende Anteile	47.296	30.526	46.468			
NIW je Anteil	HKD 9,73	HKD 9,85	HKD 9,65			
Institutional JPY (Hedged):						
thesaurierend	¥ 5.055.099	¥ 2.154.442	k. A.	¥ 153.406	¥ 1.376	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.968	2.097	k. A.	152	1	k. A.
NIW je Anteil	¥ 1.018,00	¥ 1.027,00	k. A.	¥ 1.010,00	¥ 1.021,00	k. A.
ausschüttend	¥ 1.454	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	2	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	¥ 963,00	k. A.	k. A.			
Institutional NOK (Hedged):						
thesaurierend	NOK 2.359.212	NOK 2.372.450	NOK 2.153.310			
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.230	20.619	19.915			
NIW je Anteil	NOK 116,62	NOK 115,06	NOK 108,13			
Institutional RMB (Hedged):						
ausschüttend	CNH 175.729	CNH 75	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.764	1	k. A.			
NIW je Anteil	CNH 99,60	CNH 101,93	k. A.			
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD 162.218	SGD 99.211	SGD 57.007			
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.780	9.134	5.614			
NIW je Anteil	SGD 10,98	SGD 10,86	SGD 10,15			
ausschüttend	SGD 543.239	SGD 411.788	SGD 233.054			
ausgegebene und umlaufende Anteile	58.128	43.143	24.522			
NIW je Anteil	SGD 9,35	SGD 9,54	SGD 9,50			
Investor:						
thesaurierend	\$ 2.212.721	\$ 2.002.496	\$ 1.938.128			
ausgegebene und umlaufende Anteile	156.489	144.086	150.961			
NIW je Anteil	\$ 14,14	\$ 13,90	\$ 12,84			
ausschüttend	\$ 1.415.606	\$ 1.450.049	\$ 1.424.611			
ausgegebene und umlaufende Anteile	151.600	153.164	152.992			
NIW je Anteil	\$ 9,34	\$ 9,47	\$ 9,31			
Investor AUD (Hedged):						
ausschüttend	AUD 70.793	AUD 84.018	AUD 64.155			
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.367	9.724	7.404			
NIW je Anteil	AUD 8,46	AUD 8,64	AUD 8,66			
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 236.231	€ 226.229	€ 212.831			
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.475	19.795	19.702			
NIW je Anteil	€ 11,54	€ 11,43	€ 10,80			
ausschüttend	€ 91.818	€ 86.099	€ 75.705			
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.218	11.198	9.766			
NIW je Anteil	€ 7,52	€ 7,69	€ 7,75			
Investor GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 236.231	£ 226.229	£ 212.831			
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.475	19.795	19.702			
NIW je Anteil	£ 11,54	£ 11,43	£ 10,80			
ausschüttend	£ 91.818	£ 86.099	£ 75.705			
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.218	11.198	9.766			
NIW je Anteil	£ 7,52	£ 7,69	£ 7,75			
Investor HKD (Unhedged):						
thesaurierend	HKD 4.405.250	HKD 4.564.281	HKD 3.221.408			
ausgegebene und umlaufende Anteile	498.329	508.704	364.591			
NIW je Anteil	HKD 8,84	HKD 8,97	HKD 8,84			
Investor JPY (Hedged):						
thesaurierend	¥ 153.406	¥ 1.376	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	152	1	k. A.			
NIW je Anteil	¥ 1.010,00	¥ 1.021,00	k. A.			
Investor RMB (Hedged):						
thesaurierend	CNH 104.770	CNH 105.901	CNH 66.886			
ausgegebene und umlaufende Anteile	856	871	579			
NIW je Anteil	CNH 122,36	CNH 121,55	CNH 115,46			
Investor SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD 18.893	SGD 17.361	SGD 6.150			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.786	1.656	625			
NIW je Anteil	SGD 10,58	SGD 10,48	SGD 9,84			
ausschüttend	SGD 92.507	SGD 69.437	SGD 47.450			
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.648	7.811	5.340			
NIW je Anteil	SGD 8,69	SGD 8,89	SGD 8,89			
Administrative:						
thesaurierend	\$ 1.070.074	\$ 912.884	\$ 744.526			
ausgegebene und umlaufende Anteile	85.610	74.250	65.457			
NIW je Anteil	\$ 12,50	\$ 12,29	\$ 11,37			
ausschüttend	\$ 4.297.414	\$ 3.565.795	\$ 2.930.269			
ausgegebene und umlaufende Anteile	431.868	353.150	294.606			
NIW je Anteil	\$ 9,95	\$ 10,10	\$ 9,95			
Administrative AUD (Hedged):						
ausschüttend	AUD 468.847	AUD 406.120	AUD 286.887			
ausgegebene und umlaufende Anteile	54.142	45.885	32.273			
NIW je Anteil	AUD 8,66	AUD 8,85	AUD 8,89			
Administrative EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 97.388	€ 85.658	€ 96.175			
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.513	7.555	8.961			
NIW je Anteil	€ 11,44	€ 11,34	€ 10,73			
ausschüttend	€ 310.052	€ 305.892	€ 266.419			
ausgegebene und umlaufende Anteile	40.744	39.257	33.865			
NIW je Anteil	€ 7,61	€ 7,79	€ 7,87			
Administrative GBP (Hedged):						
ausschüttend	£ 153.087	£ 142.362	£ 112.506			
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.714	17.119	13.611			
NIW je Anteil	£ 8,18	£ 8,32	£ 8,27			
Administrative HKD (Unhedged):						
ausschüttend	HKD 4.405.250	HKD 4.564.281	HKD 3.221.408			
ausgegebene und umlaufende Anteile	498.329	508.704	364.591			
NIW je Anteil	HKD 8,84	HKD 8,97	HKD 8,84			

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Income Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Administrative			
SGD (Hedged): ausschüttend	SGD 2.673.313	SGD 1.829.067	SGD 971.804
ausgegebene und umlaufende Anteile	279.690	186.853	99.186
NIW je Anteil	SGD 9,56	SGD 9,79	SGD 9,80
Class E:			
thesaurierend	\$ 6.590.381	\$ 5.787.064	\$ 4.837.460
ausgegebene und umlaufende Anteile	417.910	372.334	335.073
NIW je Anteil	\$ 15,77	\$ 15,54	\$ 14,44
ausschüttend	\$ 10.039.636	\$ 8.737.093	\$ 6.857.888
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.065.166	911.535	723.233
NIW je Anteil	\$ 9,43	\$ 9,59	\$ 9,48
Class E AUD (Hedged): ausschüttend	AUD 884.608	AUD 799.635	AUD 595.621
ausgegebene und umlaufende Anteile	109.529	96.656	71.382
NIW je Anteil	AUD 8,08	AUD 8,27	AUD 8,34
Class E CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 63.280	CHF 68.634	CHF 80.590
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.801	6.257	7.568
NIW je Anteil	CHF 10,91	CHF 10,97	CHF 10,65
ausschüttend	CHF 294.593	CHF 237.431	CHF 80.502
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.106	34.173	11.178
NIW je Anteil	CHF 6,68	CHF 6,95	CHF 7,20
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 4.841.634	€ 4.941.016	€ 4.356.288
ausgegebene und umlaufende Anteile	367.858	377.958	350.614
NIW je Anteil	€ 13,16	€ 13,07	€ 12,42
ausschüttend	€ 3.494.492	€ 3.451.544	€ 3.436.223
ausgegebene und umlaufende Anteile	455.583	438.473	430.505
NIW je Anteil	€ 7,67	€ 7,87	€ 7,98
ausschüttend II	€ 194.917	€ 158.809	€ 121.587
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.102	17.751	13.705
NIW je Anteil	€ 8,82	€ 8,95	€ 8,87
Ausschüttend II Q	€ 31.724	€ 32.842	€ 38.028
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.647	3.722	4.345
NIW je Anteil	€ 8,70	€ 8,82	€ 8,75
Class E GBP (Hedged): ausschüttend	£ 245.209	£ 232.770	£ 208.926
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.262	29.126	26.188
NIW je Anteil	£ 7,84	£ 7,99	£ 7,98
Class E HKD (Unhedged): ausschüttend	HKD 4.497.299	HKD 4.105.214	HKD 3.442.414
ausgegebene und umlaufende Anteile	507.036	454.999	385.795
NIW je Anteil	HKD 8,87	HKD 9,02	HKD 8,92
Class E JPY (Hedged): thesaurierend	¥ 34.750.611	¥ 11.142.148	¥ 4.076.871
ausgegebene und umlaufende Anteile	36.149	11.433	4.248
NIW je Anteil	¥ 961,00	¥ 975,00	¥ 960,00
ausschüttend	¥ 145.612.611	¥ 52.326.950	¥ 1.381
ausgegebene und umlaufende Anteile	161.311	55.343	1
NIW je Anteil	¥ 903,00	¥ 946,00	¥ 992,00

	Income Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Class E RMB (Hedged): ausschüttend	CNH 1.108.741	CNH 988.205	CNH 490.076
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.668	9.238	4.497
NIW je Anteil	CNH 103,93	CNH 106,97	CNH 108,97
Class E SGD (Hedged): ausschüttend	SGD 6.142.839	SGD 4.758.628	SGD 2.537.340
ausgegebene und umlaufende Anteile	730.696	551.466	292.512
NIW je Anteil	SGD 8,41	SGD 8,63	SGD 8,67
G Retail EUR (Hedged): ausschüttend	€ 239.431	€ 81.915	€ 18.496
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.864	10.629	2.393
NIW je Anteil	€ 7,76	€ 7,71	€ 7,73
H Institutional: thesaurierend	\$ 1.041.043	\$ 918.636	\$ 669.952
ausgegebene und umlaufende Anteile	85.256	76.610	60.591
NIW je Anteil	\$ 12,21	\$ 11,99	\$ 11,06
ausschüttend	\$ 475.802	\$ 452.440	\$ 287.285
ausgegebene und umlaufende Anteile	51.840	48.671	31.482
NIW je Anteil	\$ 9,18	\$ 9,30	\$ 9,13
Class R: thesaurierend	\$ 100.624	\$ 95.966	\$ 82.073
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.952	8.690	8.054
NIW je Anteil	\$ 11,24	\$ 11,04	\$ 10,19
ausschüttend	\$ 63.429	\$ 62.563	\$ 61.635
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.859	6.676	6.695
NIW je Anteil	\$ 9,25	\$ 9,37	\$ 9,21
Class R EUR (Hedged): ausschüttend	€ 11.490	€ 12.323	€ 12.865
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.441	1.511	1.567
NIW je Anteil	€ 7,97	€ 8,15	€ 8,21
Class R GBP (Hedged): ausschüttend	£ 24.514	£ 25.773	£ 20.954
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.613	2.706	2.220
NIW je Anteil	£ 9,38	£ 9,52	£ 9,44
Class T: thesaurierend	\$ 353.318	\$ 314.165	\$ 295.923
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.457	24.722	24.971
NIW je Anteil	\$ 12,87	\$ 12,71	\$ 11,85
ausschüttend	\$ 122.969	\$ 115.745	\$ 102.600
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.903	13.763	12.279
NIW je Anteil	\$ 8,25	\$ 8,41	\$ 8,36
Class T EUR (Hedged): thesaurierend	€ 248.575	€ 252.546	€ 226.266
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.009	23.488	22.053
NIW je Anteil	€ 10,80	€ 10,75	€ 10,26
ausschüttend	€ 174.953	€ 172.434	€ 165.117
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.913	24.832	23.351
NIW je Anteil	€ 6,75	€ 6,94	€ 7,07
Class Z: thesaurierend	\$ 257.594	\$ 191.273	\$ 219.519
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.837	10.499	13.161
NIW je Anteil	\$ 18,62	\$ 18,22	\$ 16,68

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	Income Fund (Forts.)					
Class Z AUD (Hedged): ausschüttend II	AUD	1.259.832	AUD	1.331.421	AUD	1.339.063
ausgegebene und umlaufende Anteile		129.519		134.703		136.394
NIW je Anteil	AUD	9,73	AUD	9,88	AUD	9,82
Nettovermögen	\$	238.744	\$	125.160	\$	56.623
Institutional:						
thesaurierend	\$	10	\$	24.344	\$	22.431
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		2.396		2.396
NIW je Anteil	\$	10,28	\$	10,16	\$	9,35
ausschüttend	\$	11	\$	11		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	10,13	\$	10,30		k. A.
Class E:						
ausschüttend	\$	79.327	\$	45.250	\$	17.894
ausgegebene und umlaufende Anteile		9.196		5.130		2.069
NIW je Anteil	\$	8,63	\$	8,82	\$	8,65
Class E AUD (Hedged): ausschüttend	AUD	29.200	AUD	13.403	AUD	2.119
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.522		1.571		249
NIW je Anteil	AUD	8,29	AUD	8,53	AUD	8,52
Class E EUR (Hedged): ausschüttend	€	7.334	€	5.479	€	3.221
ausgegebene und umlaufende Anteile		907		658		385
NIW je Anteil	€	8,08	€	8,33	€	8,37
Class E GBP (Hedged): ausschüttend	£	7.879	£	12.067	£	2.810
ausgegebene und umlaufende Anteile		933		1.396		329
NIW je Anteil	£	8,44	£	8,64	£	8,55
Class E HKD (Unhedged): ausschüttend	HKD	472.031	HKD	192.869	HKD	62.867
ausgegebene und umlaufende Anteile		54.375		21.739		7.226
NIW je Anteil	HKD	8,68	HKD	8,87	HKD	8,70
Class E JPY (Hedged): ausschüttend	¥	9.911.308	¥	38.723		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.133		38		k. A.
NIW je Anteil	¥	978,00	¥	1.029,00		k. A.
Nettovermögen	\$	208.353	\$	253.248	\$	403.078
Institutional:						
thesaurierend	\$	94.581	\$	87.830	\$	83.455
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.844		7.446		7.503
NIW je Anteil	\$	12,06	\$	11,80	\$	11,12
Institutional EUR (Partially Hedged): thesaurierend	€	18.646	€	28.298	€	82.243
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.867		2.902		8.718
NIW je Anteil	€	9,99	€	9,75	€	9,43
Institutional GBP (Partially Hedged): thesaurierend	£	2.073	£	3.181	£	3.543
ausgegebene und umlaufende Anteile		169		266		308
NIW je Anteil	£	12,24	£	11,96	£	11,50

	Zum 30. Jun. 2024		Zum 31. Dez. 2023		Zum 31. Dez. 2022	
	Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)					
Administrative: ausschüttend II	\$	1.616	\$	1.963	\$	2.961
ausgegebene und umlaufende Anteile		185		223		338
NIW je Anteil	\$	8,72	\$	8,78	\$	8,75
Administrative SGD (Hedged): ausschüttend II	SGD	4.730	SGD	5.209	SGD	10.723
ausgegebene und umlaufende Anteile		535		585		1.197
NIW je Anteil	SGD	8,84	SGD	8,90	SGD	8,95
Class E: thesaurierend	\$	31.807	\$	44.395	\$	85.842
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.005		4.268		8.673
NIW je Anteil	\$	10,59	\$	10,40	\$	9,90
ausschüttend II	\$	10	\$	10	\$	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	\$	9,30	\$	9,35	\$	9,27
Class E AUD (Partially Hedged): thesaurierend	AUD	352	AUD	346	AUD	334
ausgegebene und umlaufende Anteile		36		36		36
NIW je Anteil	AUD	9,85	AUD	9,67	AUD	9,35
Class E EUR (Partially Hedged): thesaurierend	€	45.224	€	64.630	€	110.990
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.668		6.803		11.966
NIW je Anteil	€	9,69	€	9,50	€	9,28
ausschüttend	€	4.939	€	7.161	€	11.302
ausgegebene und umlaufende Anteile		574		833		1.312
NIW je Anteil	€	8,61	€	8,59	€	8,61
Class E GBP (Partially Hedged): thesaurierend	£	8	£	8	£	8
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	£	9,87	£	9,69	£	9,41
Class E SGD (Partially Hedged): thesaurierend	SGD	14	SGD	14	SGD	13
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	SGD	9,85	SGD	9,67	SGD	9,35
H Institutional: thesaurierend	\$	10	\$	10	\$	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	\$	10,21	\$	10,00	\$	9,45
M Retail: ausschüttend II	\$	216	\$	216	\$	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		23		23		1
NIW je Anteil	\$	9,49	\$	9,47	\$	9,32
Nettovermögen	\$	744.408	\$	809.845	\$	1.072.758
Institutional: thesaurierend	\$	465.139	\$	520.962	\$	640.710
ausgegebene und umlaufende Anteile		27.955		31.818		41.077
NIW je Anteil	\$	16,64	\$	16,37	\$	15,60
ausschüttend	\$	31.014	\$	33.698	\$	53.185
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.091		3.350		5.377
NIW je Anteil	\$	10,04	\$	10,06	\$	9,89

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Low Average Duration Fund (Forts.)</b>			
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 22.214	€ 23.355	€ 37.536
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.205	2.338	3.864
NIW je Anteil	€ 10,08	€ 9,99	€ 9,71
ausschüttend	€ 3.011	€ 3.340	€ 8.986
ausgegebene und umlaufende Anteile	431	474	1.270
NIW je Anteil	€ 6,98	€ 7,05	€ 7,08
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 25.632	£ 17.595	£ 17.044
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.484	1.730	1.748
NIW je Anteil	£ 10,32	£ 10,17	£ 9,75
ausschüttend	£ 10.716	£ 2.381	£ 3.285
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.194	264	367
NIW je Anteil	£ 8,98	£ 9,01	£ 8,95
Investor:			
thesaurierend	\$ 8.674	\$ 10.761	\$ 16.532
ausgegebene und umlaufende Anteile	559	703	1.131
NIW je Anteil	\$ 15,52	\$ 15,30	\$ 14,62
ausschüttend	\$ 1.417	\$ 1.454	\$ 2.022
ausgegebene und umlaufende Anteile	142	146	206
NIW je Anteil	\$ 9,96	\$ 9,98	\$ 9,81
Administrative:			
thesaurierend	\$ 2.251	\$ 8.728	\$ 10.755
ausgegebene und umlaufende Anteile	149	587	755
NIW je Anteil	\$ 15,07	\$ 14,87	\$ 14,24
Class E:			
thesaurierend	\$ 32.990	\$ 37.888	\$ 47.980
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.599	3.020	3.979
NIW je Anteil	\$ 12,69	\$ 12,55	\$ 12,06
ausschüttend	\$ 3.379	\$ 4.074	\$ 5.384
ausgegebene und umlaufende Anteile	327	393	528
NIW je Anteil	\$ 10,35	\$ 10,37	\$ 10,20
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 12.808	€ 15.764	€ 25.480
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.591	1.966	3.238
NIW je Anteil	€ 8,05	€ 8,02	€ 7,87
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 107.921	\$ 113.500	\$ 186.190
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.658	9.245	15.891
NIW je Anteil	\$ 12,46	\$ 12,28	\$ 11,72
ausschüttend	\$ 387	\$ 1.267	\$ 1.521
ausgegebene und umlaufende Anteile	40	131	159
NIW je Anteil	\$ 9,67	\$ 9,69	\$ 9,54
Class R:			
thesaurierend	\$ 4.527	\$ 5.145	\$ 7.183
ausgegebene und umlaufende Anteile	408	470	687
NIW je Anteil	\$ 11,10	\$ 10,94	\$ 10,45
<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 919.041	\$ 972.843	\$ 654.749
Institutional:			
thesaurierend	\$ 252.416	\$ 260.504	\$ 120.881
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.234	21.237	10.562
NIW je Anteil	\$ 12,47	\$ 12,27	\$ 11,44
ausschüttend	\$ 22.602	\$ 17.872	\$ 17.001
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.360	1.864	1.859
NIW je Anteil	\$ 9,58	\$ 9,59	\$ 9,15
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 523.844	€ 547.196	€ 417.993
ausgegebene und umlaufende Anteile	49.602	52.295	41.937
NIW je Anteil	€ 10,56	€ 10,46	€ 9,97

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)</b>			
ausschüttend	€ 8	€ 82	€ 133
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	9	15
NIW je Anteil	€ 9,07	€ 9,15	€ 8,90
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 19.648	£ 16.669	£ 18.388
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.687	1.453	1.708
NIW je Anteil	£ 11,65	£ 11,47	£ 10,77
ausschüttend	£ 309	£ 3.766	£ 3.910
ausgegebene und umlaufende Anteile	34	404	432
NIW je Anteil	£ 9,01	£ 9,33	£ 9,06
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 24.276	NOK 29.300	NOK 159.169
ausgegebene und umlaufende Anteile	226	276	1.581
NIW je Anteil	NOK 107,32	NOK 106,05	NOK 100,63
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 315.886	SEK 313.000	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.017	3.016	k. A.
NIW je Anteil	SEK 104,70	SEK 103,77	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 23.558	€ 27.087	€ 25.901
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.450	2.831	2.816
NIW je Anteil	€ 9,61	€ 9,57	€ 9,20
<b>Low Duration Income Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 2.296.438	\$ 2.030.305	\$ 1.084.380
Institutional:			
thesaurierend	\$ 292.977	\$ 234.711	\$ 186.357
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.095	19.914	17.111
NIW je Anteil	\$ 12,16	\$ 11,79	\$ 10,89
ausschüttend	\$ 412.119	\$ 302.944	\$ 11.734
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.566	30.756	1.229
NIW je Anteil	\$ 9,91	\$ 9,85	\$ 9,56
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 63.306	CHF 61.554	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.017	5.917	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,52	CHF 10,40	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 757.275	€ 715.038	€ 633.070
ausgegebene und umlaufende Anteile	70.320	67.973	63.769
NIW je Anteil	€ 10,77	€ 10,52	€ 9,93
ausschüttend	€ 14	€ 9	€ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	2	1	1
NIW je Anteil	€ 9,20	€ 9,22	€ 9,14
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 219.797	£ 215.265	£ 3.280
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.142	19.315	316
NIW je Anteil	£ 11,48	£ 11,14	£ 10,37
ausschüttend	£ 117.055	£ 117.567	£ 50.073
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.584	12.705	5.539
NIW je Anteil	£ 9,30	£ 9,25	£ 9,04

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Low Duration Income Fund (Forts.)</b>			
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	SGD 17.521	SGD 19.310	SGD 15.840
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.587	1.789	1.566
NIW je Anteil	SGD 11,04	SGD 10,79	SGD 10,12
ausschüttend	SGD 20.063	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.009	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,99	k. A.	k. A.
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend	€ 14.056	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.379	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,19	k. A.	k. A.
Class E: thesaurierend	\$ 88.099	\$ 56.816	\$ 27.537
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.636	5.058	2.629
NIW je Anteil	\$ 11,54	\$ 11,23	\$ 10,47
ausschüttend	\$ 7.943	\$ 7.583	\$ 8.193
ausgegebene und umlaufende Anteile	839	802	885
NIW je Anteil	\$ 9,47	\$ 9,45	\$ 9,25
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 94.564	€ 85.839	€ 31.442
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.265	8.571	3.297
NIW je Anteil	€ 10,21	€ 10,01	€ 9,54
ausschüttend	€ 17.814	€ 9.989	€ 2.708
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.132	1.188	322
NIW je Anteil	€ 8,36	€ 8,41	€ 8,42
H Institutional: thesaurierend	\$ 19.486	\$ 17.331	\$ 62.043
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.731	1.587	6.136
NIW je Anteil	\$ 11,26	\$ 10,92	\$ 10,11
ausschüttend	\$ 4.689	\$ 3.119	\$ 418
ausgegebene und umlaufende Anteile	485	324	45
NIW je Anteil	\$ 9,67	\$ 9,62	\$ 9,34
Class Z EUR (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 10,21
<b>Low Duration Opportunities Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 730.068	\$ 787.624	\$ 1.345.781
Institutional: thesaurierend	\$ 101.716	\$ 93.820	\$ 61.036
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.387	8.007	5.569
NIW je Anteil	\$ 12,13	\$ 11,72	\$ 10,96
ausschüttend	\$ 26.068	\$ 25.780	\$ 33.224
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.601	2.619	3.555
NIW je Anteil	\$ 10,02	\$ 9,84	\$ 9,35
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 9.342	€ 16.441	€ 23.753
ausgegebene und umlaufende Anteile	906	1.637	2.478
NIW je Anteil	€ 10,31	€ 10,04	€ 9,58
ausschüttend	€ 206	€ 219	€ 10.599
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	25	1.244
NIW je Anteil	€ 8,87	€ 8,78	€ 8,52
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 195.426	£ 236.099	£ 713.035
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.333	21.651	69.498
NIW je Anteil	£ 11,27	£ 10,90	£ 10,26
ausschüttend	£ 268.444	£ 268.433	£ 288.970
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.253	28.510	31.985
NIW je Anteil	£ 9,50	£ 9,42	£ 9,03
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 2.350	€ 2.996	€ 4.406
ausgegebene und umlaufende Anteile	242	316	485
NIW je Anteil	€ 9,73	€ 9,49	€ 9,09

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Low Duration Opportunities Fund (Forts.)</b>			
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 2.933	€ 2.828	€ 3.102
ausgegebene und umlaufende Anteile	311	307	350
NIW je Anteil	€ 9,43	€ 9,21	€ 8,86
Class Z: thesaurierend	\$ 10	\$ 10	\$ 1.534
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	166
NIW je Anteil	\$ 10,30	\$ 9,93	\$ 9,24
<b>Low Duration Opportunities ESG Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 5.312	\$ 5.221	\$ 4.928
Institutional: thesaurierend	\$ 4.765	\$ 4.672	\$ 4.426
ausgegebene und umlaufende Anteile	447	447	446
NIW je Anteil	\$ 10,66	\$ 10,45	\$ 9,90
ausschüttend	\$ 11	\$ 10	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 9,98	\$ 10,02	\$ 9,81
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 235	€ 233	€ 225
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	23	23
NIW je Anteil	€ 10,24	€ 10,11	€ 9,78
ausschüttend	€ 9	€ 9	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	€ 9,58	€ 9,69	€ 9,69
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 208	£ 204	£ 194
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	20	20
NIW je Anteil	£ 10,52	£ 10,33	£ 9,85
ausschüttend	£ 8	£ 8	£ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	£ 9,80	£ 9,86	£ 9,75
<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 112.478	\$ 98.493	\$ 120.137
Institutional: thesaurierend	\$ 16.504	\$ 13.881	\$ 21.492
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.197	1.194	2.114
NIW je Anteil	\$ 13,79	\$ 11,62	\$ 10,17
ausschüttend	\$ 9.763	\$ 8.737	\$ 10.469
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.226	1.274	1.678
NIW je Anteil	\$ 7,96	\$ 6,86	\$ 6,24
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 43.962	€ 37.825	€ 41.892
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.860	3.910	4.844
NIW je Anteil	€ 11,39	€ 9,67	€ 8,65
ausschüttend	€ 1.980	€ 1.792	€ 3.309
ausgegebene und umlaufende Anteile	302	315	625
NIW je Anteil	€ 6,55	€ 5,69	€ 5,29
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 1.691	£ 1.418	£ 1.415
ausgegebene und umlaufende Anteile	144	143	162
NIW je Anteil	£ 11,77	£ 9,94	£ 8,76
Class E: ausschüttend	\$ 21.950	\$ 20.293	\$ 23.893
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.081	3.294	4.223
NIW je Anteil	\$ 7,12	\$ 6,16	\$ 5,66
Class Z: thesaurierend	\$ 12.885	\$ 10.013	\$ 14.340
ausgegebene und umlaufende Anteile	727	674	1.113
NIW je Anteil	\$ 17,73	\$ 14,87	\$ 12,88

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Mortgage Opportunities Fund		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Nettovermögen	\$ 1.216.307	\$ 925.256	\$ 849.148
Institutional:			
thesaurierend	\$ 518.877	\$ 418.366	\$ 409.011
ausgegebene und umlaufende Anteile	43.913	36.426	38.104
NIW je Anteil	\$ 11,82	\$ 11,49	\$ 10,73
ausschüttend	\$ 44.568	\$ 36.446	\$ 94.373
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.952	4.056	10.759
NIW je Anteil	\$ 9,00	\$ 8,99	\$ 8,77
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 42.492	CAD 41.430	CAD 23.438
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.206	4.206	2.532
NIW je Anteil	CAD 10,10	CAD 9,85	CAD 9,26
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 1.961	CHF 2.643	CHF 3.010
ausgegebene und umlaufende Anteile	203	275	322
NIW je Anteil	CHF 9,67	CHF 9,59	CHF 9,34
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 327.572	€ 251.283	€ 192.977
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.060	25.105	20.209
NIW je Anteil	€ 10,22	€ 10,01	€ 9,55
ausschüttend	€ 8.698	€ 9.804	€ 14.970
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.119	1.252	1.923
NIW je Anteil	€ 7,77	€ 7,83	€ 7,78
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 4.944	£ 4.831	£ 7.355
ausgegebene und umlaufende Anteile	447	449	727
NIW je Anteil	£ 11,06	£ 10,76	£ 10,12
ausschüttend	£ 13.445	£ 10.837	£ 6.104
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.600	1.289	740
NIW je Anteil	£ 8,40	£ 8,40	£ 8,25
Investor:			
thesaurierend	\$ 21.430	\$ 19.812	\$ 20.219
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.900	1.804	1.963
NIW je Anteil	\$ 11,28	\$ 10,98	\$ 10,30
ausschüttend	\$ 6.037	\$ 5.989	\$ 4.762
ausgegebene und umlaufende Anteile	671	666	543
NIW je Anteil	\$ 9,00	\$ 8,99	\$ 8,77
Administrative:			
ausschüttend	k. A.	k. A.	\$ 44
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	5
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 8,77
Class E:			
thesaurierend	\$ 68.710	\$ 59.228	\$ 43.823
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.213	5.485	4.304
NIW je Anteil	\$ 11,06	\$ 10,80	\$ 10,18
ausschüttend	\$ 15.073	\$ 11.408	\$ 4.351
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.678	1.271	496
NIW je Anteil	\$ 8,99	\$ 8,97	\$ 8,77

	Mortgage Opportunities Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Class E CHF (Hedged):			
ausschüttend	k. A.	k. A.	CHF 166
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	22
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CHF 7,55
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 13.088	€ 10.172	€ 12.803
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.370	1.082	1.415
NIW je Anteil	€ 9,56	€ 9,40	€ 9,05
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 88.451	\$ 3.119	\$ 39
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.150	295	4
NIW je Anteil	\$ 10,85	\$ 10,56	\$ 9,88
ausschüttend	\$ 937	\$ 935	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	91	91	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,33	\$ 10,32	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	\$ 21.319	\$ 15.772	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.960	1.497	1
NIW je Anteil	\$ 10,88	\$ 10,54	\$ 9,78
Nettovermögen	\$ 3.640.531	\$ 1.962.988	\$ 1.008.739
Institutional:			
thesaurierend	\$ 2.902.217	\$ 1.336.603	\$ 581.668
ausgegebene und umlaufende Anteile	42.537	22.608	12.422
NIW je Anteil	\$ 68,23	\$ 59,12	\$ 46,83
ausschüttend	\$ 39.235	\$ 33.385	\$ 24.829
ausgegebene und umlaufende Anteile	844	811	734
NIW je Anteil	\$ 46,49	\$ 41,15	\$ 33,81
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 154.357	€ 135.929	€ 131.649
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.115	4.150	4.953
NIW je Anteil	€ 37,51	€ 32,75	€ 26,58
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,52	k. A.	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	£ 3.922
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	456
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 8,60
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	SGD 335
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	38
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SGD 8,76
Investor:			
thesaurierend	\$ 28.510	\$ 26.850	\$ 19.778
ausgegebene und umlaufende Anteile	456	494	458
NIW je Anteil	\$ 62,57	\$ 54,31	\$ 43,17
BE Retail:			
thesaurierend	\$ 21.439	\$ 6.299	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.738	588	1
NIW je Anteil	\$ 12,33	\$ 10,72	\$ 8,66
Class E:			
thesaurierend	\$ 247.143	\$ 214.093	\$ 165.517
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.246	4.225	4.087
NIW je Anteil	\$ 58,21	\$ 50,67	\$ 40,50
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 56.995	€ 101.366	€ 35.366
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.047	6.177	2.632
NIW je Anteil	€ 18,71	€ 16,41	€ 13,44

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>StocksPLUS™ Fund (Forts.)</b>			
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 175.460	\$ 83.630	\$ 33.724
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.321	5.672	2.884
NIW je Anteil	\$ 17,00	\$ 14,74	\$ 11,69
<b>PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 12.123	\$ 11.175	\$ 9.528
Institutional:			
thesaurierend	\$ 12.123	\$ 11.175	\$ 9.327
ausgegebene und umlaufende Anteile	587	625	663
NIW je Anteil	\$ 20,64	\$ 17,89	\$ 14,07
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	£ 167
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	19
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 8,59
<b>Strategic Income Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 452.874	\$ 449.949	\$ 506.557
Institutional:			
thesaurierend	\$ 22.152	\$ 20.423	\$ 21.761
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.734	1.656	1.939
NIW je Anteil	\$ 12,78	\$ 12,33	\$ 11,22
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 144.721	€ 143.972	€ 168.023
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.170	10.480	13.134
NIW je Anteil	€ 14,23	€ 13,74	€ 12,79
Institutional GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 228	£ 219	£ 201
ausgegebene und umlaufende Anteile	22	22	21
NIW je Anteil	£ 10,16	£ 10,01	£ 9,67
Class E:			
thesaurierend	\$ 40.556	\$ 33.466	\$ 37.001
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.718	2.314	2.786
NIW je Anteil	\$ 14,92	\$ 14,46	\$ 13,28
ausschüttend II	\$ 25.135	\$ 17.325	\$ 18.150
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.659	1.838	1.989
NIW je Anteil	\$ 9,45	\$ 9,42	\$ 9,13
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 108.120	€ 111.233	€ 133.817
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.369	8.879	11.367
NIW je Anteil	€ 12,92	€ 12,53	€ 11,77
ausschüttend II	€ 66.008	€ 66.793	€ 76.984
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.098	8.196	9.528
NIW je Anteil	€ 8,15	€ 8,15	€ 8,08
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 13.029	€ 13.470	€ 15.503
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.137	1.209	1.475
NIW je Anteil	€ 11,46	€ 11,14	€ 10,51
ausschüttend	€ 8.447	€ 7.135	€ 8.019
ausgegebene und umlaufende Anteile	925	789	908
NIW je Anteil	€ 9,13	€ 9,05	€ 8,83
<b>Total Return Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 4.126.703	\$ 4.420.051	\$ 4.150.717
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.460.840	\$ 1.615.253	\$ 1.419.973
ausgegebene und umlaufende Anteile	47.394	52.631	49.161
NIW je Anteil	\$ 30,82	\$ 30,69	\$ 28,88
ausschüttend	\$ 136.570	\$ 125.064	\$ 112.085
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.171	8.283	7.634
NIW je Anteil	\$ 14,89	\$ 15,10	\$ 14,68

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Total Return Bond Fund (Forts.)</b>			
Institutional CAD (Hedged):			
ausschüttend	CAD 11.311	CAD 12.612	CAD 13.555
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.321	1.448	1.587
NIW je Anteil	CAD 8,56	CAD 8,71	CAD 8,54
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 6.026	CHF 6.050	CHF 3.138
ausgegebene und umlaufende Anteile	615	608	320
NIW je Anteil	CHF 9,79	CHF 9,96	CHF 9,79
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 354.972	€ 393.477	€ 388.231
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.730	19.584	20.056
NIW je Anteil	€ 20,02	€ 20,09	€ 19,36
ausschüttend	€ 218.144	€ 215.481	€ 212.408
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.937	18.302	18.120
NIW je Anteil	€ 11,52	€ 11,77	€ 11,72
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 6.196	€ 7.459	€ 19.929
ausgegebene und umlaufende Anteile	215	269	736
NIW je Anteil	€ 28,76	€ 27,78	€ 27,06
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 8.671	£ 7.797	£ 3.621
ausgegebene und umlaufende Anteile	670	605	296
NIW je Anteil	£ 12,93	£ 12,89	£ 12,24
ausschüttend	£ 17.480	£ 19.631	£ 29.067
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.127	2.347	3.543
NIW je Anteil	£ 8,22	£ 8,36	£ 8,20
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 7.478	SGD 7.871	SGD 7.941
ausgegebene und umlaufende Anteile	590	618	652
NIW je Anteil	SGD 12,67	SGD 12,73	SGD 12,17
Investor:			
thesaurierend	\$ 337.721	\$ 352.467	\$ 409.533
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.994	12.551	15.440
NIW je Anteil	\$ 28,16	\$ 28,08	\$ 26,52
ausschüttend	\$ 40.730	\$ 50.617	\$ 67.693
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.697	3.305	4.545
NIW je Anteil	\$ 15,10	\$ 15,31	\$ 14,89
Investor CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 1.905	CHF 2.342	CHF 2.893
ausgegebene und umlaufende Anteile	203	246	307
NIW je Anteil	CHF 9,36	CHF 9,53	CHF 9,41
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 17.173	€ 17.085	€ 18.868
ausgegebene und umlaufende Anteile	918	909	1.038
NIW je Anteil	€ 18,70	€ 18,80	€ 18,18
Administrative:			
thesaurierend	\$ 119.807	\$ 128.181	\$ 130.283
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.319	4.630	4.975
NIW je Anteil	\$ 27,74	\$ 27,69	\$ 26,19
ausschüttend	\$ 42.881	\$ 51.477	\$ 4.583
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.445	5.263	482
NIW je Anteil	\$ 9,65	\$ 9,78	\$ 9,51
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.538	€ 2.760	€ 2.966
ausgegebene und umlaufende Anteile	228	246	273
NIW je Anteil	€ 11,13	€ 11,20	€ 10,84
Administrative SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 14	SGD 14	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,83	SGD 10,06	k. A.

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Total Return Bond Fund (Forts.)</b>			
Class E:			
thesaurierend	\$ 381.741	\$ 407.981	\$ 380.803
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.597	15.599	15.332
NIW je Anteil	\$ 26,15	\$ 26,15	\$ 24,84
ausschüttend	\$ 136.511	\$ 139.042	\$ 151.164
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.047	12.101	13.526
NIW je Anteil	\$ 11,33	\$ 11,49	\$ 11,18
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 12.062	CHF 10.506	CHF 9.731
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.465	1.250	1.166
NIW je Anteil	CHF 8,23	CHF 8,40	CHF 8,34
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 385.759	€ 433.274	€ 471.035
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.695	25.285	28.276
NIW je Anteil	€ 17,00	€ 17,14	€ 16,66
ausschüttend	€ 30.750	€ 34.883	€ 40.476
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.003	4.443	5.177
NIW je Anteil	€ 7,68	€ 7,85	€ 7,82
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 489
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	51
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,53
Class E HKD (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	HKD 1.568
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	155
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	HKD 10,15
Class E SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 31.213	SGD 32.839	SGD 30.035
ausgegebene und umlaufende Anteile	838	874	828
NIW je Anteil	SGD 37,26	SGD 37,59	SGD 36,28
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 256.312	\$ 197.186	\$ 115.199
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.604	6.643	4.116
NIW je Anteil	\$ 29,79	\$ 29,68	\$ 27,98
ausschüttend	\$ 10.395	\$ 10.522	\$ 8.589
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.139	1.137	954
NIW je Anteil	\$ 9,13	\$ 9,26	\$ 9,00
M Retail HKD (Unhedged):			
ausschüttend	HKD 78.145	HKD 84.232	HKD 76.242
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.724	9.270	8.622
NIW je Anteil	HKD 8,96	HKD 9,09	HKD 8,84
Class R EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.243	€ 2.254	€ 2.836
ausgegebene und umlaufende Anteile	236	236	308
NIW je Anteil	€ 9,50	€ 9,54	€ 9,22
Class T:			
thesaurierend	\$ 5.338	\$ 5.824	\$ 6.382
ausgegebene und umlaufende Anteile	520	567	652
NIW je Anteil	\$ 10,26	\$ 10,27	\$ 9,79
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 4.588	€ 4.804	€ 4.426
ausgegebene und umlaufende Anteile	529	549	518
NIW je Anteil	€ 8,67	€ 8,76	€ 8,54
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b>			
Nettovermögen	AUD 223.799	\$ 240.346	\$ 435.924
Institutional:			
thesaurierend	\$ 80.478	\$ 92.466	\$ 183.555
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.620	7.501	14.361
NIW je Anteil	\$ 12,16	\$ 12,33	\$ 12,78
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9.985	€ 5.945	€ 121.520
ausgegebene und umlaufende Anteile	952	555	10.765
NIW je Anteil	€ 10,48	€ 10,71	€ 11,29

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)</b>			
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 332	£ 245	£ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	35	26	1
NIW je Anteil	£ 9,37	£ 9,51	£ 9,88
ausschüttend	£ 32.363	£ 46.771	£ 31.132
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.844	5.378	3.333
NIW je Anteil	£ 8,42	£ 8,70	£ 9,34
Investor:			
thesaurierend	\$ 4.629	\$ 4.741	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	519	523	1
NIW je Anteil	\$ 8,92	\$ 9,06	\$ 9,43
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9	€ 9	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	€ 8,67	€ 8,87	€ 9,39
Class E:			
thesaurierend	\$ 12.709	\$ 12.105	\$ 11.079
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.153	1.078	941
NIW je Anteil	\$ 11,02	\$ 11,23	\$ 11,78
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 7.683	€ 12.722	€ 17.465
ausgegebene und umlaufende Anteile	809	1.305	1.680
NIW je Anteil	€ 9,49	€ 9,75	€ 10,40
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.527	\$ 877	\$ 43
ausgegebene und umlaufende Anteile	159	90	4
NIW je Anteil	\$ 9,61	\$ 9,76	\$ 10,13
Class Z:			
thesaurierend	\$ 64.182	\$ 49.591	\$ 55.435
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.910	4.534	4.958
NIW je Anteil	\$ 10,86	\$ 10,94	\$ 11,18
<b>UK Corporate Bond Fund</b>			
Nettovermögen	£ 243.659	£ 361.061	£ 389.173
Institutional:			
thesaurierend	£ 42.484	£ 43.923	£ 46.355
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.140	2.210	2.532
NIW je Anteil	£ 19,85	£ 19,87	£ 18,31
ausschüttend	£ 146.887	£ 245.303	£ 276.939
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.046	27.741	32.956
NIW je Anteil	£ 8,62	£ 8,84	£ 8,40
Class Z:			
thesaurierend	£ 54.288	£ 71.835	£ 65.879
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.824	7.715	7.715
NIW je Anteil	£ 9,32	£ 9,31	£ 8,54
<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>			
Nettovermögen	£ 331.587	£ 324.768	£ 325.020
Institutional:			
thesaurierend	£ 295.546	£ 286.707	£ 283.958
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.168	13.320	14.455
NIW je Anteil	£ 20,86	£ 21,52	£ 19,65
ausschüttend	£ 36.041	£ 38.061	£ 41.062
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.224	3.228	3.656
NIW je Anteil	£ 11,18	£ 11,79	£ 11,23
<b>US High Yield Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 1.747.304	\$ 1.872.887	\$ 1.984.922
Institutional:			
thesaurierend	\$ 628.455	\$ 681.351	\$ 780.024
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.126	16.860	21.785
NIW je Anteil	\$ 41,55	\$ 40,41	\$ 35,80

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>US High Yield Bond Fund (Forts.)</b>			
ausschüttend	\$ 184.971	\$ 215.871	\$ 233.780
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.791	24.177	27.877
NIW je Anteil	\$ 8,90	\$ 8,93	\$ 8,39
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 209.243	€ 219.196	€ 240.268
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.817	7.285	8.811
NIW je Anteil	€ 30,70	€ 30,09	€ 27,27
ausschüttend	€ 21.049	€ 21.347	€ 33.678
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.139	2.144	3.520
NIW je Anteil	€ 9,84	€ 9,96	€ 9,57
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 13.474	£ 30.402	£ 40.143
ausgegebene und umlaufende Anteile	558	1.294	1.913
NIW je Anteil	£ 24,13	£ 23,49	£ 20,99
ausschüttend	£ 2.419	£ 2.283	£ 1.108
ausgegebene und umlaufende Anteile	287	269	138
NIW je Anteil	£ 8,44	£ 8,48	£ 8,04
Investor: thesaurierend	\$ 224.258	\$ 240.439	\$ 236.934
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.078	6.689	7.413
NIW je Anteil	\$ 36,90	\$ 35,95	\$ 31,96
ausschüttend	\$ 11.514	\$ 17.026	\$ 20.862
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.600	2.356	3.073
NIW je Anteil	\$ 7,20	\$ 7,23	\$ 6,79
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 2.098	€ 2.811	€ 2.708
ausgegebene und umlaufende Anteile	76	104	110
NIW je Anteil	€ 27,54	€ 27,04	€ 24,59
Class E: thesaurierend	\$ 129.008	\$ 130.888	\$ 132.559
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.657	3.797	4.302
NIW je Anteil	\$ 35,28	\$ 34,47	\$ 30,82
ausschüttend	\$ 53.742	\$ 68.093	\$ 58.679
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.662	7.147	6.557
NIW je Anteil	\$ 9,49	\$ 9,53	\$ 8,95
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 47.347	€ 50.468	€ 56.406
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.819	1.969	2.407
NIW je Anteil	€ 26,03	€ 25,63	€ 23,44
H Institutional: thesaurierend	\$ 152.932	\$ 114.190	\$ 88.253
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.815	2.926	2.548
NIW je Anteil	\$ 40,09	\$ 39,02	\$ 34,63
ausschüttend	\$ 7.630	\$ 5.515	\$ 2.482
ausgegebene und umlaufende Anteile	867	625	299
NIW je Anteil	\$ 8,80	\$ 8,83	\$ 8,29
M Retail: ausschüttend	\$ 16.656	\$ 16.293	\$ 12.265
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.731	1.687	1.351
NIW je Anteil	\$ 9,62	\$ 9,66	\$ 9,08
Class R: thesaurierend	\$ 3.945	\$ 4.113	\$ 5.477
ausgegebene und umlaufende Anteile	241	258	387
NIW je Anteil	\$ 16,38	\$ 15,95	\$ 14,17
Class Z: thesaurierend	\$ 14.295	\$ 12.870	\$ 8.528
ausgegebene und umlaufende Anteile	947	879	661
NIW je Anteil	\$ 15,10	\$ 14,65	\$ 12,91

	Zum 30. Jun. 2024	Zum 31. Dez. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 493.888	\$ 480.861	\$ 388.522
Institutional: thesaurierend	\$ 191.385	\$ 232.236	\$ 151.061
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.594	20.229	14.307
NIW je Anteil	\$ 11,53	\$ 11,48	\$ 10,56
ausschüttend	\$ 54.211	\$ 66.032	\$ 61.577
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.178	7.392	7.201
NIW je Anteil	\$ 8,78	\$ 8,93	\$ 8,55
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 129.074	€ 80.273	€ 124.155
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.211	8.188	13.447
NIW je Anteil	€ 9,77	€ 9,80	€ 9,23
Institutional GBP (Hedged): ausschüttend II	£ 27.467	£ 27.296	£ 13.692
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.576	3.477	1.794
NIW je Anteil	£ 7,68	£ 7,85	£ 7,63
Class E: thesaurierend	\$ 63.213	\$ 49.311	\$ 21.852
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.721	5.243	2.504
NIW je Anteil	\$ 9,40	\$ 9,40	\$ 8,73
ausschüttend	\$ 8.646	\$ 7.652	\$ 5.002
ausgegebene und umlaufende Anteile	971	844	576
NIW je Anteil	\$ 8,91	\$ 9,07	\$ 8,68
H Institutional: thesaurierend	\$ 3.376	\$ 2.160	\$ 55
ausgegebene und umlaufende Anteile	319	204	6
NIW je Anteil	\$ 10,60	\$ 10,56	\$ 9,73
<b>US Short-Term Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 1.996.219	\$ 1.854.206	\$ 2.310.115
Institutional: thesaurierend	\$ 677.291	\$ 573.993	\$ 865.421
ausgegebene und umlaufende Anteile	54.574	47.741	76.197
NIW je Anteil	\$ 12,41	\$ 12,02	\$ 11,36
ausschüttend	\$ 122.827	\$ 123.753	\$ 131.027
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.123	12.302	13.207
NIW je Anteil	\$ 10,13	\$ 10,06	\$ 9,92
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 56.850	€ 68.515	€ 202.833
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.392	6.659	20.470
NIW je Anteil	€ 10,54	€ 10,29	€ 9,91
Institutional GBP (Hedged): ausschüttend	£ 219	£ 207	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	22	21	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,13	£ 10,07	k. A.
Investor: thesaurierend	\$ 7.911	\$ 7.368	\$ 12.829
ausgegebene und umlaufende Anteile	660	633	1.164
NIW je Anteil	\$ 11,99	\$ 11,63	\$ 11,02
Class E: thesaurierend	\$ 444.782	\$ 412.185	\$ 412.347
ausgegebene und umlaufende Anteile	37.260	35.571	37.521
NIW je Anteil	\$ 11,94	\$ 11,59	\$ 10,99
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 18.570	€ 18.008	€ 44.471
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.839	1.824	4.656
NIW je Anteil	€ 10,10	€ 9,88	€ 9,55
H Institutional: thesaurierend	\$ 17.720	\$ 18.000	\$ 22.367
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.560	1.634	2.147
NIW je Anteil	\$ 11,36	\$ 11,01	\$ 10,42

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Class Z:	Zum	Zum	Zum
	30. Jun. 2024	31. Dez. 2023	31. Dez. 2022
	<b>US Short-Term Fund (Forts.)</b>		
ausschüttend	\$ 644.580	\$ 623.066	\$ 602.189
ausgegebene und umlaufende Anteile	63.271	61.599	60.375
NIW je Anteil	\$ 10,19	\$ 10,11	\$ 9,97

### 17. VERGÜTUNG

Die Verwaltungsgesellschaft wendet eine Vergütungspolitik an, die den geltenden OGAW-Vorschriften entspricht und im Prospekt zusammengefasst ist.

Weitere Einzelheiten zur Vergütung der Gesellschaft sowie entsprechende finanzielle Angaben werden im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 dargelegt.

### 18. RECHTSSTREITIGKEITEN UND AUFSICHTSRECHTLICHE ANGELEGENHEITEN

Die Gesellschaft ist nicht als Beklagte an wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsgerichtsverfahren beteiligt und ihr sind etwaige solche gegen sie bestehenden oder drohenden wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schadensersatzforderungen nicht bekannt.

Die vorstehenden Ausführungen beziehen sich nur auf den Stand vom 30. Juni 2024.

### 19. KREDITFAZILITÄT

PIMCO Funds: Global Investors Series plc hat am 18. August 2023 im Auftrag der Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, Global High Yield Bond Fund und US High Yield Bond Fund (zusammen die „Fonds“, jeder für sich ein „Fonds“) eine vierte geänderte und neu gefasste Kreditfazilität (die „Kreditvereinbarung“) u. a. zwischen den Fonds, bestimmten Kreditgebern, zu denen auch die MUFG Bank Ltd. („MUFG“) (als Kreditgeber) zählt, und MUFG (als Verwahrstelle und Konsortialführerin) abgeschlossen.

Jeder Fonds darf die Fazilität für vorübergehende Zwecke gemäß der Anlagepolitik des jeweiligen Fonds nutzen.

Der Gesamtbetrag, der für eine Nutzung durch die Fonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung auf 240.000.000 USD. Die Sublimits für die Fonds sind: Global High Yield Bond Fund - 95.000.000 USD; US High Yield Bond Fund - 60.000.000 USD und PIMCO Asia High Yield Bond Fund - 85.000.000 USD. Der Gesamtbetrag, der den Fonds zusammen mit den anderen Kreditnehmern (zusammen die „Kreditnehmer“) zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung auf 268.000.000 USD (der „zugesagte Gesamtbetrag“). Die Kreditnehmer können vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung eine Erhöhung um bis zu 332.000.000 USD (bis zu einer maximalen Erhöhung der Zusage von 600.000.000 USD) auf den zugesagten Gesamtbetrag beantragen. Dieser erhöhte zugesagte Betrag würde den Kreditnehmern zur Inanspruchnahme gemäß den Bedingungen der Kreditvereinbarung zur Verfügung stehen.

Die Kreditvereinbarung sieht zwei verschiedene Zinssätze vor. Bei der Inanspruchnahme eines Kredits entscheidet jeder Fonds selbst, welcher Zinssatz für das gesamte oder einen Teil des jeweiligen Darlehen gilt. Hierbei wird der geltende Zinssatz durch Bezugnahme auf (i) den Alternate Base Rate oder (ii) den Adjusted Daily Simple SOFR bestimmt.

Der Alternate Base Rate gilt für jeden Tag, je nachdem, welcher Wert höher ist: (i) Federal Funds Rate (wie in der Kreditvereinbarung festgelegt) oder (ii) der Overnight Bank Funding Rate (wie in der Kreditvereinbarung festgelegt), wie an diesem Datum gültig. Für jeden unter Bezugnahme auf den Alternate Base Rate berechneten Kreditnennbetrag werden Zinsen auf den ausstehenden Kapitalbetrag erhoben, und zwar für den Zeitraum vom Tag der Gewährung des Kredits bis u. a. zu dem Datum, an dem der Kredit vollständig zu einem bestimmten Zinssatz zurückgezahlt wird, und zwar in Höhe des Alternate Base Rate zzgl. der geltenden Marge (1,125 %).

Der Adjusted Daily Simple SOFR ist ein Zinssatz pro Jahr, der dem (a) Daily Simple SOFR (wie in der Kreditvereinbarung festgelegt) zzgl. (b) 0,10 % entspricht. Für jeden unter Bezugnahme auf den Adjusted Daily Simple SOFR berechneten Kreditnennbetrag werden Zinsen auf den ausstehenden Kapitalbetrag erhoben, und zwar für den Zeitraum vom Tag der Gewährung oder der Fortführung des Kredits bis einschließlich zu dem Datum, an dem der Kredit vollständig zu einem bestimmten Zinssatz zurückgezahlt wird, und zwar in Höhe des Adjusted Daily Simple SOFR zuzüglich der geltenden Marge (1,125 %).

Jeder Kredit ist vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung 60 Tage nach Inanspruchnahme oder am 16. August 2024 zurückzuzahlen, je nachdem, was früher eintritt, sofern er gemäß den Bedingungen der Kreditvereinbarung nicht früher zurückzuzahlen ist.

Sämtliche Kredite werden auf unbesicherter Basis gewährt, und der Rückgriff der Kreditgeber gegenüber einem Fonds ist auf die Vermögenswerte des betreffenden Fonds beschränkt.

Zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 hatte keiner der Fonds im Rahmen der Kreditvereinbarung Kredite in Anspruch genommen.

### 20. VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN

Die Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Securities Financing Transactions Regulation, „SFT“) führt Melde- und Offenlegungspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, „SFT“) und Total Return Swaps ein. SFTs sind gemäß Artikel 3(11) der SFTR folgendermaßen konkret definiert:

- Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Ver- oder Entleihe von Wertpapieren oder Rohstoffen
- Buy-Sellback- oder Sale-Buyback-Geschäfte oder
- Lombardgeschäfte

#### (a) Globale Daten und Konzentration von SFT-Kontrahenten

Zum 30. Juni 2024 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 30. Juni 2024 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	30. Jun. 2024	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (13.347)	(0,53)
BRC	(4.094)	(0,17)
MYI	(1.952)	(0,08)
<b>Summe</b>	<b>(19.393)</b>	<b>(0,78)</b>
<b>Asia Strategic Interest Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 527	0,25
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(516)	(0,24)
<b>PIMCO Balanced Income and Growth Fund</b>		
Total Return Swaps		
MEI	\$ 253	0,02
MYI	1.094	0,12
<b>Summe</b>	<b>1.347</b>	<b>0,14</b>
Pensionsgeschäfte		
DEU	5.000	0,50
FICC	761	0,08
GSC	1.200	0,12
SSB	207	0,02
<b>Summe</b>	<b>7.168</b>	<b>0,72</b>
<b>PIMCO Capital Securities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.324	0,03
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(53.369)	(1,13)
BRC	(10.078)	(0,21)
IND	(31.294)	(0,67)
JML	(11.622)	(0,25)

Fonds	30. Jun. 2024	
	Marktwert (000S)	% des Nettvermögens
<b>PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)</b>		
JPS	\$ (38.968)	(0,83)
SCX	(57.487)	(1,22)
WFS	(28.162)	(0,60)
<b>Summe</b>	<b>(230.980)</b>	<b>(4,91)</b>
<b>PIMCO Climate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 6.300	2,13
FICC	594	0,20
<b>Summe</b>	<b>6.894</b>	<b>2,33</b>
<b>Commodity Real Return Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (1.327)	(0,17)
CBK	(2.100)	(0,26)
GST	(1.472)	(0,18)
JPM	(283)	(0,04)
MAC	937	0,12
MEI	(121)	(0,01)
SOG	(524)	(0,07)
<b>Summe</b>	<b>(4.890)</b>	<b>(0,61)</b>
Pensionsgeschäfte		
FICC	333	0,04
SAL	20.000	2,51
<b>Summe</b>	<b>20.333</b>	<b>2,55</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(6.711)	(0,84)
STR	(279.430)	(34,99)
<b>Summe</b>	<b>(286.141)</b>	<b>(35,83)</b>
<b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (71)	(0,06)
Pensionsgeschäfte		
SSB	103	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(2.775)	(2,30)
<b>Diversified Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
CEW	\$ 891.585	11,51
FICC	8.177	0,11
MEI	7.308	0,09
<b>Summe</b>	<b>907.070</b>	<b>11,71</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(18.046)	(0,24)
JML	(11.506)	(0,14)
JPS	(11.832)	(0,15)
MEI	(3.806)	(0,05)
MYI	(10.347)	(0,14)
NOM	(14.696)	(0,19)
SCX	(2.332)	(0,03)
<b>Summe</b>	<b>(72.565)</b>	<b>(0,94)</b>
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 17.500	4,60
FICC	1.050	0,28
<b>Summe</b>	<b>18.550</b>	<b>4,88</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(529)	(0,14)
SCX	(246)	(0,06)
<b>Summe</b>	<b>(775)</b>	<b>(0,20)</b>
<b>Diversified Income ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 402	0,76
<b>Dynamic Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOM	\$ 146.162	4,18
BRC	166.800	4,77

Fonds	30. Jun. 2024	
	Marktwert (000S)	% des Nettvermögens
<b>Dynamic Bond Fund (Forts.)</b>		
CEW	\$ 489.641	13,99
FICC	2.211	0,06
MEI	153.469	4,39
SAL	10.200	0,29
<b>Summe</b>	<b>968.483</b>	<b>27,68</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
MBC	(683)	(0,02)
<b>Dynamic Multi-Asset Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	€ 613	0,02
MYI	418	0,02
<b>Summe</b>	<b>1.031</b>	<b>0,04</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	65.800	2,63
FICC	10.699	0,43
<b>Summe</b>	<b>76.499</b>	<b>3,06</b>
<b>Emerging Local Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
SCX	\$ 0	0,00
Pensionsgeschäfte		
FICC	7.863	0,29
SAL	16.900	0,64
<b>Summe</b>	<b>24.763</b>	<b>0,93</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(57.636)	(2,16)
BRC	(65.780)	(2,46)
MBC	(48.114)	(1,80)
MEI	(41.223)	(1,54)
SCX	(24.378)	(0,91)
<b>Summe</b>	<b>(237.131)</b>	<b>(8,87)</b>
<b>Emerging Local Bond ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
MBC	\$ 4.800	4,23
SSB	644	0,57
<b>Summe</b>	<b>5.444</b>	<b>4,80</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
MEI	(3.414)	(3,01)
<b>Emerging Markets Bond Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (95.090)	(2,29)
BRC	(78.655)	(1,90)
GSC	(8.955)	(0,22)
IND	(21.345)	(0,52)
MYI	(22.137)	(0,52)
NOM	(30.364)	(0,74)
SCX	(53.900)	(1,32)
<b>Summe</b>	<b>(310.446)</b>	<b>(7,51)</b>
<b>Emerging Markets Bond ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 797	0,03
SAL	11.000	0,38
<b>Summe</b>	<b>11.797</b>	<b>0,41</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(13.091)	(0,46)
BRC	(64.154)	(2,22)
GSC	(4.160)	(0,14)
JML	(8.054)	(0,28)
MEI	(8.550)	(0,30)
MYI	(7.721)	(0,27)
NOM	(126.493)	(4,39)
SCX	(91.471)	(3,17)
<b>Summe</b>	<b>(323.694)</b>	<b>(11,23)</b>
<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 540	0,36

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	30. Jun. 2024	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (5.637)	(3,74)
BRC	(1.480)	(0,99)
MEI	(825)	(0,54)
<b>Summe</b>	<b>(7.942)</b>	<b>(5,27)</b>
<b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 3.392	1,06
<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 130	0,75
<b>PIMCO ESG Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 11.400	3,95
FICC	588	0,20
<b>Summe</b>	<b>11.988</b>	<b>4,15</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SCX	(7.983)	(2,77)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(19.027)	(6,59)
<b>Euro Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	€ 2.754	0,18
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(586)	(0,04)
MYI	(1.785)	(0,11)
<b>Summe</b>	<b>(2.371)</b>	<b>(0,15)</b>
<b>Euro Credit Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	€ 361	0,07
<b>Euro Income Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	€ 5.275	0,36
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
COM	(17.835)	(1,21)
JML	(26.521)	(1,80)
MEI	(15.234)	(1,03)
<b>Summe</b>	<b>(59.590)</b>	<b>(4,04)</b>
<b>Euro Long Average Duration Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	€ 838	0,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
COM	(79.548)	(6,87)
SOG	(10.827)	(0,94)
<b>Summe</b>	<b>(90.375)</b>	<b>(7,81)</b>
<b>Euro Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 5.100	2,46
<b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 13.900	4,07
FICC	320	0,09
<b>Summe</b>	<b>14.220</b>	<b>4,16</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
MYI	(2.471)	(0,72)
<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 2.000	0,22
FICC	1.449	0,15
<b>Summe</b>	<b>3.449</b>	<b>0,37</b>
<b>Global Advantage Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 617	0,15

Fonds	30. Jun. 2024	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Global Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
CEW	\$ 467.717	3,06
DEU	106.400	0,69
FICC	4.685	0,03
SAL	3.200	0,02
<b>Summe</b>	<b>582.002</b>	<b>3,80</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(2.435)	(0,01)
MEI	(1.073)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(3.508)</b>	<b>(0,02)</b>
<b>Global Bond ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 142.900	3,67
FICC	1.176	0,03
<b>Summe</b>	<b>144.076</b>	<b>3,70</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(293)	(0,01)
MYI	(488)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(781)</b>	<b>(0,02)</b>
<b>Global Bond Ex-US Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 119	0,01
JPM	(33)	0,00
<b>Summe</b>	<b>86</b>	<b>0,01</b>
Pensionsgeschäfte		
FICC	510	0,06
<b>Global High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 404	0,01
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(422)	(0,01)
BRC	(2.928)	(0,10)
DEU	(2.011)	(0,07)
JML	(6.036)	(0,20)
JPS	(5.647)	(0,19)
MEI	(2.147)	(0,07)
MYI	(9.945)	(0,33)
<b>Summe</b>	<b>(29.136)</b>	<b>(0,97)</b>
<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.689	0,02
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(557)	0,00
BRC	(1.073)	(0,01)
JML	(5.070)	(0,06)
MEI	(1.659)	(0,02)
SCX	(895)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(9.254)</b>	<b>(0,10)</b>
<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 53.000	2,39
FICC	1.087	0,05
<b>Summe</b>	<b>54.087</b>	<b>2,44</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(4.967)	(0,23)
BRC	(293)	(0,01)
JPS	(3.975)	(0,18)
<b>Summe</b>	<b>(9.235)</b>	<b>(0,42)</b>
<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 565	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(22.282)	(2,21)
CIB	(575.363)	(57,08)
<b>Summe</b>	<b>(597.645)</b>	<b>(59,29)</b>

Fonds	30. Jun. 2024	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Global Real Return Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ (5.358)	(0,25)
CIB	(163.026)	(7,53)
MEI	(35.776)	(1,65)
NOM	(374.859)	(17,33)
SCX	(29.643)	(1,37)
STR	(599.991)	(27,73)
<b>Summe</b>	<b>(1.208.653)</b>	<b>(55,86)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BRC	(8.448)	(0,39)
<b>Income Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (54)	0,00
JPM	26	0,00
MYC	(3.274)	0,00
<b>Summe</b>	<b>(3.302)</b>	<b>0,00</b>
Pensionsgeschäfte		
BOM	1.388.534	1,76
CEW	3.135.162	3,98
FICC	8.088	0,01
MEI	1.008.514	1,28
SOG	1.760	0,00
TOR	460.409	0,58
<b>Summe</b>	<b>6.002.467</b>	<b>7,61</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(3.836)	0,00
<b>Income Fund II</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.903	1,22
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(2.517)	(1,05)
<b>Inflation Multi-Asset Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ (1)	0,00
BRC	0	0,00
CBK	(5)	0,00
JPM	37	0,02
MAC	259	0,12
MYI	2	0,00
<b>Summe</b>	<b>292</b>	<b>0,14</b>
Pensionsgeschäfte		
SSB	543	0,26
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(28.036)	(13,46)
<b>Low Average Duration Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.580	0,21
SAL	18.800	2,53
<b>Summe</b>	<b>20.380</b>	<b>2,74</b>
<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 527	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(16.573)	(1,80)
BPS	(3.085)	(0,34)
SOG	(8.036)	(0,87)
<b>Summe</b>	<b>(27.694)</b>	<b>(3,01)</b>
<b>Low Duration Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 16.500	0,72
CEW	87.697	3,82
FICC	1.557	0,07
<b>Summe</b>	<b>105.754</b>	<b>4,61</b>

Fonds	30. Jun. 2024	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Low Duration Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 58.800	8,05
FICC	576	0,08
<b>Summe</b>	<b>59.376</b>	<b>8,13</b>
<b>Low Duration Opportunities ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 911	17,15
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(405)	(7,62)
<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 803	0,71
CBK	81	0,07
FAR	45	0,04
JPM	662	0,59
MYI	680	0,61
<b>Summe</b>	<b>2.271</b>	<b>2,02</b>
Pensionsgeschäfte		
SSB	1.122	1,00
<b>Mortgage Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 13.000	1,07
FICC	1.185	0,10
<b>Summe</b>	<b>14.185</b>	<b>1,17</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(8.328)	(0,68)
<b>StocksPLUS™ Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 1.313	0,04
BPS	(558)	(0,02)
CBK	1.750	0,05
JPM	5.414	0,15
RBC	26.740	0,73
TOR	59	0,00
UAG	555	0,02
<b>Summe</b>	<b>35.273</b>	<b>0,97</b>
Pensionsgeschäfte		
BOS	200.000	5,50
BPS	300.000	8,24
CEW	190.010	5,21
FICC	12.432	0,34
GSC	161.400	4,43
JPS	200.000	5,50
MFK	200.000	5,50
SAL	70.000	1,92
<b>Summe</b>	<b>1.333.842</b>	<b>36,64</b>
<b>PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 22	0,19
BRC	45	0,37
CBK	28	0,23
RBC	214	1,76
<b>Summe</b>	<b>309</b>	<b>2,55</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	2.300	18,97
GSC	1.100	9,07
SSB	132	1,09
<b>Summe</b>	<b>3.532</b>	<b>29,13</b>
<b>Strategic Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 942	0,21
SSB	223	0,05
<b>Summe</b>	<b>1.165</b>	<b>0,26</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(10.894)	(2,40)
SCX	(12.487)	(2,76)
<b>Summe</b>	<b>(23.381)</b>	<b>(5,16)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	30. Jun. 2024	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
<b>Total Return Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 417	0,01
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(9.945)	(0,24)
BRC	(5.151)	(0,12)
JPS	(2.731)	(0,07)
<b>Summe</b>	<b>(17.827)</b>	<b>(0,43)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(7.759)	(0,19)
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b>		
Total Return Swaps		
MEI	\$ (41)	(0,02)
Pensionsgeschäfte		
DEU	18.000	8,04
SSB	533	0,24
<b>Summe</b>	<b>18.533</b>	<b>8,28</b>
<b>UK Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 347	0,14
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(231)	(0,09)
MEI	(6.766)	(2,78)
MYI	(232)	(0,10)
<b>Summe</b>	<b>(7.229)</b>	<b>(2,97)</b>
<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SCX	£ (421)	(0,13)
<b>US High Yield Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
JPM	\$ 410	0,02
Pensionsgeschäfte		
FICC	10.073	0,58
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(1.600)	(0,09)
BPS	(253)	(0,01)
JPS	(5.456)	(0,32)
MYI	(1.279)	(0,07)
<b>Summe</b>	<b>(8.588)</b>	<b>(0,49)</b>
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.068	0,42
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(19.605)	(3,97)
<b>US Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 62.400	3,13
FICC	371	0,01
<b>Summe</b>	<b>62.771</b>	<b>3,14</b>

Zum 31. Dezember 2023 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 31. Dezember 2023 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 3.856	0,16
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(12.951)	(0,53)
<b>Asia Strategic Interest Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 252	0,14
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(505)	(0,28)
<b>PIMCO Balanced Income and Growth Fund</b>		
Total Return Swaps		
CBK	\$ (34)	(0,01)
MEI	28	0,01
MYI	(261)	(0,04)
<b>Summe</b>	<b>(267)</b>	<b>(0,04)</b>
Pensionsgeschäfte		
DEU	9.600	1,43
FICC	2.484	0,37
SSB	520	0,08
<b>Summe</b>	<b>12.604</b>	<b>1,88</b>
<b>PIMCO Capital Securities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 7.572	0,15
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(34.160)	(0,66)
BRC	(5.159)	(0,10)
IND	(29.387)	(0,57)
JPS	(42.901)	(0,84)
MYI	(13.355)	(0,26)
RCE	(2.375)	(0,05)
SCX	(52.323)	(1,02)
WFS	(52.545)	(1,02)
<b>Summe</b>	<b>(232.205)</b>	<b>(4,52)</b>
<b>PIMCO Climate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 5.800	2,21
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(803)	(0,31)
<b>Commodity Real Return Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (394)	(0,05)
CBK	(588)	(0,07)
CIB	(27)	0,00
GST	(866)	(0,10)
JPM	(794)	(0,09)
MAC	(422)	(0,05)
MEI	(33)	(0,01)
SOG	(7)	0,00
<b>Summe</b>	<b>(3.131)</b>	<b>(0,37)</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	40.300	4,69
FICC	42.718	4,98
<b>Summe</b>	<b>83.018</b>	<b>9,67</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BSN	(61.063)	(7,11)
CIB	(293.867)	(34,21)
GRE	(41.128)	(4,79)
<b>Summe</b>	<b>(396.058)</b>	<b>(46,11)</b>
<b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (366)	(0,37)
Pensionsgeschäfte		
SSB	737	0,74
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(2.942)	(2,94)

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Diversified Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BSN	\$ 83.422	1,12
CEW	910.056	12,24
DEU	81.400	1,09
FICC	104.525	1,40
IND	42.068	0,57
<b>Summe</b>	<b>1.221.471</b>	<b>16,42</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(1.261)	(0,02)
BRC	(22.929)	(0,31)
JML	(14.371)	(0,19)
MYI	(11.115)	(0,15)
<b>Summe</b>	<b>(49.676)</b>	<b>(0,67)</b>
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 32.300	7,82
BSN	34.900	8,46
FICC	2.352	0,57
<b>Summe</b>	<b>69.552</b>	<b>16,85</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(529)	(0,13)
<b>Diversified Income ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 3.000	5,21
<b>Dynamic Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 382.440	11,10
BRC	136.900	3,97
DEU	160.000	4,64
FICC	55.076	1,60
<b>Summe</b>	<b>734.416</b>	<b>21,31</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(537)	(0,01)
JML	(192)	(0,01)
MBC	(625)	(0,02)
<b>Summe</b>	<b>(1.354)</b>	<b>(0,04)</b>
<b>Dynamic Multi-Asset Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	€ (347)	(0,01)
BPS	(11)	0,00
JPM	30	0,00
RBC	67	0,00
<b>Summe</b>	<b>(261)</b>	<b>(0,01)</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	256.700	7,86
CEW	70.000	2,15
FICC	32.149	0,99
<b>Summe</b>	<b>358.849</b>	<b>11,00</b>
<b>Emerging Local Bond Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (103.811)	(3,60)
BRC	(154.191)	(5,36)
JML	(6.409)	(0,22)
MBC	(16.938)	(0,59)
<b>Summe</b>	<b>(281.349)</b>	<b>(9,77)</b>
<b>Emerging Local Bond ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 15.600	15,23
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(722)	(0,70)
<b>Emerging Markets Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.599	0,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(122.193)	(3,19)
BRC	(7.473)	(0,19)

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Emerging Markets Bond Fund (Forts.)</b>		
BSN	\$ (180.824)	(4,70)
MYI	(5.169)	(0,13)
NOM	(9.980)	(0,26)
SCX	(77.088)	(2,00)
<b>Summe</b>	<b>(402.727)</b>	<b>(10,47)</b>
<b>Emerging Markets Bond ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
DEU	\$ 3.400	0,13
FICC	3.494	0,13
SAL	6.800	0,25
<b>Summe</b>	<b>13.694</b>	<b>0,51</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(74.306)	(2,76)
BRC	(17.281)	(0,65)
BSN	(15.443)	(0,57)
MYI	(22.112)	(0,81)
SCX	(49.858)	(1,85)
TDM	(35.833)	(1,33)
<b>Summe</b>	<b>(214.833)</b>	<b>(7,97)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BRC	(44.884)	(1,66)
GSC	(11.781)	(0,44)
<b>Summe</b>	<b>(56.665)</b>	<b>(2,10)</b>
<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 993	0,63
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(166)	(0,11)
<b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 6.274	2,22
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(5.271)	(1,86)
<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 158	0,79
<b>PIMCO ESG Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 8.200	3,02
<b>Euro Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 95.300	5,70
FICC	2.281	0,14
<b>Summe</b>	<b>97.581</b>	<b>5,84</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(1.041)	(0,06)
<b>Euro Credit Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 13.700	2,55
FICC	737	0,14
<b>Summe</b>	<b>14.437</b>	<b>2,69</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(1.403)	(0,26)
JML	(6.045)	(1,12)
MBC	(728)	(0,14)
<b>Summe</b>	<b>(8.176)</b>	<b>(1,52)</b>
<b>Euro Income Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 133.900	9,66
FICC	4.075	0,29
<b>Summe</b>	<b>137.975</b>	<b>9,95</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(324)	(0,03)
BRC	(3.765)	(0,27)
JML	(179)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(4.268)</b>	<b>(0,31)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Euro Long Average Duration Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 50.700	5,48
FICC	1.634	0,18
<b>Summe</b>	<b>52.334</b>	<b>5,66</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(10.485)	(1,13)
<b>Euro Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 12.400	6,41
<b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 30.300	8,24
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(601)	(0,17)
MYI	(1.257)	(0,34)
<b>Summe</b>	<b>(1.858)</b>	<b>(0,51)</b>
<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 1.000	0,77
<b>Global Advantage Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 534	0,12
<b>Global Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 76.000	0,58
CEW	159.260	1,22
FICC	93.314	0,71
IND	43.343	0,33
<b>Summe</b>	<b>371.917</b>	<b>2,84</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(328)	0,00
JML	(289)	0,00
<b>Summe</b>	<b>(617)</b>	<b>0,00</b>
<b>Global Bond ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 91.000	2,56
FICC	74.958	2,10
<b>Summe</b>	<b>165.958</b>	<b>4,66</b>
<b>Global Bond Ex-US Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (1.160)	(0,14)
JPM	(368)	(0,05)
MYC	(85)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(1.613)</b>	<b>(0,20)</b>
Pensionsgeschäfte		
FICC	1.005	0,13
<b>Global High Yield Bond Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (3.690)	(0,12)
BRC	(1.985)	(0,07)
BSN	(6.109)	(0,21)
JML	(6.912)	(0,23)
MYI	(1.421)	(0,05)
TDM	(436)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(20.553)</b>	<b>(0,69)</b>
<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
CEW	\$ 151.676	1,41
DEU	22.200	0,21
FICC	3.237	0,03
<b>Summe</b>	<b>177.113</b>	<b>1,65</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(4.457)	(0,04)
BRC	(2.084)	(0,02)
JML	(1.287)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(7.828)</b>	<b>(0,07)</b>

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 1.300	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(2.191)	(0,10)
BPS	(617)	(0,03)
BRC	(30.730)	(1,42)
JML	(1.755)	(0,08)
MBC	(382)	(0,02)
SCX	(72.357)	(3,33)
<b>Summe</b>	<b>(108.032)</b>	<b>(4,98)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(36.861)	(1,70)
<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.889	0,25
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(3.872)	(0,33)
BRC	(9.365)	(0,80)
CIB	(604.777)	(51,38)
<b>Summe</b>	<b>(618.014)</b>	<b>(52,51)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(2.463)	(0,21)
TDM	(22.223)	(1,89)
<b>Summe</b>	<b>(24.686)</b>	<b>(2,10)</b>
<b>Global Real Return Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.878	0,12
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CIB	(193.455)	(8,13)
NOM	(378.792)	(15,91)
SCX	(70.474)	(2,96)
STR	(914.247)	(38,39)
<b>Summe</b>	<b>(1.556.968)</b>	<b>(65,39)</b>
<b>Income Fund</b>		
Total Return Swaps		
MYC	\$ (28)	0,00
Pensionsgeschäfte		
CEW	265.433	0,38
FICC	9.035	0,01
<b>Summe</b>	<b>274.468</b>	<b>0,39</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(495)	0,00
<b>Income Fund II</b>		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
MSC	\$ (3.572)	(2,85)
<b>Inflation Multi-Asset Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 0	0,00
CBK	(32)	(0,01)
JPM	(154)	(0,06)
MAC	(178)	(0,07)
MYI	0	0,00
<b>Summe</b>	<b>(364)</b>	<b>(0,14)</b>
Pensionsgeschäfte		
SSB	364	0,14
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(15.063)	(5,95)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
TDM	(1.229)	(0,49)
<b>Low Average Duration Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 59.744	7,38
JPS	100	0,01
SAL	40.900	5,05
<b>Summe</b>	<b>100.744</b>	<b>12,44</b>

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Low Average Duration Fund (Forts.)</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
STR	\$ (525.595)	(64,90)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
MSC	(44.279)	(5,47)
<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 678	0,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(6.973)	(0,72)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BRC	(4.817)	(0,50)
<b>Low Duration Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 6.700	0,33
BRC	65.000	3,20
CEW	204.763	10,09
FICC	69.021	3,40
<b>Summe</b>	<b>345.484</b>	<b>17,02</b>
<b>Low Duration Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.805	0,36
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(268)	(0,04)
SCX	(14.817)	(1,88)
<b>Summe</b>	<b>(15.085)</b>	<b>(1,92)</b>
<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ (113)	(0,12)
CBK	(13)	(0,01)
FAR	(3)	0,00
JPM	(69)	(0,07)
MYI	(53)	(0,05)
<b>Summe</b>	<b>(251)</b>	<b>(0,25)</b>
Pensionsgeschäfte		
SSB	631	0,64
<b>Mortgage Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 31.900	3,45
FICC	37.068	4,00
<b>Summe</b>	<b>68.968</b>	<b>7,45</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(55.855)	(6,04)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(823)	(0,09)
<b>StocksPLUS™ Fund</b>		
Total Return Swaps		
CBK	\$ (214)	(0,01)
FAR	(1.104)	(0,06)
JPM	(1.272)	(0,06)
RBC	(3.302)	(0,16)
TOR	(8)	0,00
UAG	(69)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(5.969)</b>	<b>(0,30)</b>
Pensionsgeschäfte		
BOS	130.000	6,62
BPS	99.700	5,08
BRC	38.800	1,98
DEU	11.000	0,56
FICC	1.388	0,07
GSC	50.000	2,55
SAL	155.000	7,89
TDM	58.700	2,99
<b>Summe</b>	<b>544.588</b>	<b>27,74</b>

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ (3)	(0,02)
BRC	(5)	(0,05)
CBK	(7)	(0,07)
RBC	(27)	(0,24)
<b>Summe</b>	<b>(42)</b>	<b>(0,38)</b>
Pensionsgeschäfte		
BOS	900	8,05
SSB	195	1,75
<b>Summe</b>	<b>1.095</b>	<b>9,80</b>
<b>Strategic Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 605	0,13
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(29.197)	(6,49)
SCX	(3.928)	(0,87)
<b>Summe</b>	<b>(33.125)</b>	<b>(7,36)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
TDM	(1.037)	(0,23)
<b>Total Return Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 732	0,02
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(1.947)	(0,04)
MBC	(1.299)	(0,03)
<b>Summe</b>	<b>(3.246)</b>	<b>(0,07)</b>
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b>		
Total Return Swaps		
MEI	\$ 506	0,21
Pensionsgeschäfte		
DEU	17.200	7,15
SSB	1.266	0,53
<b>Summe</b>	<b>18.466</b>	<b>7,68</b>
<b>UK Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 255	0,07
SCX	5.200	1,44
<b>Summe</b>	<b>5.455</b>	<b>1,51</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(506)	(0,14)
MEI	(20.086)	(5,56)
<b>Summe</b>	<b>(20.592)</b>	<b>(5,70)</b>
<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SCX	£ 6.500	2,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(168)	(0,05)
CEW	(2.697)	(0,83)
MEI	(1.081)	(0,34)
<b>Summe</b>	<b>(3.946)</b>	<b>(1,22)</b>
<b>US High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 912	0,05
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(6.071)	(0,33)
BPS	(1.042)	(0,05)
MYI	(1.087)	(0,06)
<b>Summe</b>	<b>(8.200)</b>	<b>(0,44)</b>
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 259	0,05
<b>US Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 4.561	0,25

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettvermögens
<b>US Short-Term Fund (Forts.)</b>		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	\$ (32.279)	(1,74)
MSC	(11.615)	(0,63)
<b>Summe</b>	<b>(43.894)</b>	<b>(2,37)</b>

### (b) Sicherheiten

#### (i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2024 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

#### (ii) Konzentrationsdaten:

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2024 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	Zum 30. Jun. 2024	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
Asia Strategic Interest Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 538
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	Ginnie Mae	1.240
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	6.087
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung von Großbritannien	362
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.523
PIMCO Climate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	6.898
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	20.774
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	105
Diversified Income Fund	Regierung von Kanada	7.462
	Province of Alberta	297.263
	Province of British Columbia	311.422
	Province of Ontario	270.493
	Province of Quebec	20.356
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.341
Diversified Income Duration Hedged Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.548
Diversified Income ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	410
Dynamic Bond Fund	Regierung von Kanada	301.621
	Province of Ontario	426.892
	Province of Quebec	67.431
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	182.919
Dynamic Multi-Asset Fund	Societe Nationale SNCF S.A.	€ 66.182
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	10.913
Emerging Local Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 25.282
Emerging Local Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	5.541
Emerging Markets Bond Fund	Regierung von Großbritannien	133
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	656
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	13.542
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	551
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.460
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	133
PIMCO ESG Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	11.985
Euro Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	€ 2.810
Euro Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	368
Euro Income Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	5.381
Euro Long Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	855

Fonds	Zum 30. Jun. 2024	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
Euro Short-Term Fund	Land Niedersachsen	€ 5.199
PIMCO European High Yield Bond Fund	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität	14.159
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	327
	Land Berlin	2.060
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.478
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 629
Global Advantage Fund	Province of Ontario	245.627
	Province of Quebec	227.810
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	114.706
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	146.908
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	520
Global High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	412
Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.723
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	54.038
Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	576
Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.132
Income Fund	Regierung von Kanada	1.125.859
	Canada Housing Trust	252.585
	Lloyds Banking Group PLC	1.816
	Province of British Columbia	27.895
	Province of Ontario	3.894.614
	Province of Quebec	766.037
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.250
Income Fund II	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.961
Inflation Multi-Asset Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	554
Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	21.023
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	538
Low Duration Income Fund	Province of Ontario	59.876
	Province of Quebec	29.383
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.066
Low Duration Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	59.310
Low Duration Opportunities ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	929
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.144
Mortgage Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	14.246
StocksPLUS™ Fund	Ginnie Mae	479.062
	Province of Ontario	73.085
	Province of Quebec	119.439
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	689.850
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Ginnie Mae	1.137
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.480
Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.189
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	425
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.904
UK Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	£ 354
US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 10.275
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.109
US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	64.003

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2023 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	Zum 31. Dez. 2023		Fonds	Zum 31. Dez. 2023	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)		Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 3.933	PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Regierung von Belgien	€ 987
Asia Strategic Interest Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	257	Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 545
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	12.888	Global Bond Fund	Regierung von Kanada	162.360
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	7.724		Regierung von Großbritannien	45.099
PIMCO Climate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	5.930	Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	172.784
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	84.755	Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	169.340
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	752	Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.025
Diversified Income Fund	Regierung von Kanada	1.042.215		Regierung von Kanada	159.576
	Regierung von Großbritannien	43.772	Global Investment Grade Credit ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	25.972
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	189.743	Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.326
Diversified Income Duration Hedged Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	71.060	Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.947
Diversified Income ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.067	Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.936
Dynamic Bond Fund	Freddie Mac	104		Regierung von Kanada	271.720
	Regierung des Vereinigten Königreichs	413.260	Inflation Multi-Asset Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	9.216
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	360.307		Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	371
Dynamic Multi-Asset Fund	Regierung von Belgien	€ 253.574	Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	102.823
	Europäische Union	72.014	Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	692
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	32.792	Low Duration Income Fund	Regierung von Kanada	210.724
Emerging Local Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 15.987		Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	143.518
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.651	Low Duration Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.861
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	13.986	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	644
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.013	Mortgage Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	70.406
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	6.400	StocksPLUS <sup>™</sup> Fund	Freddie Mac	40.217
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	161		Ginnie Mae	135.354
PIMCO ESG Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.383		Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	384.551
Euro Bond Fund	Regierung von Deutschland	€ 99.142	PIMCO StocksPLUS <sup>™</sup> AR Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.120
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.327	Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	617
Euro Credit Fund	Regierung von Belgien	13.533	Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	747
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	752	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.899
Euro Income Bond Fund	Regierung von Deutschland	137.888	UK Corporate Bond Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	£ 5.300
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.156		Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	260
Euro Long Average Duration Fund	Bpifrance SACA	51.761	UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	6.625
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.667	US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 930
Euro Short-Term Fund	Bpifrance SACA	12.736	US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	264
PIMCO European High Yield Bond Fund	Regierung von Belgien	29.918	US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.652

### (iii) Aggregierte Transaktionsdaten:

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2024 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 538	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	140	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	1.240	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	5.100	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	776	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	211	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing	
PIMCO Capital Securities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	\$ 1.351	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	343	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	685	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral		
PIMCO Climate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	362	AA+	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	172	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	6.292	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Commodity Real Return Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.130	k. A.	k. A.	USD	Australien	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	340	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	20.434	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	105	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	Canada Government International Bond	Treasury	7.462	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Großbritannien	CANADA, Bilateral	
		Province of Alberta	Treasury	297.263	AA	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
		Province of British Columbia	Treasury	311.422	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
		Province of Ontario	Treasury	270.493	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
		Province of Quebec	Treasury	20.356	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	8.341	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	29	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
	Diversified Income Duration Hedged Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	17.477	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.071	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Diversified Income ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	410	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Canada Government International Bond	Treasury	145.966	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Kanada	CANADA, Bilateral	
		Canada Government International Bond	Treasury	155.655	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Großbritannien	CANADA, Bilateral	
		Province of Ontario	Treasury	426.892	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
		Province of Quebec	Treasury	67.431	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	108.880	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
	Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	€ 777	k. A.	k. A.	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
			Societe Nationale SNCF S.A.	Unternehmensanleihen	66.182	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
		Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	10.913	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	\$ 8.020	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
			U.S. Treasury Notes	Treasury	17.262	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Local Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	50	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	4.884	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	657	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Emerging Local Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.809	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	635	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	133	AA+	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral	
Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	656	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	813	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	11.335	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	280	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	384	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
U.S. Treasury Bonds	Treasury	1.394	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral			

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 551	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	3.460	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	133	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO ESG Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	11.385	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	600	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	€ 2.810	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	368	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	5.381	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	855	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	638	k. A.	k. A.	USD	Deutschland	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	Land Niedersachsen	Treasury	5.199	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	EUROCLEAR, Bilateral
PIMCO European High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität	Treasury	14.159	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	327	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	Land Berlin	Treasury	2.060	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	EUROCLEAR, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.478	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	\$ 629	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Ontario	Treasury	245.627	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		Province of Quebec	Treasury	227.810	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	36.124	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	4.779	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	73.803	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.200	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	21.838	AA+	3 Monate - 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	123.870	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.210	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	830	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	520	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	412	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	316	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.723	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	52.929	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.109	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	576	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.102	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	419	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	3.132	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing		
Income Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 1.930	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
	Pensionsgeschäfte	Canada Government International Bond	Treasury	576.960	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Kanada	CANADA, Bilateral		
		Canada Government International Bond	Treasury	548.899	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Großbritannien	CANADA, Bilateral		
		Canada Housing Trust	Mortgage Pass Thru	60.080	AAA	3 Monate - 1 Jahr	CAD	Großbritannien	CANADA, Bilateral		
		Canada Housing Trust	Mortgage Pass Thru	192.505	AAA	Mehr als 1 Jahr	CAD	Großbritannien	CANADA, Bilateral		
		Lloyds Banking Group PLC	Unternehmensanleihen	1.816	A	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral		
		Province of British Columbia	Treasury	27.895	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral		
		Province of Ontario	Treasury	1.104.656	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Kanada	CANADA, Bilateral		
		Province of Ontario	Treasury	132.116	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Großbritannien	CANADA, Bilateral		
		Province of Ontario	Treasury	2.657.842	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral		
		Province of Quebec	Treasury	187.410	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Kanada	CANADA, Bilateral		
		Province of Quebec	Treasury	93.388	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Großbritannien	CANADA, Bilateral		
		Province of Quebec	Treasury	485.239	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	8.250	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		Income Fund II	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	2.961	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Inflation Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	310	k. A.	k. A.	USD	Australien	FED, Bilateral
				Barsicherheiten	Zahlungsmittel	70	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	554	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.612	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	19.411	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	538	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Ontario	Treasury	59.876	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral		
		Province of Quebec	Treasury	29.383	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral		
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	16.478	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.588	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
Low Duration Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	58.722	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	588	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
Low Duration Opportunities ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	929	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	520	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral		
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	930	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.144	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	13.037	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
StocksPLUS™ Fund	Swap-Kontrakte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.209	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	32.880	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral		
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.840	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral		
	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	9.280	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	312.226	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral		
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	166.836	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		Province of Ontario	Treasury	73.085	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral		
		Province of Quebec	Treasury	119.439	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral		
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	401.623	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	12.681	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	275.546	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	20	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral		
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	60	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral		
	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	1.137	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.345	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	135	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	\$ 961	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	228	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	425	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	35	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	15.196	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	3.708	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	£ 354	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US High Yield Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 370	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	10.275	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	2.109	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	378	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	63.625	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2023 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing	
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 3.933	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	630	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	257	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	9.824	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	3.064	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	7.724	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
PIMCO Capital Securities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	6.850	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	5.779	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Morgan Stanley Unternehmensanleihen	Unternehmensanleihen	5.707	A-	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	EUROCLEAR, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	1.678	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
PIMCO Climate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	5.930	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Commodity Real Return Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	10	k. A.	k. A.	USD	Australien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.480	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.660	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	41.183	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	43.572	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	935	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	777	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral	
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	752	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	Canada Government International Bond	Treasury	84.905	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Kanada	CANADA, Bilateral	
		Province of Ontario	Treasury	155.333	AA+	3 Monate - 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
		Province of Ontario	Treasury	674.322	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
		Province of Quebec	Treasury	127.655	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral	
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	103	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	189.640	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	43.772	AA+	Mehr als 1 Jahr	GBP	Frankreich	CREST, Bilateral	
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.346	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
	Diversified Income Duration Hedged Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	35.656	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
			U.S. Treasury Notes	Treasury	33.005	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
U.S. Treasury Notes			Treasury	2.399	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Diversified Income ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 3.067	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	104	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	EUROCLEAR, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	54.877	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	164.281	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	139.745	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.404	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	413.260	AA+	Mehr als 1 Jahr	GBP	Frankreich	CREST, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	€ 2.500	k. A.	k. A.	EUR	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	253.574	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
		Europäische Union	Treasury	72.014	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Vereinigte Staaten	EUROCLEAR, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	32.792	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Local Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 690	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.195	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Local Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	15.987	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.651	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	580	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.801	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	537	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.979	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	1.712	AA+	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral
Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	13.986	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	690	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	5.606	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	301	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.013	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	6.400	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	161	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO ESG Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	8.383	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	€ 99.142	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	EUROCLEAR, Bilateral
		Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	2.327	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	13.533	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	752	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Land Brandenburg Landesbank Baden-Württemberg	Treasury	80.782	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	EUROCLEAR, Bilateral
		Land Brandenburg Landesbank Baden-Württemberg	Treasury	57.106	A-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	EUROCLEAR, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	4.156	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	Bpifrance SACA	Unternehmensanleihen	51.761	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.667	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	821	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	Bpifrance SACA	Unternehmensanleihen	12.736	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
PIMCO European High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	29.918	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	987	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	EUROCLEAR, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 545	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Alberta	Treasury	15.562	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		Province of Ontario	Treasury	84.805	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		Province of Quebec	Treasury	61.993	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	77.604	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	95.180	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		United Kingdom							
		Inflation-Linked Gilt	Treasury	45.099	AA+	Mehr als 1 Jahr	GBP	Frankreich	CREST, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	169.340	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.025	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	250	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	316	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Ontario	Treasury	151.161	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		Province of Quebec	Treasury	8.415	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	25.972	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	260	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.326	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.947	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.735	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.936	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.304	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	4.213	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		United Kingdom							
		Inflation-Linked Gilt	Treasury	213	AA+	3 Monate - 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral
		United Kingdom							
		Inflation-Linked Gilt	Treasury	238	AA+	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral
Income Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Ontario	Treasury	147.735	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		Province of Quebec	Treasury	123.985	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	9.216	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Inflation Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	480	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.080	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	371	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	61.041	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	41.782	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	692	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Alberta	Treasury	105.423	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		Province of Ontario	Treasury	54.325	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		Province of Quebec	Treasury	50.976	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Vereinigte Staaten	CANADA, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	66.267	AA+	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	77.251	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.861	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	644	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	32.596	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	37.810	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	1.837	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
StocksPLUS™ Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 58.670	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Pensionsgeschäfte							
	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	82.373	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	52.981	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	40.217	AA+	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	71.637	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	20.093	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
U.S. Treasury Notes	Treasury	292.821	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	30	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	260	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.120	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	617	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	747	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	35	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	690	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	17.608	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.291	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	£ 260	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	5.300	AA+	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	483	AA+	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	United Kingdom Inflation-Linked Gilt	Treasury	6.625	AA+	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	CREST, Bilateral
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	251	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten
US High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 930	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	264	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	4.652	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Der beizulegende Zeitwert der Sicherheiten aus Pensionsgeschäften umfasst aufgelaufene Zinsen.

Rahmenverträge für Termingeschäfte decken eine Kombination aus Buy-Sellback-Geschäften, Sale-Buyback-Geschäften und sonstigen Finanzierungsgeschäften ab, die oben nicht enthalten sind. Der Gesamtbetrag der zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 für alle Sicherheiten, die für gemäß diesen Vereinbarungen abgeschlossene Geschäfte erhalten wurden, ist oben enthalten. Es ist nicht möglich, die Sicherheiten für jedes einzelne Wertpapierfinanzierungsgeschäft separat zu analysieren.

ISDA-Vereinbarungen decken eine Kombination von Swap-Kontrakten ab; der Gesamtbetrag der Sicherheiten für diese Vereinbarungen ist in den obigen Angaben enthalten.

Ein Teil der angegebenen Sicherheiten bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

### (c) Rendite/Kosten

Die nachfolgenden Tabellen liefern detaillierte Angaben zur Rendite und den Kosten jeder Art von SFT und Total Return Swap für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2024 und zum 30. Juni 2023. Die Beträge sind in der Basiswährung der Fonds ausgewiesen.

Fonds	30. Jun. 2024							
	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 112	\$ 0	\$ 0	\$ (393)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	12	0	0	(12)	0	0	0	0
PIMCO Balanced Income and Growth Fund	574	0	0	(98)	0	0	0	(20)
PIMCO Capital Securities Fund	836	0	0	(6.456)	0	0	0	0
PIMCO Climate Bond Fund	168	0	0	(6)	0	0	0	(4)
Commodity Real Return Fund	517	0	0	(7.148)	0	0	0	(897)

### (iv) Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Als Sicherheiten erhaltene Wertpapiere wurden zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 nicht wiederverwendet.

Die zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 erhaltenen Sicherheiten wurden im Depotbanknetz der State Street Bank and Trust gehalten.

### (v) Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Die von den Fonds zum 30. Juni 2024 und zum 31. Dezember 2023 verpfändeten Sicherheiten werden von den Kontrahenten in Konten gehalten, bei denen es sich nicht um getrennte oder Sammelkonten handelt.

## 30. Jun. 2024

Fonds	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	\$ 8	\$ 0	\$ 0	\$ (26)	\$ 0	\$ (4)	\$ 0	\$ (24)
Diversified Income Fund	25.629	0	0	(859)	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	1.013	0	0	(13)	0	0	0	0
Diversified Income ESG Fund	14	0	0	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	22.767	0	0	(17)	0	0	0	(129)
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 4.799	€ 0	€ 0	€ (39)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Emerging Local Bond Fund	\$ 177	\$ 0	\$ 0	\$ (7.156)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Local Bond ESG Fund	187	0	0	(106)	0	0	0	0
Emerging Markets Bond Fund	68	0	0	(7.156)	0	0	0	(520)
Emerging Markets Bond ESG Fund	603	0	0	(6.238)	0	(38)	0	(725)
Emerging Markets Corporate Bond Fund	9	0	0	(97)	0	0	0	0
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	36	0	0	(37)	0	0	0	(105)
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	2	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO ESG Income Fund	75	0	0	(475)	0	0	0	(201)
Euro Bond Fund	€ 1.446	€ 0	€ 0	€ (90)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	151	0	0	(5)	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	1.775	0	0	(144)	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	325	0	0	(245)	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	241	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	425	0	0	(29)	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	92	0	0	(10)	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 13	\$ 0	\$ 0	\$ (89)	\$ 0	\$ (1)	\$ 0	\$ (259)
Global Bond Fund	9.219	0	0	(92)	0	0	0	(43)
Global Bond ESG Fund	1.912	0	0	(184)	419	(35)	0	(486)
Global Bond Ex-US Fund	19	0	0	(88)	0	0	0	(26)
Global High Yield Bond Fund	98	0	0	(389)	0	0	0	(35)
Global Investment Grade Credit Fund	2.003	0	0	(119)	0	0	0	(8)
Global Investment Grade Credit ESG Fund	461	0	0	(1.786)	315	(63)	0	(1.646)
Global Low Duration Real Return Fund	19	0	0	(16.446)	0	0	0	(422)
Global Real Return Fund	27	0	0	(28.385)	0	0	0	(686)
Income Fund	87.589	0	0	(119)	0	0	0	(21)
Income Fund II	288	0	0	(50)	0	(2)	0	(27)
Inflation Multi-Asset Fund	8	0	0	(544)	0	0	0	(98)
Low Average Duration Fund	377	0	0	(1.394)	0	(44)	0	(1.819)
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	30	0	0	(314)	0	0	0	(245)
Low Duration Income Fund	5.160	0	0	0	0	0	0	0
Low Duration Opportunities Fund	827	0	0	(41)	0	0	0	0
Low Duration Opportunities ESG Fund	4	0	0	(2)	0	0	0	(1)
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	11	0	0	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	2.137	0	0	(260)	0	0	0	(38)
StocksPLUS™ Fund	18.889	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	54	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	12	0	0	(445)	0	0	0	(247)
Total Return Bond Fund	41	0	0	(1.318)	0	0	0	(1.299)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	607	0	0	0	0	0	0	0
UK Corporate Bond Fund	£ 51	£ 0	£ 0	£ (384)	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	73	0	0	(83)	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	\$ 115	\$ 0	\$ 14	\$ (170)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (5)
US Investment Grade Corporate Bond Fund	10	0	0	(174)	0	0	0	(96)
US Short-Term Fund	2.250	0	0	0	0	0	0	(29)

## 30. Jun. 2023

Fonds	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 733	\$ 0	\$ 0	\$ (61)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	22	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO Capital Securities Fund	1.818	0	133	(8.854)	0	0	0	0
PIMCO Climate Bond Fund	1.017	0	1	(4)	0	0	0	0
Commodity Real Return Fund	229	0	0	(9.180)	0	(2)	0	(64)

30. Jun. 2023

Fonds	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	\$ 282	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (1)
Diversified Income Fund	30.043	0	0	(330)	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	2.075	0	0	(1)	0	0	0	0
Diversified Income ESG Fund	62	0	0	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	15.666	0	0	0	0	0	0	0
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 2.823	€ 0	€ 0	€ (6)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Emerging Local Bond Fund	\$ 304	\$ 0	\$ 0	\$ (4.900)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Local Bond ESG Fund	0	0	0	(3)	0	0	0	0
Emerging Markets Bond Fund	71	0	0	(2.061)	0	0	0	(170)
Emerging Markets Bond ESG Fund	1.572	0	0	(900)	0	0	0	(6)
Emerging Markets Corporate Bond Fund	39	0	0	(2)	0	0	0	0
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	173	0	0	(14)	0	0	0	0
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	136	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO ESG Income Fund	1.138	0	0	0	0	0	0	0
Euro Bond Fund	€ 1.126	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	364	0	0	(4)	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	1.277	0	0	(15)	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	65	0	0	(13)	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	186	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	125	0	0	(2)	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	42	0	0	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 20	\$ 0	\$ 0	\$ (7)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (1)
Global Bond Fund	14.063	0	0	(10)	0	0	0	(20)
Global Bond ESG Fund	10.397	0	1	(13)	0	0	0	(5)
Global Bond Ex-US Fund	21	0	0	(8)	0	0	0	(3)
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	443	0	0	(28)	0	0	0	(32)
Global High Yield Bond Fund	285	0	35	0	0	0	0	(6)
Global Investment Grade Credit Fund	11.884	(89)	0	(16)	0	0	0	0
Global Investment Grade Credit ESG Fund	200	0	0	(2.757)	0	0	0	(372)
Global Low Duration Real Return Fund	27	0	0	(8.191)	0	0	0	(303)
Global Real Return Fund	33	0	0	(19.043)	0	0	0	(185)
Income Fund	155.272	0	5	(39)	0	0	0	(89)
Income Fund II	0	(51)	0	0	0	0	0	(20)
Inflation Multi-Asset Fund	409	0	0	0	0	0	0	(5)
Low Average Duration Fund	269	0	13	(2.221)	0	(1)	0	(889)
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	45	0	0	(178)	0	0	0	(264)
Low Duration Income Fund	5.404	0	0	0	0	0	0	0
Low Duration Opportunities Fund	1.654	0	0	(51)	0	0	0	0
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	12	0	0	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	589	0	0	(7.156)	0	0	0	(7)
StocksPLUS™ Fund	10.986	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	60	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	16	0	0	0	0	0	0	0
Total Return Bond Fund	378	0	0	(37)	0	0	0	(8)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	402	0	0	(9)	0	0	0	(17)
UK Corporate Bond Fund	£ 93	£ 0	£ 0	£ (286)	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	19	0	0	(117)	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	\$ 145	\$ 0	\$ 16	\$ (2)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (19)
US Investment Grade Corporate Bond Fund	431	0	0	0	0	0	1	0
US Short-Term Fund	1.618	0	0	(4)	0	0	0	(140)

Alle Renditen aus SFT-Derivatgeschäften laufen zugunsten des Fonds auf und fallen nicht unter Ertragsteuervereinbarungen mit der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft oder sonstigen Dritten.

For Total Return Swaps lassen sich die Transaktionskosten nicht separat identifizieren. Für diese Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und bilden Teil des Bruttoanlageergebnisses jedes Fonds. Renditen werden als realisierte Gewinne und Veränderungen der nicht realisierten Gewinne auf den Swap-Kontrakt während des Berichtszeitraums identifiziert und sind in der Betriebsergebnisrechnung im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten sowie in der Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten enthalten.

## 21. WESENTLICHE EREIGNISSE

Zwischen Russland und der Ukraine herrscht seit Februar 2022 ein anhaltender bewaffneter Konflikt, in dessen Folge Sanktionen gegen verschiedene russische Rechtsträger und Personen verhängt wurden. Seit Oktober 2023 gibt es einen anhaltenden bewaffneten Konflikt in Israel und im Gazastreifen und seit April 2024 kam es im Rahmen einer sich schnell verschärfenden Situation zu militärischen Offensiven zwischen dem Iran und Israel. Die Fonds können in Wertpapiere und Instrumente investieren, die wirtschaftlich an diese Konfliktzonen gebunden sind. Solche Anlagen könnten durch die Sanktionen und Gegensanktionen beeinträchtigt worden sein, einschließlich Wertverlusten und Liquiditätsrückgängen. Die Liquiditätsrückgänge von Anlagen können dazu führen, dass die Fonds Portfoliobestände zu einem ungünstigen Zeitpunkt oder Preis veräußern oder Anlagen weiter halten müssen, die die Fonds möglicherweise nicht mehr halten möchten. PIMCO wird diese Positionen weiterhin aktiv im besten Interesse der Fonds und ihrer Anteilhaber verwalten.

Am 1. Februar 2024 wurde die Gesamtgebühr für die institutionellen Anteilsklassen des Emerging Markets Bond ESG Fund um 7 Basispunkte verringert und die anteilige Senkung wurde auf die anderen relevanten Anteilsklassen des Fonds angewendet.

Am 6. Februar 2024 verstarb zu unserer großen Trauer John Bruton, Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft.

Am 15. Mai 2024 wurden Anteile des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund im Wert von 818.895.875 EUR gezeichnet.

Am 30. Mai 2024 wurde der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund und den Euro Credit Fund um ein Jahr bis zum 1. Juni 2025 bzw. 1. Juli 2025 verlängert.

Am 17. Juni 2024 wurde der Global High Yield Bond ESG Fund aufgelegt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

## **22. EREIGNISSE NACH ABLAUF DES BERICHTSZEITRAUMS**

Nach dem Ende des Berichtszeitraums sind keine wesentlichen Ereignisse eingetreten.

## **23. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN**

Dieser Abschluss wurde am 27. August 2024 vom Verwaltungsrat genehmigt.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	88.378.209	\$ 880.701	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	95.081.683	\$ 947.500
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>IRB Infrastructure Developers Ltd.</b> 7,110 % fällig am 11.03.2032	\$ 28.400	28.376	<b>China Modern Dairy Holdings Ltd.</b> 2,125 % fällig am 14.07.2026	\$ 23.100	21.210
<b>FWD Group Holdings Ltd.</b> 7,635 % fällig am 02.07.2031	22.500	22.500	<b>Hyundai Card Co. Ltd.</b> 5,750 % fällig am 24.04.2029	20.200	19.985
<b>Hyundai Card Co. Ltd.</b> 5,750 % fällig am 24.04.2029	20.200	19.959	<b>Bank of East Asia Ltd.</b> 6,625 % fällig am 13.03.2027	18.250	18.374
<b>FWD Group Holdings Ltd.</b> 8,400 % fällig am 05.04.2029	18.400	18.804	<b>Dah Sing Bank Ltd.</b> 7,375 % fällig am 15.11.2033	17.500	18.265
<b>Shriram Finance Ltd.</b> 6,625 % fällig am 22.04.2027	18.200	18.192	<b>Yunda Holding Investment Ltd.</b> 2,250 % fällig am 19.08.2025	15.600	14.830
<b>Bank of East Asia Ltd.</b> 6,625 % fällig am 13.03.2027	18.250	18.176	<b>Sands China Ltd.</b> 4,050 % fällig am 08.01.2026	15.060	14.494
<b>Muthoot Finance Ltd.</b> 7,125 % fällig am 14.02.2028	17.590	17.604	<b>AAC Technologies Holdings, Inc.</b> 3,000 % fällig am 27.11.2024	14.730	14.481
<b>Diamond Ltd.</b> 7,950 % fällig am 28.07.2026	16.800	16.939	<b>ZhongAn Online P&amp;C Insurance Co. Ltd.</b> 3,125 % fällig am 16.07.2025	14.380	13.868
<b>Adani Green Energy UP Ltd.</b> 6,700 % fällig am 12.03.2042	16.200	16.050	<b>Huarong Finance Co. Ltd.</b> 3,250 % fällig am 13.11.2024	13.900	13.700
<b>Standard Chartered PLC</b> 4,300 % fällig am 19.08.2028	18.600	15.266	<b>TML Holdings Pte. Ltd.</b> 5,500 % fällig am 03.06.2024	13.524	13.509
<b>Vedanta Resources Finance PLC</b> 13,875 % fällig am 21.01.2027	15.177	14.309	<b>Hyundai Capital America</b> 5,950 % fällig am 21.09.2026	13.100	13.300
<b>Singapore Government International Bond</b> 3,250 % fällig am 01.06.2054	SGD 18.328	13.482	<b>Adaro Indonesia PT</b> 4,250 % fällig am 31.10.2024	12.500	12.355
<b>Banco Mercantil del Norte S.A.</b> 6,750 % fällig am 27.09.2024	\$ 13.500	13.433	<b>Diamond Ltd.</b> 7,950 % fällig am 28.07.2026	12.200	12.338
<b>CAS Capital Ltd.</b> 4,000 % fällig am 12.07.2026	15.100	13.191	<b>Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT</b> 5,280 % fällig am 05.04.2029	12.500	12.306
<b>Manappuram Finance Ltd.</b> 7,375 % fällig am 12.05.2028	12.900	12.838	<b>Standard Chartered PLC</b> 6,000 % fällig am 26.07.2025	11.900	11.704
<b>Franshion Brilliant Ltd.</b> 4,250 % fällig am 23.07.2029	18.100	12.573	<b>Freeport Indonesia PT</b> 6,200 % fällig am 14.04.2052	12.400	11.687
<b>Cathaylife Singapore Pte Ltd.</b> 5,950 % fällig am 05.07.2034	12.600	12.564	<b>Royal Capital BV</b> 4,875 % fällig am 05.05.2024	10.571	10.518
<b>Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT</b> 5,280 % fällig am 05.04.2029	12.500	12.500	<b>Sands China Ltd.</b> 4,375 % fällig am 18.06.2030	11.300	10.412
<b>Yinson Boronia Production BV</b> 8,947 % fällig am 31.07.2042	12.400	12.400	<b>Shriram Finance Ltd.</b> 4,400 % fällig am 13.03.2024	10.000	9.985

(a) Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	88.378.209	\$ 880.701	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.977.532	\$ 49.600
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>IRB Infrastructure Developers Ltd.</b> 7,110 % fällig am 11.03.2032	\$ 1.600	1.599	<b>Korea Electric Power Corp.</b> 5,375 % fällig am 06.04.2026	\$ 2.000	2.011
<b>Hyundai Card Co. Ltd.</b> 5,750 % fällig am 24.04.2029	1.600	1.581	<b>Korea Mine Rehabilitation &amp; Mineral Resources Corp.</b> 5,375 % fällig am 11.05.2028	1.450	1.464
<b>Standard Chartered PLC</b> 7,018 % fällig am 08.02.2030	1.500	1.574	<b>POSCO</b> 5,750 % fällig am 17.01.2028	1.400	1.421
<b>FWD Group Holdings Ltd.</b> 8,400 % fällig am 05.04.2029	1.400	1.432	<b>SK Hynix, Inc.</b> 2,375 % fällig am 19.01.2031	1.720	1.411
<b>Muthoot Finance Ltd.</b> 7,125 % fällig am 14.02.2028	1.400	1.404	<b>Northern Star Resources Ltd.</b> 6,125 % fällig am 11.04.2033	1.100	1.096
<b>SoftBank Group Corp.</b> 7,000 % fällig am 08.07.2031	1.400	1.400	<b>Korea Land &amp; Housing Corp.</b> 5,750 % fällig am 06.10.2025	1.000	1.009
<b>Bank of East Asia Ltd.</b> 6,625 % fällig am 13.03.2027	1.350	1.344	<b>KEB Hana Bank</b> 3,250 % fällig am 30.03.2027	1.000	951
<b>FWD Group Holdings Ltd.</b> 7,635 % fällig am 02.07.2031	1.200	1.200	<b>Indian Railway Finance Corp. Ltd.</b> 3,570 % fällig am 21.01.2032	1.100	949
<b>Health &amp; Happiness International Holdings Ltd.</b> 13,500 % fällig am 26.06.2026	1.100	1.146	<b>Dah Sing Bank Ltd.</b> 7,375 % fällig am 15.11.2033	900	937
<b>Weibo Corp.</b> 3,500 % fällig am 05.07.2024	1.138	1.137	<b>BBVA Bancomer S.A.</b> 8,125 % fällig am 08.01.2039	900	918
<b>LG Energy Solution Ltd.</b> 5,375 % fällig am 02.07.2029	1.100	1.100	<b>Indonesia Government International Bond</b> 5,250 % fällig am 17.01.2042	900	897
<b>Cathaylife Singapore Pte Ltd.</b> 5,950 % fällig am 05.07.2034	1.100	1.097	<b>Airport Authority Hong Kong</b> 4,875 % fällig am 12.01.2030	900	889
<b>Bank of East Asia Ltd.</b> 6,750 % fällig am 27.06.2034	1.100	1.096	<b>QNB Finance Ltd.</b> 4,875 % fällig am 30.01.2029	900	879
<b>Adaro Indonesia PT</b> 4,250 % fällig am 31.10.2024	1.100	1.090	<b>CK Hutchison International Ltd.</b> 4,750 % fällig am 21.04.2028	800	796
<b>Saudi Arabia Government International Bond</b> 5,750 % fällig am 16.01.2054	1.100	1.076	<b>Israel Government International Bond</b> 5,375 % fällig am 12.03.2029	700	685
<b>Lendlease U.S. Capital, Inc.</b> 4,500 % fällig am 26.05.2026	1.100	1.064	<b>Freeport Indonesia PT</b> 5,315 % fällig am 14.04.2032	700	664
<b>Singapore Government International Bond</b> 3,250 % fällig am 01.06.2054	SGD 1.428	1.050	<b>Israel Government International Bond</b> 5,750 % fällig am 12.03.2054	700	621
<b>Airport Authority Hong Kong</b> 2,100 % fällig am 08.03.2026	\$ 1.100	1.036	<b>Indonesia Government International Bond</b> 5,450 % fällig am 20.09.2052	600	602
<b>Greenko Dutch BV</b> 3,850 % fällig am 29.03.2026	1.092	1.017	<b>Mongolia Government International Bond</b> 4,450 % fällig am 07.07.2031	700	595

(a) Der Asia Strategic Interest Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.492.600	\$ 144.425	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	10.584.772	\$ 105.480
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.11.2053	\$ 16.721	16.183	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.11.2053	\$ 8.900	9.015
	<b>AKTIEN</b>		Colombian TES 7,750 % fällig am 18.09.2030	COP 25.722.500	6.190
NVIDIA Corp.	36.929	9.994		<b>AKTIEN</b>	
Johnson & Johnson	65.745	9.720	Centene Corp.	64.776	4.807
	<b>PARI (000S)</b>		Booking Holdings, Inc.	1.206	4.413
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	\$ 8.228	7.839	SAP SE	21.262	3.921
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.04.2054	7.206	7.055		<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2054	6.378	6.105	Colombian TES 5,750 % fällig am 03.11.2027	COP 16.619.000	3.918
	<b>AKTIEN</b>			<b>AKTIEN</b>	
Amazon.com, Inc.	33.021	6.030	PayPal Holdings, Inc.	60.614	3.802
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.04.2054	\$ 6.145	5.722	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.09.2052	\$ 4.000	3.720
	<b>AKTIEN</b>			<b>AKTIEN</b>	
GSK PLC	268.195	5.675	Oracle Corp.	25.349	3.666
Target Corp.	36.028	5.508	Vinci S.A.	28.099	3.447
	<b>PARI (000S)</b>		Enel SpA	472.072	3.377
U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.04.2027	\$ 5.500	5.459	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	139.000	3.338
	<b>AKTIEN</b>		Broadcom, Inc.	2.520	3.262
TotalEnergies SE	76.041	5.415	Alibaba Group Holding Ltd.	378.600	3.252
	<b>PARI (000S)</b>		AXA S.A.	90.822	3.232
U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 31.03.2026	\$ 5.400	5.356	Nintendo Co. Ltd.	59.600	3.211
	<b>AKTIEN</b>		UnitedHealth Group, Inc.	6.086	3.127
AbbVie, Inc.	29.857	4.775	Meta Platforms, Inc. 'A'	6.774	3.102
	<b>PARI (000S)</b>		Autodesk, Inc.	12.268	2.999
Great Hall Mortgages PLC 5,813 % fällig am 18.06.2038	£ 3.900	4.739			
	<b>AKTIEN</b>				
Alphabet, Inc. 'A'	27.650	4.658			
Philip Morris International, Inc.	45.462	4.580			
Caterpillar, Inc.	13.256	4.539			
Novartis AG	44.016	4.449			

(a) Der PIMCO Balance Income and Growth Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>ING Groep NV</b> 8,000 % fällig am 16.05.2030	\$	102.900	<b>Stichting AK Rabobank Certificaten</b> 6,500 %	€	66.000
<b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b> 6,600 % fällig am 05.06.2034		71.900	<b>BNP Paribas S.A.</b> 7,750 % fällig am 16.08.2029	\$	48.000
<b>Credit Agricole S.A.</b> 6,500 % fällig am 23.09.2029	€	61.900	<b>ING Groep NV</b> 5,750 % fällig am 16.11.2026		48.700
<b>BNP Paribas S.A.</b> 8,000 % fällig am 22.08.2031	\$	57.100	<b>BNP Paribas S.A.</b> 7,000 % fällig am 16.08.2028		43.300
<b>Barclays PLC</b> 8,500 % fällig am 15.06.2030	£	39.600	<b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b> 6,600 % fällig am 05.06.2034		36.400
<b>CaixaBank S.A.</b> 7,500 % fällig am 16.01.2030	€	41.800	<b>Commerzbank AG</b> 6,500 % fällig am 06.12.2032	€	28.400
<b>NatWest Group PLC</b> 8,125 % fällig am 10.11.2033	\$	36.900	<b>BNP Paribas S.A.</b> 8,500 % fällig am 14.08.2028	\$	27.700
<b>Banco Santander S.A.</b> 9,625 % fällig am 21.05.2033		32.800	<b>Erste Group Bank AG</b> 4,250 % fällig am 15.10.2027	€	29.000
<b>ABN AMRO Bank NV</b> 6,875 % fällig am 22.09.2031	€	30.800	<b>UBS Group AG</b> 4,375 % fällig am 10.02.2031	\$	35.835
<b>Royal Bank of Canada</b> 7,500 % fällig am 02.05.2084	\$	32.600	<b>Permanent TSB Group Holdings PLC</b> 13,250 % fällig am 26.10.2027	€	21.900
<b>Erste Group Bank AG</b> 7,000 % fällig am 15.04.2031	€	28.200	<b>ING Groep NV</b> 7,500 % fällig am 16.05.2028	\$	27.700
<b>DNB Bank ASA</b> 7,375 % fällig am 30.05.2029	\$	30.000	<b>Banco Santander S.A.</b> 4,375 % fällig am 14.01.2026	€	25.600
<b>BPCE S.A.</b> 6,508 % fällig am 18.01.2035		28.200	<b>BPCE S.A.</b> 6,508 % fällig am 18.01.2035	\$	23.800
<b>KBC Group NV</b> 4,750 % fällig am 17.04.2035	€	24.600	<b>Morgan Stanley</b> 5,948 % fällig am 19.01.2038		23.400
<b>AIB Group PLC</b> 7,125 % fällig am 30.10.2029		24.200	<b>Banco Santander S.A.</b> 0,000 % fällig am 21.11.2028		20.200
<b>Barclays PLC</b> 7,125 % fällig am 15.06.2025	£	20.800	<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b> 4,875 % fällig am 08.02.2036	€	18.600
<b>Credit Agricole S.A.</b> 6,251 % fällig am 10.01.2035	\$	25.600	<b>ING Groep NV</b> 4,250 % fällig am 16.05.2031	\$	25.400
<b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b> 6,750 % fällig am 15.06.2054		24.100	<b>Banco Santander S.A.</b> 3,875 % fällig am 22.04.2029	€	17.800
<b>Bank of Nova Scotia</b> 8,000 % fällig am 27.01.2084		24.000	<b>Intesa Sanpaolo SpA</b> 5,875 % fällig am 01.09.2031		18.100
<b>Intesa Sanpaolo SpA</b> 7,700 % fällig am 17.09.2025		24.100	<b>CaixaBank S.A.</b> 3,625 % fällig am 14.09.2028		20.800
<b>Commerzbank AG</b> 7,875 % fällig am 09.10.2031	€	22.200	<b>ING Groep NV</b> 3,875 % fällig am 16.05.2027	\$	21.800
<b>Prudential Financial, Inc.</b> 6,500 % fällig am 15.03.2054	\$	23.200	<b>Banco Santander S.A.</b> 3,625 % fällig am 21.03.2029	€	22.000
<b>UniCredit SpA</b> 5,375 % fällig am 16.04.2034	€	20.500	<b>Barclays PLC</b> 6,125 % fällig am 15.12.2025	\$	18.783
<b>RCI Banque S.A.</b> 5,500 % fällig am 09.10.2034		20.700	<b>NatWest Group PLC</b> 4,600 % fällig am 28.06.2031		21.859
<b>Deutsche Bank AG</b> 8,125 % fällig am 30.10.2029		19.000	<b>Lloyds Banking Group PLC</b> 8,000 % fällig am 27.09.2029		17.600
<b>Banque Federative du Credit Mutuel S.A.</b> 4,375 % fällig am 11.01.2034		18.700	<b>UniCredit SpA</b> 5,459 % fällig am 30.06.2035		17.929
<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b> 4,875 % fällig am 08.02.2036		18.600	<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b> 7,883 % fällig am 15.11.2034		14.400
<b>Banco Santander S.A.</b> 3,875 % fällig am 22.04.2029		17.800	<b>Banco Santander S.A.</b> 4,125 % fällig am 12.11.2027	€	17.200
<b>Barclays PLC</b> 9,625 % fällig am 15.12.2029	\$	16.400	<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b> 6,000 % fällig am 29.03.2024		14.600
<b>Lloyds Banking Group PLC</b> 7,500 % fällig am 27.09.2025		16.500	<b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b> 8,200 % fällig am 15.01.2029	\$	13.300
<b>Groupe des Assurances du Credit Mutuel SADIR</b> 5,000 % fällig am 30.10.2044	€	14.200	<b>Energy Transfer LP</b> 8,000 % fällig am 15.05.2054		12.800
<b>Barclays PLC</b> 6,375 % fällig am 15.12.2025	£	12.000			

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.11.2053	\$	10.912	United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033	£	3.900
United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054	£	5.120	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % fällig am 15.11.2029	€	2.600
Australia Government International Bond 4,250 % fällig am 21.06.2034	AUD	3.300	Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig am 18.09.2030	\$	3.110
Nestle Finance International Ltd. 3,000 % fällig am 23.01.2031	€	1.800	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,375 % fällig am 07.06.2032	€	2.300
Oncor Electric Delivery Co. LLC 3,500 % fällig am 15.05.2031		1.800	ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029	\$	2.400
Volkswagen Financial Services AG 3,875 % fällig am 10.09.2030		1.550	Santander UK Group Holdings PLC 2,896 % fällig am 15.03.2032		2.400
Argenta Spaarbank NV 3,125 % fällig am 06.02.2034		1.400	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028		2.100
Vesteda Finance BV 4,000 % fällig am 07.05.2032		1.400	AIB Group PLC 4,625 % fällig am 23.07.2029	€	1.300
Shinhan Bank Co. Ltd. 3,320 % fällig am 29.01.2027		1.300	POSCO 4,875 % fällig am 23.01.2027	\$	1.400
Sagax AB 4,375 % fällig am 29.05.2030		1.300	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.07.2028		1.200
Smurfit Kappa Treasury ULC 5,438 % fällig am 03.04.2034	\$	1.400	Societe Generale S.A. 0,625 % fällig am 02.12.2027	€	1.200
Lloyds Banking Group PLC 3,875 % fällig am 14.05.2032	€	1.300	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % fällig am 14.01.2029	\$	1.300
Duke Energy Progress LLC 5,100 % fällig am 15.03.2034	\$	1.400	Schneider Electric SE 3,250 % fällig am 10.10.2035	€	1.000
POSCO 4,875 % fällig am 23.01.2027		1.400	Air Products and Chemicals, Inc. 4,750 % fällig am 08.02.2031	\$	1.100
Kommunalbanken A/S 2,875 % fällig am 25.04.2029	€	1.300	NXP BV 2,500 % fällig am 11.05.2031		1.200
Adif Alta Velocidad 3,500 % fällig am 30.04.2032		1.300	Nemak S.A.B. de C.V. 2,250 % fällig am 20.07.2028	€	1.000
Wisconsin Power & Light Co. 5,375 % fällig am 30.03.2034	\$	1.300	Atrium Finance PLC 2,625 % fällig am 05.09.2027		1.100
Verbund AG 3,250 % fällig am 17.05.2031	€	1.100	Korea Housing Finance Corp. 3,124 % fällig am 18.03.2029		800
Bank of Nova Scotia 3,500 % fällig am 17.04.2029		1.100	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,848 % fällig am 19.07.2029		800
JAB Holdings BV 4,375 % fällig am 25.04.2034		1.100	Commerzbank AG 3,375 % fällig am 12.12.2025		700
Air Products and Chemicals, Inc. 4,750 % fällig am 08.02.2031	\$	1.100	E.ON SE 3,375 % fällig am 15.01.2031		700
CPPIB Capital, Inc. 3,125 % fällig am 11.06.2029	€	1.000	UniCredit SpA 5,850 % fällig am 15.11.2027		600
Schneider Electric SE 3,250 % fällig am 10.10.2035		1.000	Korea Water Resources Corp. 3,500 % fällig am 27.04.2025	\$	700
Electricite de France S.A. 4,750 % fällig am 17.06.2044		1.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 3,250 % fällig am 19.05.2033	€	600
ING Groep NV 8,000 % fällig am 16.05.2030	\$	1.000	South Eastern Power Networks PLC 1,750 % fällig am 30.09.2034	£	700
Volkswagen Leasing GmbH 3,875 % fällig am 11.10.2028	€	900	Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. 4,875 % fällig am 25.07.2033	\$	600
E.ON SE 4,125 % fällig am 25.03.2044		900	Enel Finance International NV 7,500 % fällig am 14.10.2032		500
Iceland Government International Bond 3,500 % fällig am 21.03.2034		900	Kommuninvest Sverige AB 3,125 % fällig am 08.12.2027	€	500
ING Groep NV 4,000 % fällig am 12.02.2035		900	Nokia Oyj 4,375 % fällig am 21.08.2031		500
Korea Housing Finance Corp. 3,124 % fällig am 18.03.2029		800	Acciona Energia Financiacion Filiales S.A. 5,125 % fällig am 23.04.2031		400
Aptiv PLC 4,250 % fällig am 11.06.2036		800			
Metalsa S.A. de C.V. 3,750 % fällig am 04.05.2031	\$	1.000			
Owens Corning 5,500 % fällig am 15.06.2027		800			

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 2,375 % fällig am 15.10.2028 (b)	\$ 37.519	\$ 37.931
<b>United Kingdom Gilt</b> 0,125 % fällig am 10.08.2028	£ 15.450	19.373
<b>United Kingdom Gilt</b> 0,125 % fällig am 22.03.2029	13.507	16.835
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.10.2052	\$ 16.998	15.888
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	11.642	10.275
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 4,662 % fällig am 15.10.2028	€ 6.700	7.343
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)	\$ 6.620	6.589
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.09.2052	5.999	5.608
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	5.261	5.087
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 1,800 % fällig am 15.05.2036	€ 4.080	4.420
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	\$ 4.345	4.114
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 2,125 % fällig am 15.02.2054 (b)	2.711	2.660
<b>AKTIEN</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	227	2

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	\$ 58.186	\$ 57.682
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	45.002	43.924
<b>United Kingdom Inflation-Linked Gilt</b> 2,500 % fällig am 17.07.2024	£ 6.400	30.779
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 17.434	17.458
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	16.850	16.413
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.10.2052	16.998	15.818
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	14.750	14.595
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	13.831	12.108
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 0,400 % fällig am 15.05.2030	€ 7.744	7.917
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 7.172	6.826
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.09.2052	5.999	5.583
<b>Octagon Investment Partners Ltd.</b> 6,549 % fällig am 16.04.2031	3.300	3.302
<b>Regatta Funding Ltd.</b> 6,820 % fällig am 17.10.2030	3.260	3.265
<b>OZLM Ltd.</b> 6,729 % fällig am 20.01.2031	2.728	2.730
<b>Realkredit Danmark A/S</b> 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 13.501	1.509
<b>CIFC Funding Ltd.</b> 6,646 % fällig am 27.04.2031	\$ 1.190	1.192
<b>Nordea Kredit Realkreditaktieselskab</b> 0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK 6.349	740
<b>Realkredit Danmark A/S</b> 1,500 % fällig am 01.10.2053	6.644	739
<b>Jyske Realkredit A/S</b> 1,000 % fällig am 01.10.2053	6.270	657
<b>Jyske Realkredit A/S</b> 1,500 % fällig am 01.10.2053	4.897	574

(a) Der Commodity Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.280.833	\$ 42.658	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.283.044	\$ 42.680
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)	\$ 12.847	12.813	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,625 % fällig am 30.04.2029	\$ 6.000	6.034
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,625 % fällig am 30.04.2029	6.000	5.991	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)	3.025	3.026
<b>Boeing Co.</b> 6,298 % fällig am 01.05.2029	1.700	1.700	<b>U.S. Treasury Notes</b> 0,500 % fällig am 31.10.2027	2.800	2.455
<b>Lloyds Banking Group PLC</b> 5,679 % fällig am 05.01.2035	1.200	1.201	<b>South Africa Government International Bond</b> 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 26.800	1.453
<b>AerCap Ireland Capital DAC</b> 3,300 % fällig am 30.01.2032	1.200	1.026	<b>AerCap Ireland Capital DAC</b> 2,875 % fällig am 14.08.2024	\$ 1.150	1.135
<b>Boston Scientific Corp.</b> 2,650 % fällig am 01.06.2030	1.100	959	<b>Netflix, Inc.</b> 4,875 % fällig am 15.04.2028	1.100	1.102
<b>B.C. Unlimited Liability Co.</b> 7,094 % fällig am 20.09.2030	900	898	<b>Boston Scientific Corp.</b> 2,650 % fällig am 01.06.2030	1.100	969
<b>Crown Castle, Inc.</b> 5,600 % fällig am 01.06.2029	800	809	<b>Market Bidco Finco PLC</b> 4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 800	819
<b>Wynn Resorts Finance LLC</b> 7,125 % fällig am 15.02.2031	750	772	<b>Plains All American Pipeline LP</b> 4,500 % fällig am 15.12.2026	\$ 800	785
<b>Live Nation Entertainment, Inc.</b> 3,750 % fällig am 15.01.2028	800	740	<b>United Rentals North America, Inc.</b> 3,875 % fällig am 15.11.2027	800	753
<b>Aircastle Ltd.</b> 6,500 % fällig am 18.07.2028	725	738	<b>Mundys SpA</b> 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 700	692
<b>EQM Midstream Partners LP</b> 4,750 % fällig am 15.01.2031	700	652	<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b> 4,389 % fällig am 08.01.2026	\$ 700	684
<b>Intesa Sanpaolo SpA</b> 7,200 % fällig am 28.11.2033	600	644	<b>VOC Escrow Ltd.</b> 5,000 % fällig am 15.02.2028	700	664
<b>Constellation Energy Generation LLC</b> 6,125 % fällig am 15.01.2034	600	627	<b>Bank of America Corp.</b> 3,824 % fällig am 20.01.2028	675	649
<b>Eversource Energy</b> 5,950 % fällig am 15.07.2034	600	609	<b>EQM Midstream Partners LP</b> 4,750 % fällig am 15.01.2031	700	630
<b>Wrench Group LLC</b> 9,596 % fällig am 30.10.2028	600	599	<b>Amgen, Inc.</b> 5,250 % fällig am 02.03.2030	600	609
<b>Exelon Corp.</b> 5,450 % fällig am 15.03.2034	600	598	<b>Wrench Group LLC</b> 9,596 % fällig am 30.10.2028	600	602
<b>Smith &amp; Nephew PLC</b> 5,400 % fällig am 20.03.2034	600	588	<b>Cheniere Energy, Inc.</b> 4,625 % fällig am 15.10.2028	600	577
<b>CrowdStrike Holdings, Inc.</b> 3,000 % fällig am 15.02.2029	650	582	<b>Warnermedia Holdings, Inc.</b> 4,279 % fällig am 15.03.2032	600	535

(a) Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	58.534.005	\$ 583.293	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	56.989.591	\$ 567.900
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>Rockford Tower Europe CLO DAC</b> 5,220 % fällig am 24.04.2037	€ 44.300	48.010	<b>Volvo Car AB</b> 4,250 % fällig am 31.05.2028	€ 29.500	32.103
<b>Europäische Union</b> 3,000 % fällig am 04.12.2034	41.710	44.678	<b>Altice Financing S.A.</b> 5,750 % fällig am 15.08.2029	\$ 26.500	21.899
<b>Chile Government International Bond</b> 4,850 % fällig am 22.01.2029	\$ 33.000	32.923	<b>G City Europe Ltd.</b> 4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 19.820	20.554
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b> 0,000 % fällig am 25.06.2049	£ 19.000	24.204	<b>Syngenta Finance NV</b> 4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 19.895	19.597
<b>Cumulus Static CLO DAC</b> 5,025 % fällig am 15.11.2033	€ 22.100	23.913	<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b> 4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 17.900	19.367
<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b> 0,000 % fällig am 20.07.2053	£ 18.000	22.384	<b>Globalworth Real Estate Investments Ltd.</b> 3,000 % fällig am 29.03.2025	€ 16.606	16.745
<b>Brazil Government International Bond</b> 7,125 % fällig am 13.05.2054	\$ 21.700	21.595	<b>Organon &amp; Co.</b> 2,875 % fällig am 30.04.2028	14.550	14.553
<b>Iridium Capital PLC</b> 9,250 % fällig am 18.06.2029	€ 19.525	21.031	<b>Albania Government International Bond</b> 3,500 % fällig am 16.06.2027	13.470	14.051
<b>Jubilee Place BV</b> 4,519 % fällig am 17.09.2060	19.400	20.769	<b>Freedom Mortgage Corp.</b> 6,625 % fällig am 15.01.2027	\$ 13.100	12.546
<b>Paraguay Government International Bond</b> 6,000 % fällig am 09.02.2036	\$ 20.500	20.562	<b>Ecuador Government International Bond</b> 6,000 % fällig am 31.07.2030	17.847	11.511
<b>United Kingdom Gilt</b> 4,375 % fällig am 31.07.2054	£ 16.000	20.228	<b>Vmed O2 UK Financing PLC</b> 4,000 % fällig am 31.01.2029	£ 10.000	11.083
<b>CQP Holdco LP</b> 5,500 % fällig am 15.06.2031	\$ 21.350	20.050	<b>Volkswagen Financial Services NV</b> 3,500 % fällig am 17.06.2025	€ 10.100	10.710
<b>Europäische Union</b> 3,375 % fällig am 04.10.2039	€ 18.290	19.381	<b>Petroleos Mexicanos</b> 6,700 % fällig am 16.02.2032	\$ 12.400	10.131
<b>Hungary Government International Bond</b> 4,000 % fällig am 25.07.2029	17.675	18.930	<b>Dominican Republic Government International Bond</b> 6,500 % fällig am 15.02.2048	9.700	9.166
<b>Cotiviti Corp.</b> 8,579 % fällig am 01.05.2031	\$ 17.800	17.711	<b>Altice France Holding S.A.</b> 6,000 % fällig am 15.02.2028	23.300	8.410
<b>Block, Inc.</b> 6,500 % fällig am 15.05.2032	17.100	17.106	<b>Charter Communications Operating LLC</b> 7,052 % fällig am 01.02.2027	8.074	8.079
<b>Duke Energy Indiana LLC</b> 5,250 % fällig am 01.03.2034	15.000	14.995	<b>Market Bidco Finco PLC</b> 4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 7.850	8.046
<b>Jane Street Group</b> 7,125 % fällig am 30.04.2031	13.900	13.910	<b>Level 3 Financing, Inc.</b> 11,904 % fällig am 15.04.2030	\$ 8.200	7.922
<b>Panama Government International Bond</b> 3,875 % fällig am 17.03.2028	15.250	13.779	<b>New Red Finance, Inc.</b> 6,125 % fällig am 15.06.2029	7.900	7.920

(a) Der Diversified Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	1.222.140 \$	12.178	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	1.585.683 \$	15.800
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Bonds</b>			<b>Avolon TLB Borrower U.S. LLC</b>		
4,750 % fällig am 15.11.2043	\$ 3.000	3.167	7,339 % fällig am 22.06.2028	\$ 2.140	2.142
<b>Europäische Union</b>			<b>Organon &amp; Co.</b>		
3,000 % fällig am 04.12.2034	€ 2.100	2.249	2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 1.700	1.706
<b>Rockford Tower Europe CLO DAC</b>			<b>Imperial Brands Finance Netherlands BV</b>		
5,220 % fällig am 24.04.2037	2.000	2.168	1,750 % fällig am 18.03.2033	2.000	1.695
<b>Cumulus Static CLO DAC</b>			<b>Romania Government International Bond</b>		
5,025 % fällig am 15.11.2033	2.000	2.164	5,000 % fällig am 27.09.2026	1.400	1.526
<b>Aurium CLO DAC</b>			<b>HSBC Holdings PLC</b>		
4,630 % fällig am 22.06.2034	2.000	2.153	5,210 % fällig am 11.08.2028	\$ 1.275	1.256
<b>Mexico Government International Bond</b>			<b>Altice Financing S.A.</b>		
6,000 % fällig am 07.05.2036	\$ 1.600	1.587	5,750 % fällig am 15.08.2029	1.500	1.245
<b>United Kingdom Gilt</b>			<b>Altice France S.A.</b>		
4,375 % fällig am 31.07.2054	£ 1.200	1.517	5,500 % fällig am 15.10.2029	1.600	1.167
<b>Mexico Government International Bond</b>			<b>G City Europe Ltd.</b>		
4,000 % fällig am 24.08.2034	MXN 22.698	1.264	4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 1.100	1.141
<b>Barings Euro CLO DAC</b>			<b>Albion Financing SARL</b>		
4,862 % fällig am 25.07.2035	€ 1.000	1.067	9,147 % fällig am 17.08.2026	1.000	1.068
<b>UKG, Inc.</b>			<b>Syngenta Finance NV</b>		
6,875 % fällig am 01.02.2031	\$ 1.000	1.000	4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 1.076	1.060
<b>Golub Capital Partners CLO Ltd.</b>			<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>		
6,641 % fällig am 25.10.2034	1.000	1.000	2,330 % fällig am 25.11.2025	€ 1.000	1.037
<b>Chile Government International Bond</b>			<b>Dominican Republic Government International Bond</b>		
4,850 % fällig am 22.01.2029	1.000	999	6,500 % fällig am 15.02.2048	\$ 1.100	1.032
<b>Cotiviti Corp.</b>			<b>INEOS Styrolution Ludwigshafen GmbH</b>		
8,579 % fällig am 01.05.2031	1.000	995	2,250 % fällig am 16.01.2027	€ 1.050	1.026
<b>Panama Government International Bond</b>			<b>Market Bidco Finco PLC</b>		
3,750 % fällig am 16.03.2025	1.000	975	4,750 % fällig am 04.11.2027	1.000	1.025
<b>Iridium Capital PLC</b>			<b>Setanta Aircraft Leasing DAC</b>		
9,250 % fällig am 18.06.2029	€ 900	969	7,610 % fällig am 05.11.2028	\$ 1.000	1.003
<b>Europäische Union</b>			<b>Panama Government International Bond</b>		
3,375 % fällig am 04.10.2039	900	954	3,750 % fällig am 16.03.2025	1.000	977
<b>CQP Holdco LP</b>			<b>Saudi Arabia Government International Bond</b>		
5,500 % fällig am 15.06.2031	\$ 1.000	938	4,875 % fällig am 18.07.2033	1.000	961
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>			<b>Volkswagen Financial Services NV</b>		
0,000 % fällig am 25.06.2049	£ 700	892	3,500 % fällig am 17.06.2025	€ 900	954
<b>Turkey Government International Bond</b>			<b>BNP Paribas S.A.</b>		
5,875 % fällig am 21.05.2030	€ 800	860	1,904 % fällig am 30.09.2028	\$ 1.075	947
			<b>Sprint Capital Corp.</b>		
			6,875 % fällig am 15.11.2028	900	944
			<b>Occidental Petroleum Corp.</b>		
			7,875 % fällig am 15.09.2031	850	943
			<b>Mexico Government International Bond</b>		
			5,400 % fällig am 09.02.2028	950	941
			<b>Colombia Government International Bond</b>		
			4,500 % fällig am 15.03.2029	1.000	898
			<b>Indonesia Government International Bond</b>		
			1,100 % fällig am 12.03.2033	€ 1.000	840
			<b>Pinnacle Bidco PLC</b>		
			10,000 % fällig am 11.10.2028	£ 600	769
			<b>Energy Transfer LP</b>		
			7,500 % fällig am 01.07.2038	\$ 675	750
			<b>AA Bond Co. Ltd.</b>		
			5,500 % fällig am 31.07.2050	£ 625	748
			<b>Occidental Petroleum Corp.</b>		
			6,625 % fällig am 01.09.2030	\$ 700	738

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)		BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>					<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
Rockford Tower Europe CLO DAC 5,220 % fällig am 24.04.2037	€	500	\$ 542		Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.03.2053	\$	991	\$ 918
Cumulus Static CLO DAC 5,025 % fällig am 15.11.2033		500	541		Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053		849	827
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.12.2053	\$	502	500				<b>AKTIEN</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2054		300	306		PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Markets Bond ESG Fund (a)		48.831	546
Republic of Poland Government International Bond 3,625 % fällig am 11.01.2034	€	250	272				<b>PARI (000S)</b>	
Volkswagen Leasing GmbH 3,875 % fällig am 11.10.2028		200	217		SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	\$	425	377
SCF Rahoituspalvelut DAC 4,364 % fällig am 25.06.2034		200	217		Prime Security Services Borrower LLC 6,250 % fällig am 15.01.2028		250	244
Romania Government International Bond 5,625 % fällig am 30.05.2037		200	214		Grifols S.A. 2,250 % fällig am 15.11.2027	€	250	244
Smurfit Kappa Treasury ULC 5,200 % fällig am 15.01.2030	\$	200			Romania Government International Bond 7,625 % fällig am 17.01.2053	\$	200	220
Türkiye Varlık Fonu Yonetimi A/S 8,250 % fällig am 14.02.2029		200	199		Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034		200	210
Ivory Coast Government International Bond 7,625 % fällig am 30.01.2033		200	197		Lenovo Group Ltd. 6,536 % fällig am 27.07.2032		200	208
New Red Finance, Inc. 6,125 % fällig am 15.06.2029		175	175		Bank of America Corp. 6,204 % fällig am 10.11.2028		200	206
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN	3.204	165		Norinchukin Bank 5,430 % fällig am 09.03.2028		200	201
B.C. Unlimited Liability Co. 3,875 % fällig am 15.01.2028	\$	175	164		CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % fällig am 01.04.2053		200	201
E.ON SE 3,750 % fällig am 15.01.2036	€	150	164		Newell Brands, Inc. 7,000 % fällig am 01.04.2046		240	196
BPCE S.A. 7,003 % fällig am 19.10.2034	\$	150	163		American Airlines, Inc. 5,750 % fällig am 20.04.2029		200	195
Option One Mortgage Loan Trust 5,960 % fällig am 25.07.2036		257	146		Altice France S.A. 5,125 % fällig am 15.07.2029		300	194
IPD BV 7,086 % fällig am 15.06.2031	€	125	136		NCR Voyix Corp. 5,125 % fällig am 15.04.2029		200	188
Hungary Government International Bond 4,000 % fällig am 25.07.2029		125	134		United Airlines, Inc. 4,625 % fällig am 15.04.2029		200	185
Goodman Australia Finance Pty. Ltd. 4,250 % fällig am 03.05.2030		125	133		Amgen, Inc. 3,000 % fällig am 22.02.2029		200	183
United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054	£	100	126		Ardagh Packaging Finance PLC 2,125 % fällig am 15.08.2026	€	200	176
Block, Inc. 6,500 % fällig am 15.05.2032	\$	125	125		New Red Finance, Inc. 6,125 % fällig am 15.06.2029	\$	175	175
UKG, Inc. 6,875 % fällig am 01.02.2031		125	125		Altice Financing S.A. 5,750 % fällig am 15.08.2029		200	167
Republic of Uzbekistan International Bond 5,375 % fällig am 29.05.2027	€	100	109		CCO Holdings LLC 4,500 % fällig am 01.05.2032		200	163
Vmed O2 UK Financing PLC 5,625 % fällig am 15.04.2032		100	108		Tenet Healthcare Corp. 4,625 % fällig am 15.06.2028		150	143
EPH Financing International A/S 5,875 % fällig am 30.11.2029		100	107		Verizon Communications, Inc. 2,850 % fällig am 03.09.2041		200	142
British Telecommunications PLC 3,875 % fällig am 20.01.2034		100	107		CommScope, Inc. 4,750 % fällig am 01.09.2029		200	139
Romania Government International Bond 5,625 % fällig am 22.02.2036		100	107		Community Health Systems, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2031		150	117
Europäische Union 3,375 % fällig am 04.10.2039		100	106		AIB Group PLC 5,250 % fällig am 23.10.2031	€	100	116
CaixaBank S.A. 6,840 % fällig am 13.09.2034	\$	100	106		JCDecaux SE 5,000 % fällig am 11.01.2029		100	115
Walgreens Boots Alliance, Inc. 2,125 % fällig am 20.11.2026	€	100	102		TEGNA, Inc. 5,000 % fällig am 15.09.2029	\$	125	110
Rivian Holdings LLC 11,310 % fällig am 15.10.2026	\$	100	101		Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£	100	110
Freedom Mortgage Holdings LLC 9,125 % fällig am 15.05.2031		100	100		Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027	€	100	108
Shriram Finance Ltd. 6,625 % fällig am 22.04.2027		100	100		Catalent Pharma Solutions, Inc. 2,375 % fällig am 01.03.2028		100	103
Chile Government International Bond 4,850 % fällig am 22.01.2029		100	100		Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028		100	100
Radian Group, Inc. 6,200 % fällig am 15.05.2029		100	100		Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028		100	99
Republic of Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 18.03.2054		100	99		Comcast Corp. 4,650 % fällig am 15.02.2033	\$	100	98
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.09.2053		100	96					
Senegal Government International Bond 5,375 % fällig am 08.06.2037	€	100	78					

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
<b>Allied Universal Holdco LLC</b> 3,625 % fällig am 01.06.2028	€	100	97
<b>T-Mobile USA, Inc.</b> 2,250 % fällig am 15.02.2026	\$	100	95
<b>CTP NV</b> 1,250 % fällig am 21.06.2029	€	100	93
<b>Telecom Italia SpA</b> 1,625 % fällig am 18.01.2029		100	92
<b>Cerba Healthcare SACA</b> 3,500 % fällig am 31.05.2028		100	92
<b>Allied Universal Holdco LLC</b> 3,625 % fällig am 01.06.2028	€	100	97
<b>T-Mobile USA, Inc.</b> 2,250 % fällig am 15.02.2026	\$	100	95
<b>CTP NV</b> 1,250 % fällig am 21.06.2029	€	100	93
<b>Telecom Italia SpA</b> 1,625 % fällig am 18.01.2029		100	92
<b>Cerba Healthcare SACA</b> 3,500 % fällig am 31.05.2028	€	100	97
<b>Allied Universal Holdco LLC</b> 3,625 % fällig am 01.06.2028	\$	100	95

(a) Der Diversified Income ESG Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG			KOSTEN (000S)			ERLÖSE (000S)	
KÄUFE BIS 30. JUNI 2024			AKTIEN	VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024			
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>			36.638.045 \$			357.400	
			<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>Brazil Letras do Tesouro Nacional</b> 0,000 % fällig am 01.04.2025	BRL	287.500	49.140	<b>U.S. Treasury Notes</b> 1,250 % fällig am 31.08.2024	\$	84.500	83.137
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.09.2052	\$	17.573	16.425	<b>Brazil Letras do Tesouro Nacional</b> 0,000 % fällig am 01.07.2024	BRL	266.600	49.209
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.07.2052		16.998	15.888	<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.09.2052	\$	17.573	16.352
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.10.2052		16.509	15.430	<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.07.2052		16.998	15.818
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.10.2052		15.998	14.954	<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.10.2052		16.509	15.362
<b>Peru Government International Bond</b> 6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN	57.300	14.433	<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.10.2052		15.998	14.887
<b>South Africa Government International Bond</b> 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	265.100	13.339	<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.03.2054		12.110	11.267
<b>South Africa Government International Bond</b> 8,500 % fällig am 31.01.2037		307.800	13.274	<b>Telecom Italia SpA</b> 7,875 % fällig am 31.07.2028	€	5.900	7.066
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.03.2054	\$	12.110	11.286	<b>CPI Property Group S.A.</b> 1,625 % fällig am 23.04.2027		6.650	6.078
<b>Peru Government International Bond</b> 6,950 % fällig am 12.08.2031	PEN	42.000	11.260	<b>Atrium Finance PLC</b> 2,625 % fällig am 05.09.2027		5.200	4.555
<b>AbbVie, Inc.</b> 4,950 % fällig am 15.03.2031	\$	8.300	8.291	<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b> 4,250 % fällig am 15.01.2030	£	4.000	4.436
<b>Turkey Government International Bond</b> 7,625 % fällig am 15.05.2034		8.300	8.157	<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.08.2052	\$	4.200	3.908
<b>Telekom Srbija</b> 0,000 % fällig am 11.06.2029	€	7.500	8.085	<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.10.2052		4.000	3.722
<b>ING Groep NV</b> 5,550 % fällig am 19.03.2035	\$	7.000	7.000	<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.08.2052		4.000	3.722
<b>Athene Global Funding</b> 4,823 % fällig am 23.02.2027	€	5.200	5.621	<b>Societe Generale S.A.</b> 4,677 % fällig am 15.06.2027		3.700	3.643
<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b> 5,800 % fällig am 05.03.2027	\$	4.600	4.597	<b>IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)</b> 3,750 % fällig am 15.09.2026	€	3.200	3.438
<b>Caesars Entertainment, Inc.</b> 8,097 % fällig am 06.02.2031		4.300	4.289	<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.09.2052	\$	3.578	3.330
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.08.2052		4.200	3.925	<b>Freddie Mac</b> 4,000 % fällig am 01.04.2053		3.494	3.252
<b>Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC</b> 0,000 % fällig am 05.04.2032		6.500	3.916	<b>Charter Communications Operating LLC</b> 4,908 % fällig am 23.07.2025		2.970	2.938

(a) Der Dynamic Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
Bundesrepublik Deutschland 2,300 % fällig am 15.02.2033	€	122.400	€ 122.081	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		1.248.800 €	122.190
		<b>AKTIEN</b>				<b>PARI (000S)</b>	
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (a)		5.137.457	86.755	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$	126.825	106.210
		<b>PARI (000S)</b>				<b>AKTIEN</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.10.2028 (b)	\$	48.043	45.135	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (a)		2.117.246	36.417
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)		41.998	39.174	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (a)		2.064.482	21.638
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)		39.822	34.622	Hitachi Zosen Corp.		2.829.100	19.921
		<b>AKTIEN</b>		Vestas Wind Systems A/S		714.100	17.794
Microsoft Corp.		75.362	29.001	ABB Ltd.		363.540	16.360
Apple, Inc.		142.066	24.161	First Solar, Inc.		97.000	15.154
AbbVie, Inc.		109.711	16.563			<b>PARI (000S)</b>	
Meta Platforms, Inc. 'A'		37.032	16.041	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,400 % fällig am 01.05.2033	€	14.300	15.047
Amazon.com, Inc.		87.534	15.328			<b>AKTIEN</b>	
		<b>PARI (000S)</b>		Enphase Energy, Inc.		147.500	14.991
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,400 % fällig am 01.05.2033	€	14.300	15.178	Lam Research Corp.		17.450	14.901
		<b>AKTIEN</b>		Schneider Electric SE		69.500	14.742
Johnson & Johnson		106.299	14.779	KLA Corp.		21.686	14.188
		<b>PARI (000S)</b>		UPM-Kymmene Oyj		426.900	14.185
Province of British Columbia 3,000 % fällig am 24.07.2034	€	14.600	14.453	Holmen AB		377.300	13.597
		<b>AKTIEN</b>		Vertex Pharmaceuticals, Inc.		34.360	13.035
Alphabet, Inc. 'C'		89.484	14.123	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.		14.097	12.620
		<b>PARI (000S)</b>		Elevance Health, Inc.		25.970	12.554
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2046 (b)	\$	19.177	13.733	Centene Corp.		183.600	12.478
		<b>AKTIEN</b>		Rexel S.A.		509.300	12.436
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (a)		1.269.194	12.961	Steel Dynamics, Inc.		98.788	12.176
		<b>PARI (000S)</b>		Arista Networks, Inc.		46.300	11.806
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2024	€	10.950	10.936	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.		502.809	11.221
		<b>AKTIEN</b>		Keysight Technologies, Inc.		77.700	11.195
NVIDIA Corp.		59.627	10.782	EPAM Systems, Inc.		48.250	11.153
Merck & Co., Inc.		88.343	10.743	NetApp, Inc.		112.818	10.733
		<b>PARI (000S)</b>		Siemens AG		60.273	10.639
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 05.04.2024	€	10.600	10.574	Teradyne, Inc.		111.200	10.583
		<b>AKTIEN</b>		Samsung Electronics Co. Ltd.		199.713	10.573
				Exxon Mobil Corp.		110.100	10.383
				CF Industries Holdings, Inc.		149.600	10.355

(a) Der Dynamic Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	133.516.810	\$ 1.330.529
	<b>PARI (000S)</b>	
Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026	MXN 1.635.683	87.644
Malaysia Government International Bond 2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR 428.230	84.218
Asiatische Infrastrukturinvestmentbank 7,000 % fällig am 01.03.2029	INR 6.090.600	73.118
Peru Government International Bond 6,950 % fällig am 12.08.2031	PEN 255.600	69.528
United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054	£ 41.100	49.776
Thailand Government International Bond 2,400 % fällig am 17.03.2029	THB 1.630.780	45.644
Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 01.03.2029	MXN 738.900	42.553
Asian Development Bank 6,720 % fällig am 08.02.2028	INR 3.363.500	40.488
Colombian TES 6,250 % fällig am 09.07.2036	COP 218.080.700	38.492
Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	157.956.400	34.793
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN 665.196	34.157
Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 29.05.2031	623.600	34.078
Turkey Government International Bond 26,200 % fällig am 05.10.2033	TRY 1.131.800	33.725
Peru Government International Bond 6,900 % fällig am 12.08.2037	PEN 132.400	33.609
Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 31.05.2029	MXN 581.500	33.564
Malaysia Government Investment Issue 3,599 % fällig am 31.07.2028	MYR 158.140	33.487
Dominican Republic Government International Bond 10,750 % fällig am 01.06.2036	DOP 1.954.200	32.860
Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 24.08.2034	MXN 563.524	30.811
Ecopetrol S.A. 0,000 % fällig am 17.08.2024	\$ 29.400	29.315

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	131.399.741	\$ 1.309.400
	<b>PARI (000S)</b>	
Thailand Government International Bond 2,400 % fällig am 17.03.2029	THB 3.562.989	99.776
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN 1.389.951	70.921
Peru Government International Bond 6,950 % fällig am 12.08.2031	PEN 229.800	62.537
Poland Government International Bond 2,750 % fällig am 25.04.2028	PLN 243.700	55.827
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 922.700	51.325
United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054	£ 41.100	50.341
Poland Government International Bond 3,750 % fällig am 25.05.2027	PLN 201.200	49.040
Thailand Government International Bond 2,250 % fällig am 17.03.2027	THB 1.681.280	46.761
China Government International Bond 2,620 % fällig am 25.09.2029	CNY 308.300	43.567
Mexico Government International Bond 7,500 % fällig am 03.06.2027	MXN 697.100	39.538
Malaysia Government Investment Issue 3,599 % fällig am 31.07.2028	MYR 182.740	38.231
Thailand Government International Bond 3,390 % fällig am 17.06.2037	THB 1.278.117	37.365
Malaysia Government Investment Issue 3,465 % fällig am 15.10.2030	MYR 177.660	36.789
Malaysia Government International Bond 2,632 % fällig am 15.04.2031	183.230	35.800
Malaysia Government Investment Issue 4,070 % fällig am 30.09.2026	153.961	33.088
Indonesia Government International Bond 6,500 % fällig am 15.02.2031	IDR 542.895.000	32.848
Indonesia Government International Bond 6,125 % fällig am 15.05.2028	524.551.000	31.788
Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026	MXN 546.163	29.660
Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 01.03.2029	550.900	29.604

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026	MXN	56.354	\$ 3.028	Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN	50.765 \$ 2.575
Mexico Government International Bond 7,000 % fällig am 03.09.2026		52.500	2.953	United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054	£	1.700 2.083
Asiatische Infrastrukturinvestmentbank 7,000 % fällig am 01.03.2029	INR	220.700	2.646	Peru Government International Bond 6,950 % fällig am 12.08.2031	PEN	7.400 2.004
Malaysia Government International Bond 2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	12.770	2.512	Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 29.05.2031	MXN	41.600 1.992
Peru Government International Bond 6,950 % fällig am 12.08.2031	PEN	8.800	2.389	Thailand Government International Bond 3,390 % fällig am 17.06.2037	THB	68.907 1.979
International Bank for Reconstruction & Development 8,250 % fällig am 21.12.2026	ZAR	40.000	2.104	Malaysia Government International Bond 2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	9.120 1.785
United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054	£	1.700	2.057	Thailand Government International Bond 2,650 % fällig am 17.06.2028	THB	60.024 1.695
Romania Government International Bond 4,150 % fällig am 26.01.2028	RON	9.000	1.826	Poland Government International Bond 7,500 % fällig am 25.07.2028	PLN	4.800 1.291
Colombian TES 6,250 % fällig am 09.07.2036	COP	9.389.900	1.657	Malaysia Government Investment Issue 3,599 % fällig am 31.07.2028	MYR	5.680 1.203
Mexico Government International Bond 8,000 % fällig am 24.05.2035	MXN	30.000	1.639	Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 01.03.2029	MXN	23.100 1.190
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	6.000	1.637	Colombian TES 6,250 % fällig am 09.07.2036	COP	6.302.200 1.118
Indonesia Government International Bond 7,375 % fällig am 15.10.2030	IDR	24.258.000	1.605	Indonesia Government International Bond 8,750 % fällig am 15.05.2031	IDR	15.247.000 1.038
Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 24.08.2034	MXN	29.269	1.582	Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 24.08.2034	MXN	19.521 1.007
Czech Republic Government International Bond 2,500 % fällig am 25.08.2028	CZK	36.200	1.491	Thailand Government International Bond 2,250 % fällig am 17.03.2027	THB	32.630 905
Asian Development Bank 6,720 % fällig am 08.02.2028	INR	119.100	1.434	Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026	MXN	16.284 888
Dominican Republic Government International Bond 10,750 % fällig am 01.06.2036	DOP	84.300	1.422	Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 18.11.2038		18.000 847
Peru Government International Bond 6,900 % fällig am 12.08.2037	PEN	5.400	1.375	Malaysia Government Investment Issue 4,130 % fällig am 09.07.2029	MYR	3.710 794
Europäische Investitionsbank 2,875 % fällig am 15.11.2029	PLN	5.923	1.318	Malaysia Government International Bond 3,885 % fällig am 15.08.2029		3.650 774
Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	COP	5.989.600	1.308	Thailand Government International Bond 2,400 % fällig am 17.03.2029	THB	26.870 752
Bonos de la Tesorería de la República en pesos 6,200 % fällig am 01.10.2040	CLP	1.095.000	1.208	Poland Government International Bond 2,750 % fällig am 25.10.2029	PLN	3.300 745
Malaysia Government Investment Issue 3,599 % fällig am 31.07.2028	MYR	5.610	1.188	Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.04.2032	IDR	12.257.000 729
Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 01.03.2029	MXN	20.500	1.182	Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.08.2028		11.778.000 719
Peru Government International Bond 6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN	4.700	1.181	Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	2.500 672
Türkiye Government Bond 50,000 % fällig am 17.05.2028	TRY	36.900	1.132	Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP	2.259.100 671
Turkey Government International Bond 26,200 % fällig am 05.10.2033		37.500	1.119	Peru Government International Bond 6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN	2.200 558
Peru Government International Bond 6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN	4.100	1.044	Türkey Government International Bond 26,200 % fällig am 05.10.2033	TRY	18.600 550
Thailand Government International Bond 3,390 % fällig am 17.06.2037	THB	35.620	1.026	Romania Government International Bond 4,150 % fällig am 24.10.2030	RON	2.800 539
Poland Government International Bond 7,500 % fällig am 25.07.2028	PLN	3.500	951	Malaysia Government Investment Issue 3,465 % fällig am 15.10.2030	MYR	2.500 516
Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN	18.522	950	Thailand Government International Bond 3,450 % fällig am 17.06.2043	THB	17.330 515
Uruguay Government International Bond 3,400 % fällig am 16.05.2045	UYU	33.600	872	Republic of Colombia 0,000 % fällig am 03.11.2027	COP	2.321.000 509
Czech Republic Government International Bond 0,050 % fällig am 29.11.2029	CZK	24.700	861			

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG			KOSTEN (000S)			ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS 30. JUNI 2024				VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>			121.955.608 \$	1.215.300		
			<b>PARI (000S)</b>			
<b>Mexico Government International Bond</b> 3,000 % fällig am 03.12.2026	MXN	1.912.889		99.854		
<b>Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC</b> 0,000 % fällig am 05.04.2032	\$	46.667		28.118		
<b>Elfenbeinküste</b> 6,852 % fällig am 07.03.2025	€	22.400		23.867		
<b>Iridium Capital PLC</b> 9,250 % fällig am 18.06.2029		20.500		22.082		
<b>Finanzministerium der Regierung von Schardscha</b> 6,125 % fällig am 06.03.2036	\$	19.800		19.620		
<b>Chile Government International Bond</b> 4,850 % fällig am 22.01.2029		19.600		19.581		
<b>Ecopetrol S.A.</b> 0,000 % fällig am 17.08.2024		19.500		19.443		
<b>QNB Finance Ltd.</b> 4,875 % fällig am 30.01.2029		19.300		19.146		
<b>Gaci First Investment Co.</b> 5,375 % fällig am 29.01.2054		21.900		18.969		
<b>Mexico Government International Bond</b> 4,490 % fällig am 25.05.2032	€	17.000		18.448		
<b>Hungary Government International Bond</b> 4,000 % fällig am 25.07.2029		17.000		18.207		
<b>Israel Government International Bond</b> 5,500 % fällig am 12.03.2034	\$	16.700		16.570		
<b>Saudi Arabia Government International Bond</b> 5,000 % fällig am 16.01.2034		15.800		15.615		
<b>Mexico Government International Bond</b> 6,400 % fällig am 07.05.2054		15.400		15.018		
<b>KSA Sukuk Ltd.</b> 5,250 % fällig am 04.06.2034		15.000		14.826		
<b>Turkey Government International Bond</b> 7,625 % fällig am 15.05.2034		14.500		14.294		
<b>SK Hynix, Inc.</b> 6,500 % fällig am 17.01.2033		12.600		13.442		
<b>El Salvador Government International Bond</b> 5,875 % fällig am 30.01.2025		13.709		13.117		
<b>Egypt Government International Bond</b> 6,375 % fällig am 11.04.2031	€	14.000		12.527		
<b>Saudi Arabia Government International Bond</b> 4,750 % fällig am 18.01.2028	\$	27.600		27.479		
<b>Bulgaria Government International Bond</b> 4,875 % fällig am 13.05.2036	€	14.800		17.336		
<b>Ecuador Government International Bond</b> 6,000 % fällig am 31.07.2030	\$	26.095		16.754		
<b>QatarEnergy</b> 1,375 % fällig am 12.09.2026		18.000		16.540		
<b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b> 5,063 % fällig am 12.09.2025		16.500		16.434		
<b>Eskom Holdings SOC Ltd.</b> 8,450 % fällig am 10.08.2028		13.200		13.226		
<b>Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S</b> 8,509 % fällig am 14.01.2029		12.300		12.840		
<b>Turkey Government International Bond</b> 7,625 % fällig am 15.05.2034		12.900		12.770		
<b>KSA Sukuk Ltd.</b> 5,268 % fällig am 25.10.2028		12.300		12.546		
<b>Turkey Government International Bond</b> 5,875 % fällig am 21.05.2030	€	11.470		12.252		
<b>Egypt Government International Bond</b> 7,300 % fällig am 30.09.2033	\$	14.200		10.884		
<b>Poland Government International Bond</b> 5,500 % fällig am 16.11.2027		10.250		10.522		
<b>Petroleos Mexicanos</b> 10,000 % fällig am 07.02.2033		9.950		10.099		
<b>Egypt Government International Bond</b> 7,625 % fällig am 29.05.2032		11.800		10.063		
<b>Bank Gospodarstwa Krajowego</b> 4,375 % fällig am 13.03.2039	€	8.800		9.541		
<b>Republic of Poland Government International Bond</b> 5,125 % fällig am 18.09.2034	\$	9.400		9.149		
<b>Mexico Government International Bond</b> 6,000 % fällig am 07.05.2036		8.600		8.688		
<b>Barclays PLC</b> 5,304 % fällig am 09.08.2026		8.400		8.331		
<b>Republic of Poland Government International Bond</b> 4,875 % fällig am 04.10.2033		8.500		8.313		

(a) Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
Romania Government International Bond 5,625 % fällig am 22.02.2036	€	91.200	\$ 97.240
Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026	MXN	757.178	39.441
Colombia Government International Bond 8,000 % fällig am 14.11.2035	\$	33.800	35.347
Serbia Government International Bond 6,000 % fällig am 12.06.2034		35.000	34.296
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042		35.300	29.803
Qatar Government International Bond 4,750 % fällig am 29.05.2034		29.800	29.641
Qatar Government International Bond 4,625 % fällig am 29.05.2029		29.400	29.252
Colombia Government International Bond 8,750 % fällig am 14.11.2053		21.300	22.798
Chile Government International Bond 4,850 % fällig am 22.01.2029		20.900	20.880
Republic of Poland Government International Bond 5,125 % fällig am 18.09.2034		20.200	20.140
Philippines Government International Bond 5,600 % fällig am 14.05.2049		19.650	19.650
Iridium Capital PLC 9,250 % fällig am 18.06.2029	€	17.800	19.173
Dominican Republic Government International Bond 6,600 % fällig am 01.06.2036	\$	17.000	16.863
Elfenbeinküste 6,852 % fällig am 07.03.2025	€	15.800	16.835
Republic of Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 18.03.2054	\$	16.900	16.704
Ivory Coast Government International Bond 7,625 % fällig am 30.01.2033		16.400	16.173
Hungary Government International Bond 4,000 % fällig am 25.07.2029	€	14.400	15.425
LG Energy Solution Ltd. 5,375 % fällig am 02.07.2029	\$	15.000	14.995
Finanzministerium der Regierung von Schardscha 6,125 % fällig am 06.03.2036		15.000	14.863
Engie Energia Chile S.A. 6,375 % fällig am 17.04.2034		14.900	14.743
NBK SPC Ltd. 5,500 % fällig am 06.06.2030		14.600	14.586
Corp. Financiera de Desarrollo S.A. 5,950 % fällig am 30.04.2029		14.600	14.426
Raizen Fuels Finance S.A. 6,950 % fällig am 05.03.2054		14.400	14.182
Mexico Government International Bond 4,490 % fällig am 25.05.2032	€	12.100	13.130

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	565.700	\$ 32.376
Romania Government International Bond 2,124 % fällig am 16.07.2031	€	36.110	31.385
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	\$	35.300	29.811
Republic of Poland Government International Bond 4,875 % fällig am 04.10.2033		22.000	21.622
Oman Government International Bond 6,750 % fällig am 28.10.2027		14.400	14.887
Ecuador Government International Bond 6,000 % fällig am 31.07.2030		21.400	13.740
Uruguay Government International Bond 4,975 % fällig am 20.04.2055		14.600	13.501
Kazakhstan Government International Bond 6,500 % fällig am 21.07.2045		11.400	13.253
Uruguay Government International Bond 5,100 % fällig am 18.06.2050		13.818	13.142
Hungary Government International Bond 2,125 % fällig am 22.09.2031		16.350	12.889
Bulgaria Government International Bond 4,875 % fällig am 13.05.2036	€	11.000	12.884
Colombia Government International Bond 4,125 % fällig am 15.05.2051	\$	17.700	10.805
Colombia Government International Bond 7,375 % fällig am 18.09.2037		10.565	10.477
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034		10.010	10.085
Slovenia Government International Bond 5,000 % fällig am 19.09.2033		9.800	9.847
Serbia Government International Bond 1,650 % fällig am 03.03.2033	€	11.900	9.776
Serbia Government International Bond 6,500 % fällig am 26.09.2033	\$	9.500	9.702
Panama Government International Bond 6,400 % fällig am 14.02.2035		10.000	9.561
Banco Santander S.A. 5,147 % fällig am 18.08.2025		9.600	9.528
Cantor Fitzgerald LP 7,200 % fällig am 12.12.2028		9.250	9.401
Romania Government International Bond 3,500 % fällig am 03.04.2034	€	10.300	9.347
Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033		11.300	9.150
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 8,509 % fällig am 14.01.2029	\$	8.700	9.082
Egypt Government International Bond 5,250 % fällig am 06.10.2025		10.100	9.003

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	4.980.832	\$ 49.635	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	5.198.161	\$ 51.800
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>Pluspetrol Camisea S.A.</b> 6,240 % fällig am 03.07.2036	\$ 1.700	1.699	<b>Banco Santander Mexico S.A.</b> 5,375 % fällig am 17.04.2025	\$ 1.800	1.791
<b>Inversiones CMPC S.A.</b> 6,125 % fällig am 26.02.2034	1.300	1.292	<b>Inversiones CMPC S.A.</b> 6,125 % fällig am 26.02.2034	1.300	1.301
<b>Millicom International Cellular S.A.</b> 7,375 % fällig am 02.04.2032	1.200	1.200	<b>Banco de Credito del Peru S.A.</b> 2,700 % fällig am 11.01.2025	1.300	1.270
<b>Southern Copper Corp.</b> 7,500 % fällig am 27.07.2035	1.000	1.152	<b>JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.</b> 6,435 % fällig am 25.12.2035	1.100	981
<b>Colombia Government International Bond</b> 7,500 % fällig am 02.02.2034	1.000	1.003	<b>Colombia Government International Bond</b> 4,500 % fällig am 28.01.2026	1.000	980
<b>Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.</b> 3,250 % fällig am 15.08.2030	1.100	897	<b>Türkiye Is Bankasi A/S</b> 9,375 % fällig am 31.01.2026	900	941
<b>Cencosud S.A.</b> 5,950 % fällig am 28.05.2031	900	890	<b>CT Trust</b> 5,125 % fällig am 03.02.2032	1.000	888
<b>Avianca Midco PLC</b> 9,000 % fällig am 01.12.2028	900	856	<b>Chile Government International Bond</b> 4,340 % fällig am 07.03.2042	900	792
<b>Akbank TAS</b> 7,498 % fällig am 20.01.2030	853	853	<b>Pertamina Persero PT</b> 5,625 % fällig am 20.05.2043	800	783
<b>Elfenbeinküste</b> 6,852 % fällig am 07.03.2025	€ 800	852	<b>Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT</b> 3,750 % fällig am 30.03.2026	800	764
<b>MGM China Holdings Ltd.</b> 7,125 % fällig am 26.06.2031	\$ 800	800	<b>Sasol Financing USA LLC</b> 6,500 % fällig am 27.09.2028	800	757
<b>Banco de Credito e Inversiones S.A.</b> 8,750 % fällig am 08.02.2029	800	800	<b>Millicom International Cellular S.A.</b> 7,375 % fällig am 02.04.2032	700	701
<b>Arabian Centres Sukuk Ltd.</b> 9,500 % fällig am 06.03.2029	800	800	<b>CSN Inova Ventures</b> 6,750 % fällig am 28.01.2028	700	677
<b>Ford Otomotiv Sanayi A/S</b> 7,125 % fällig am 25.04.2029	800	800	<b>LLPL Capital Pte. Ltd.</b> 6,875 % fällig am 04.02.2039	619	622
<b>FWD Group Holdings Ltd.</b> 7,635 % fällig am 02.07.2031	800	800	<b>Celulosa Arauco y Constitucion S.A.</b> 5,500 % fällig am 30.04.2049	700	579
<b>AES Andes S.A.</b> 6,300 % fällig am 15.03.2029	800	799	<b>Turkey Government International Bond</b> 9,375 % fällig am 19.01.2033	500	551
<b>QNB Finance Ltd.</b> 4,875 % fällig am 30.01.2029	800	794	<b>Arabian Centres Sukuk Ltd.</b> 9,500 % fällig am 06.03.2029	500	518
<b>Banco de Credito del Peru S.A.</b> 3,125 % fällig am 01.07.2030	800	767	<b>Wynn Macau Ltd.</b> 4,875 % fällig am 01.10.2024	500	498
<b>Sasol Financing USA LLC</b> 4,500 % fällig am 08.11.2027	800	710	<b>AES Andes S.A.</b> 6,300 % fällig am 15.03.2029	500	497

(a) Der Emerging Markets Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	24.544.158	\$ 244.585	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	22.900.247	\$ 228.200
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Bonds</b>			<b>U.S. Treasury Notes</b>		
4,750 % fällig am 15.11.2043	\$ 11.489	11.862	1,125 % fällig am 15.05.2040	\$ 17.500	10.801
<b>South Africa Government International Bond</b>			<b>Mexico Government International Bond</b>		
8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR 177.800	8.779	7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN 148.000	7.419
<b>Dominican Republic Government International Bond</b>			<b>Poland Government International Bond</b>		
10,750 % fällig am 01.06.2036	DOP 465.400	7.819	0,250 % fällig am 25.10.2026	PLN 33.200	7.316
<b>Peru Government International Bond</b>			<b>Turkey Government International Bond</b>		
6,950 % fällig am 12.08.2031	PEN 27.600	7.368	26,200 % fällig am 05.10.2033	TRY 234.600	7.268
<b>Turkey Government International Bond</b>			<b>Poland Government International Bond</b>		
26,200 % fällig am 05.10.2033	TRY 234.600	6.990	3,750 % fällig am 25.05.2027	PLN 19.000	4.501
<b>U.S. Treasury Bonds</b>			<b>Israel Government International Bond</b>		
1,750 % fällig am 15.08.2041	\$ 10.400	6.879	5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 4.000	4.422
<b>Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC</b>			<b>Ecuador Government International Bond</b>		
0,000 % fällig am 05.04.2032	8.500	5.121	6,000 % fällig am 31.07.2030	\$ 5.990	3.847
<b>Peru Government International Bond</b>			<b>Hyundai Card Co. Ltd.</b>		
6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN 19.500	4.905	5,750 % fällig am 24.04.2029	3.200	3.213
<b>Hungary Treasury Bills</b>			<b>Chile Government International Bond</b>		
0,000 % fällig am 09.05.2024	HUF 1.711.000	4.673	4,850 % fällig am 22.01.2029	3.100	3.070
<b>Peru Government International Bond</b>			<b>Turkey Government International Bond</b>		
7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN 13.800	3.710	7,625 % fällig am 15.05.2034	2.900	2.919
<b>Elfenbeinküste</b>			<b>Poland Government International Bond</b>		
6,852 % fällig am 07.03.2025	€ 3.400	3.623	2,750 % fällig am 25.04.2028	PLN 12.700	2.857
<b>Iridium Capital PLC</b>			<b>QNB Finance Ltd.</b>		
9,250 % fällig am 18.06.2029	3.200	3.447	4,875 % fällig am 30.01.2029	\$ 2.900	2.835
<b>Vale Overseas Ltd.</b>			<b>Saudi Arabia Government International Bond</b>		
6,400 % fällig am 28.06.2054	\$ 3.200	3.176	5,000 % fällig am 16.01.2034	2.800	2.747
<b>Hyundai Card Co. Ltd.</b>			<b>Israel Government International Bond</b>		
5,750 % fällig am 24.04.2029	3.200	3.162	5,500 % fällig am 12.03.2034	2.900	2.733
<b>Banque Centrale de Tunisie Government International Bond</b>			<b>Peru Government International Bond</b>		
6,375 % fällig am 15.07.2026	€ 3.400	3.140	7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN 9.400	2.641
<b>Chile Government International Bond</b>			<b>Mexico Government International Bond</b>		
4,850 % fällig am 22.01.2029	\$ 3.100	3.097	8,500 % fällig am 18.11.2038	MXN 46.000	2.598
<b>South Africa Government International Bond</b>			<b>Poland Government International Bond</b>		
8,500 % fällig am 31.01.2037	ZAR 72.500	3.089	2,500 % fällig am 25.07.2026	PLN 10.000	2.339
<b>Gaci First Investment Co.</b>			<b>Czech Republic Government International Bond</b>		
5,375 % fällig am 29.01.2054	\$ 3.400	2.945	2,750 % fällig am 23.07.2029	CZK 49.000	2.076
<b>Israel Government International Bond</b>			<b>South Africa Government International Bond</b>		
5,500 % fällig am 12.03.2034	2.900	2.877	6,500 % fällig am 28.02.2041	ZAR 64.900	2.058

(a) Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden.

Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
Singapore Government International Bond 2,125 % fällig am 01.06.2026	SGD	2.460	\$ 1.791	Mexico Government International Bond 7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN	17.500 \$ 877
Mexico Government International Bond 7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN	17.500	985	Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026		8.142 444
Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 03.12.2026		10.150	555	Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 01.03.2029		5.900 305
Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 01.03.2029		5.900	333	Eskom Holdings SOC Ltd. 7,850 % fällig am 02.04.2026	ZAR	5.000 261
Asian Development Bank 6,720 % fällig am 08.02.2028	INR	22.500	271	Corp. Nacional del Cobre de Chile 6,440 % fällig am 26.01.2036	\$	200 204
Iridium Capital PLC 9,250 % fällig am 18.06.2029	€	250	269	Panama Government International Bond 7,875 % fällig am 01.03.2057		200 204
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	3.700	208	Mexico Government International Bond 6,000 % fällig am 07.05.2036		200 201
Prosus NV 5,500 % fällig am 21.07.2025	\$	200	201	Chile Government International Bond 4,850 % fällig am 22.01.2029		200 198
Corp. Nacional del Cobre de Chile 6,440 % fällig am 26.01.2036		200	200	Poland Government International Bond 2,500 % fällig am 25.07.2027	PLN	770 177
Chile Government International Bond 4,850 % fällig am 22.01.2029		200	200	Gaci First Investment Co. 5,375 % fällig am 29.01.2054	\$	200 175
QNB Finance Ltd. 4,875 % fällig am 30.01.2029		200	198	Poland Government International Bond 7,500 % fällig am 25.07.2028	PLN	600 167
Mexico Government International Bond 6,000 % fällig am 07.05.2036		200	198	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031	COP	676.600 150
Indonesia Asahan Aluminium PT 4,750 % fällig am 15.05.2025		200	197	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031		676.600 150
Panama Government International Bond 3,750 % fällig am 16.03.2025		200	195	Dominican Republic Government International Bond 11,250 % fällig am 15.09.2035	DOP	8.000 149
Panama Government International Bond 7,875 % fällig am 01.03.2057		200	192	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031	COP	676.600 148
Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC 0,000 % fällig am 05.04.2032		300	181	United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054	£	120 147
Europäische Investitionsbank 2,875 % fällig am 15.11.2029	PLN	800	179	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031	COP	676.600 147
Türkiye Government Bond 50,000 % fällig am 17.05.2028	TRY	5.700	175	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031		676.600 145
Gaci First Investment Co. 5,375 % fällig am 29.01.2054	\$	200	173	Mexico Government International Bond 2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN	2.724 140
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031	COP	676.600	153	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031	COP	676.600 137
Asiatische Infrastrukturinvestmentsbank 7,000 % fällig am 01.03.2029	INR	12.700	152	Peru Government International Bond 6,950 % fällig am 12.08.2031	PEN	500 136
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031	COP	676.600	150	Ecuador Government International Bond 6,000 % fällig am 31.07.2030	\$	210 129
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031		676.600	148	Romania Government International Bond 6,375 % fällig am 18.09.2033	€	100 112
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031		676.600	148	Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026		100 111
United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054	£	120	145	Turkey Government International Bond 5,875 % fällig am 21.05.2030		100 107
Malaysia Government International Bond 2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	700	138	Mexico Government International Bond 7,500 % fällig am 03.06.2027	MXN	2.100 106
Peru Government International Bond 6,950 % fällig am 12.08.2031	PEN	500	136			
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031	COP	676.600	135	<b>AKTIEN</b>		
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.03.2031		676.600	135	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		10.035 100
Dominican Republic Government International Bond 10,750 % fällig am 01.06.2036	DOP	8.000	134			
Uruguay Government International Bond 3,400 % fällig am 16.05.2045	UYU	4.800	125	Mexico Government International Bond 5,750 % fällig am 05.03.2026	MXN	2.000 100
HDFC Bank Ltd. 8,100 % fällig am 22.03.2025	INR	10.000	121	China Government International Bond 3,020 % fällig am 27.05.2031	CNY	600 87
				Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 5,000 % fällig am 01.10.2028	CLP	80.000 86
				Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 31.05.2029	MXN	1.500 82
				Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 6,200 % fällig am 01.10.2040	CLP	70.000 77
				Republic of Colombia 1,000 % fällig am 18.09.2030	COP	323.700 76

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
<b>Republic of Colombia</b>			
1,000 % fällig am 18.09.2030	COP	323.700	76

(a) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,500 % fällig am 15.04.2027	\$	5.500	\$ 5.459	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.07.2024 (a)	\$	1.818 \$ 1.815
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,500 % fällig am 31.03.2026		5.400	5.356	<b>Societe Generale S.A.</b> 6,691 % fällig am 10.01.2034		1.000 1.033
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,000 % fällig am 01.04.2054		5.295	5.137	<b>Nemak S.A.B. de C.V.</b> 2,250 % fällig am 20.07.2028	€	400 386
<b>USAA Capital Corp.</b> 0,500 % fällig am 01.05.2024		5.100	5.077	<b>Barclays PLC</b> 4,836 % fällig am 09.05.2028	\$	400 385
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 1,375 % fällig am 15.07.2033 (a)		5.288	5.037	<b>JCDecaux SE</b> 1,625 % fällig am 07.02.2030	€	300 288
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,500 % fällig am 01.05.2054		4.752	4.452	<b>Newell Brands, Inc.</b> 4,875 % fällig am 01.06.2025	\$	200 197
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.05.2054		4.795	4.361	<b>Svenska Handelsbanken AB</b> 4,750 % fällig am 01.03.2031		200 171
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,500 % fällig am 01.12.2053		2.813	2.801	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,500 % fällig am 15.04.2024 (a)		49 49
<b>Asian Development Bank</b> 6,720 % fällig am 08.02.2028	INR	229.100	2.757	(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,000 % fällig am 01.03.2054	\$	2.682	2.608	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
<b>Trinity Square PLC</b> 0,000 % fällig am 15.07.2059	£	1.900	2.370	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,500 % fällig am 01.09.2053	\$	1.903	1.817			
<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b> 6,050 % fällig am 05.03.2031		1.700	1.696			
<b>Mexico Government International Bond</b> 4,490 % fällig am 25.05.2032	€	1.400	1.519			
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,500 % fällig am 01.11.2053	\$	1.401	1.400			
<b>Hungary Government International Bond</b> 4,000 % fällig am 25.07.2029	€	1.300	1.387			
<b>Golub Capital Partners CLO Ltd.</b> 6,641 % fällig am 25.10.2034	\$	1.300	1.300			
<b>Brazil Government International Bond</b> 6,125 % fällig am 15.03.2034		800	787			
<b>Schaeffler AG</b> 4,500 % fällig am 28.03.2030	€	700	755			
<b>Chobani LLC</b> 7,625 % fällig am 01.07.2029	\$	700	700			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 4,000 % fällig am 15.11.2030	€	52.300 €	<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)</b>	492.000 €	49.401
<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b> 2,625 % fällig am 10.01.2034		46.000		<b>PARI (000S)</b>	
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 4,400 % fällig am 01.05.2033		42.385	<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 4,100 % fällig am 01.02.2029	€	34.700
			<b>France Government International Bond</b> 2,500 % fällig am 24.09.2026		33.300
<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)</b>		310.000	<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 4,400 % fällig am 01.05.2033		19.600
			<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 1,750 % fällig am 01.07.2024		20.200
<b>Europäische Union</b> 3,250 % fällig am 04.02.2050	€	27.700	<b>Belgium Government International Bond</b> 2,850 % fällig am 22.10.2034		18.000
<b>Belgium Government International Bond</b> 2,850 % fällig am 22.10.2034		25.500	<b>Spain Government International Bond</b> 2,350 % fällig am 30.07.2033		12.400
<b>Europäische Finanzstabilisierungsfazilität</b> 2,875 % fällig am 13.02.2034		22.800	<b>Spain Government International Bond</b> 3,250 % fällig am 30.04.2034		11.700
<b>France Government International Bond</b> 1,500 % fällig am 25.05.2050		31.800	<b>BMW Finance NV</b> 3,905 % fällig am 09.12.2024		10.400
<b>Austria Government International Bond</b> 2,900 % fällig am 20.02.2033		20.300	<b>Belgium Government International Bond</b> 1,400 % fällig am 22.06.2053		16.200
<b>France Government International Bond</b> 3,000 % fällig am 25.05.2033		19.100	<b>Realkredit Danmark A/S</b> 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	95.796
<b>Spain Government International Bond</b> 3,250 % fällig am 30.04.2034		18.275	<b>Caisse Francaise de Financement Local</b> 3,861 % fällig am 25.02.2025	€	9.600
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 4,662 % fällig am 15.10.2028		15.500	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$	9.015
<b>Austria Government International Bond</b> 4,150 % fällig am 15.03.2037		13.800	<b>Credit Suisse Schweiz AG</b> 3,390 % fällig am 05.12.2025	€	7.700
<b>Netherlands Government International Bond</b> 0,000 % fällig am 15.01.2038		17.100	<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b> 2,748 % fällig am 14.06.2024	£	6.500
<b>Spain Government International Bond</b> 3,450 % fällig am 31.10.2034		11.500	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$	7.535
<b>France Government International Bond</b> 3,250 % fällig am 25.05.2055		11.900	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)		7.423
<b>Netherlands Government International Bond</b> 3,250 % fällig am 15.01.2044		10.000	<b>Credit Suisse AG</b> 5,182 % fällig am 31.05.2024	€	6.800
<b>Netherlands Government International Bond</b> 2,750 % fällig am 15.01.2047		9.400	<b>Europäische Investitionsbank</b> 3,000 % fällig am 15.02.2039		6.700
<b>Hungary Government International Bond</b> 5,500 % fällig am 26.03.2036	\$	9.100	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$	7.290
<b>Romania Government International Bond</b> 6,375 % fällig am 30.01.2034		8.700	<b>Spain Government International Bond</b> 3,550 % fällig am 31.10.2033	€	5.870
<b>Saudi Arabia Government International Bond</b> 5,000 % fällig am 16.01.2034		8.800	<b>BPER Banca</b> 0,625 % fällig am 28.10.2028		6.600
<b>Republic of Poland Government International Bond</b> 5,125 % fällig am 18.09.2034		8.800	<b>Deutsche Bank AG</b> 2,129 % fällig am 24.11.2026	\$	6.600
<b>UBS Switzerland AG</b> 4,056 % fällig am 21.04.2027	€	7.500	<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 1,750 % fällig am 30.05.2024	€	5.300
<b>Austria Government International Bond</b> 3,800 % fällig am 26.01.2062		6.500	<b>Banco di Desio e della Brianza SpA</b> 4,000 % fällig am 13.03.2028		5.000
<b>Europäische Investitionsbank</b> 3,000 % fällig am 15.02.2039		6.700	<b>Slovenia Government International Bond</b> 0,000 % fällig am 12.02.2031		6.100
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$	7.248	<b>Austria Government International Bond</b> 2,900 % fällig am 20.02.2033		4.800
<b>Bank of America Corp.</b> 2,824 % fällig am 27.04.2033	€	6.800	<b>Korea Housing Finance Corp.</b> 0,723 % fällig am 22.03.2025		4.500
<b>NatWest Group PLC</b> 4,771 % fällig am 16.02.2029		6.100	<b>Intesa Sanpaolo SpA</b> 2,125 % fällig am 26.05.2025		4.400
<b>BNP Paribas S.A.</b> 2,750 % fällig am 25.07.2028		6.500	<b>Korea Government International Bond</b> 0,000 % fällig am 16.09.2025		4.400
<b>Santander UK Group Holdings PLC</b> 0,603 % fällig am 13.09.2029		7.200			
<b>ING Groep NV</b> 4,500 % fällig am 23.05.2029		6.100			

(a) Der Euro Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028	€ 27.000	€ 23.856
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,750 % fällig am 15.01.2029	14.200	12.979
Netherlands Government International Bond 0,500 % fällig am 15.07.2032	8.800	7.459
Spain Government International Bond 3,150 % fällig am 30.04.2033	7.200	7.149
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,200 % fällig am 01.03.2034	6.500	6.792
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 09.11.2028	7.100	6.276
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	6.400	6.055
Anheuser-Busch InBev S.A. 3,750 % fällig am 22.03.2037	5.300	5.297
Deutsche Bank AG 4,125 % fällig am 04.04.2030	5.300	5.277
ABN AMRO Bank NV 4,375 % fällig am 20.10.2028	4.700	4.825
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 4,625 % fällig am 13.01.2031	3.800	3.931
Banco BPM SpA 3,250 % fällig am 28.05.2031	3.900	3.875
Intesa Sanpaolo SpA 1,350 % fällig am 24.02.2031	3.800	3.140
Medtronic Global Holdings S.C.A. 3,125 % fällig am 15.10.2031	3.000	2.946
TDF Infrastructure SASU 1,750 % fällig am 01.12.2029	3.200	2.812
Banco Santander S.A. 3,875 % fällig am 22.04.2029	2.700	2.695
Citigroup, Inc. 3,750 % fällig am 14.05.2032	2.700	2.694
Argenta Spaarbank NV 3,125 % fällig am 06.02.2034	2.700	2.680
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,000 % fällig am 30.10.2031	2.500	2.602
LKQ Dutch Bond BV 4,125 % fällig am 13.03.2031	2.600	2.584
Booking Holdings, Inc. 3,750 % fällig am 01.03.2036	2.600	2.572
Amprion GmbH 3,625 % fällig am 21.05.2031	2.500	2.497
Opmobility 4,875 % fällig am 13.03.2029	2.500	2.486
Eni SpA 0,000 % fällig am 10.02.2028	2.400	2.469
Severn Trent Utilities Finance PLC 4,000 % fällig am 05.03.2034	2.400	2.396
Kering S.A. 3,375 % fällig am 11.03.2032	2.300	2.292
Credit Agricole S.A. 4,250 % fällig am 11.07.2029	2.200	2.244
Solvay S.A. 4,250 % fällig am 03.10.2031	2.200	2.195
Wells Fargo & Co. 1,741 % fällig am 04.05.2030	2.400	2.165

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.10.2030	€ 15.400	€ 12.956
<b>AKTIEN</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	96.000	9.584
<b>PARI (000S)</b>		
Ile-de-France Mobilites 3,050 % fällig am 03.02.2033	€ 7.200	7.148
Europäische Investitionsbank 2,250 % fällig am 15.03.2030	6.600	6.487
Treasury Bills des europäischen Stabilitätsmechanismus 0,000 % fällig am 15.03.2027	6.700	6.327
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028	7.000	6.227
BNG Bank NV 3,500 % fällig am 27.09.2038	5.800	5.880
Deutsche Bank AG 4,125 % fällig am 04.04.2030	5.300	5.271
Hamburg Commercial Bank AG 6,250 % fällig am 18.11.2024	4.200	4.195
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,138 % fällig am 14.09.2028	\$ 4.200	3.983
Verizon Communications, Inc. 4,750 % fällig am 31.10.2034	€ 3.600	3.896
ING Groep NV 4,500 % fällig am 23.05.2029	3.700	3.785
Intesa Sanpaolo SpA 4,000 % fällig am 23.09.2029	\$ 3.700	3.135
Orange S.A. 3,875 % fällig am 11.09.2035	€ 2.900	2.995
ABN AMRO Bank NV 2,375 % fällig am 01.06.2027	3.100	2.989
Enel Finance International NV 0,750 % fällig am 17.06.2030	3.500	2.963
Medtronic Global Holdings S.C.A. 3,125 % fällig am 15.10.2031	3.000	2.947
Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % fällig am 13.09.2029	3.300	2.870
BPCE S.A. 0,500 % fällig am 15.09.2027	3.000	2.767
Anheuser-Busch InBev S.A. 3,750 % fällig am 22.03.2037	2.700	2.727
Citigroup, Inc. 3,750 % fällig am 14.05.2032	2.700	2.673
International Development Association 1,750 % fällig am 05.05.2037	3.100	2.659
InterContinental Hotels Group PLC 3,375 % fällig am 08.10.2028	£ 2.400	2.579
Opmobility 4,875 % fällig am 13.03.2029	€ 2.500	2.509
Eni SpA 0,000 % fällig am 10.02.2028	2.400	2.460
Credit Agricole S.A. 1,907 % fällig am 16.06.2026	\$ 2.600	2.307
Nordea Bank Abp 4,125 % fällig am 05.05.2028	€ 2.200	2.247
Metropolitan Life Global Funding 4,000 % fällig am 05.04.2028	2.200	2.242
Bank of America Corp. 2,824 % fällig am 27.04.2033	2.400	2.239

(a) Der Euro Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>					<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 05.04.2024	€	36.230	€ 36.158		Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK) 8,000 % fällig am 31.12.2026	€ 14.300	€ 14.169
Marzio Finance SRL 4,472 % fällig am 28.09.2049		14.900	14.900		ABN AMRO Bank NV 6,575 % fällig am 13.10.2026	\$ 11.200	10.516
Trinity Square PLC 0,000 % fällig am 15.07.2059	£	12.500	14.560		Pacific Gas & Electric Co. 6,950 % fällig am 15.03.2034	9.500	9.391
Towd Point Mortgage Funding PLC 0,000 % fällig am 20.07.2053		12.400	14.505		Nationwide Building Society 6,557 % fällig am 18.10.2027	9.100	8.650
Jubilee Place BV 4,519 % fällig am 17.09.2060	€	14.400	14.400		CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2027	€ 9.300	7.702
Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK) 8,000 % fällig am 31.12.2026		14.300	14.169		Societe Generale S.A. 6,446 % fällig am 10.01.2029	\$ 7.700	7.311
Stratton Mortgage Funding PLC 6,134 % fällig am 28.06.2050	£	12.049	14.062		Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3,000 % fällig am 29.03.2025	€ 6.600	6.159
Towd Point Mortgage Funding PLC 6,634 % fällig am 20.02.2054		11.996	13.997		G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025	6.400	6.014
Stratton Mortgage Funding PLC 0,000 % fällig am 20.06.2060		11.900	13.927		CTP NV 1,250 % fällig am 21.06.2029	7.000	5.852
Market Bidco Ltd. 8,578 % fällig am 04.11.2027	€	13.600	13.211		Balder Finland Oyj 2,000 % fällig am 18.01.2031	6.500	5.174
Stratton Mortgage Funding PLC 0,000 % fällig am 25.06.2049	£	10.100	11.868		Altarea S.C.A. 1,875 % fällig am 17.01.2028	6.000	5.143
Romania Government International Bond 5,250 % fällig am 30.05.2032	€	11.100	10.823		AIB Group PLC 5,250 % fällig am 23.10.2031	4.560	4.826
Tikehau CLO DAC 4,886 % fällig am 15.01.2035		10.000	9.980		U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.08.2043	\$ 5.300	4.818
Volkswagen Leasing GmbH 3,875 % fällig am 11.10.2028		9.500	9.481		Pacific Gas & Electric Co. 6,400 % fällig am 15.06.2033	5.000	4.755
VICI Properties LP 4,625 % fällig am 01.12.2029	\$	10.708	9.324		Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,625 % fällig am 24.09.2024	€ 4.742	4.709
Mortimer BTL PLC 6,403 % fällig am 22.12.2056	£	7.433	8.723		UniCredit SpA 3,127 % fällig am 03.06.2032	\$ 6.000	4.640
Auto ABS Italian Stella Loans SRL 4,372 % fällig am 29.12.2036	€	8.700	8.700		Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 05.04.2024	€ 4.580	4.579
Bayer U.S. Finance LLC 6,125 % fällig am 21.11.2026	\$	8.950	8.376		Nationwide Building Society 4,500 % fällig am 01.11.2026	4.100	4.186
Cumulus Static CLO DAC 5,025 % fällig am 15.11.2033	€	8.200	8.200		Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	5.000	4.178
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. 5,900 % fällig am 25.05.2037	\$	8.922	7.751		Altice France S.A. 3,375 % fällig am 15.01.2028	5.000	3.950
Wells Fargo & Co. 1,741 % fällig am 04.05.2030	€	8.500	7.652		Anheuser-Busch InBev S.A. 3,450 % fällig am 22.09.2031	3.900	3.888
Venture Global LNG, Inc. 9,500 % fällig am 01.02.2029	\$	7.306	7.301		Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	4.400	3.784
Freddie Mac 4,750 % fällig am 25.07.2056		8.200	7.239		Castellum Helsinki Finance Holding Abp 0,875 % fällig am 17.09.2029	4.700	3.708
JPMorgan Chase & Co. 3,761 % fällig am 21.03.2034	€	7.200	7.200		Sandoz Finance BV 4,220 % fällig am 17.04.2030	3.500	3.579
Freddie Mac 4,750 % fällig am 25.11.2057	\$	8.138	7.118		Logicor Financing SARL 1,625 % fällig am 17.01.2030	3.600	3.037
Precise Mortgage Funding PLC 6,190 % fällig am 16.07.2060	£	5.800	6.786		Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 3.600	2.831
Curzon Mortgages PLC 6,983 % fällig am 28.07.2049		5.528	6.580		Volkswagen Leasing GmbH 3,875 % fällig am 11.10.2028	€ 2.700	2.705
GLP Capital LP 5,300 % fällig am 15.01.2029	\$	7.100	6.452		Logicor Financing SARL 1,500 % fällig am 13.07.2026	2.600	2.434
Soundview Home Loan Trust 5,910 % fällig am 25.05.2036		9.007	6.397		Aroundtown S.A. 1,500 % fällig am 28.05.2026	2.000	1.838
Mexico Government International Bond 7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN	120.000	6.315		Atrium Finance PLC 2,625 % fällig am 05.09.2027	2.200	1.787
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,381 % fällig am 13.03.2029	\$	6.800	6.255				
BNP Paribas S.A. 5,738 % fällig am 20.02.2035		6.600	6.151				
Towd Point Mortgage Trust 3,250 % fällig am 25.03.2058		6.617	5.958				
Freddie Mac 3,750 % fällig am 25.09.2055		6.829	5.685				
Commerzbank AG 4,625 % fällig am 17.01.2031	€	5.700	5.679				

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 04.07.2044	€ 55.900	€ 53.832
France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.05.2055	52.900	51.035
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 15.08.2046	48.900	47.153
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,625 % fällig am 10.01.2034	47.100	46.318
France Government International Bond 3,000 % fällig am 25.05.2054	49.600	46.109
France Government International Bond 2,500 % fällig am 25.05.2043	48.100	43.432
France Government International Bond 4,500 % fällig am 25.04.2041	28.700	33.856
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2055	26.200	29.995
Europäische Union 3,000 % fällig am 04.12.2034	24.700	24.362
Bundesrepublik Deutschland 1,250 % fällig am 15.08.2048	29.900	22.717
Netherlands Government International Bond 2,000 % fällig am 15.01.2054	26.600	22.578
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2060	17.000	19.632
France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048	24.600	19.305
Bundesrepublik Deutschland 1,800 % fällig am 15.08.2053	21.900	19.113
Bundesrepublik Deutschland 4,250 % fällig am 04.07.2039	15.000	18.456
France Government International Bond 1,250 % fällig am 25.05.2038	20.700	16.312
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2066	20.300	13.951
Netherlands Government International Bond 3,250 % fällig am 15.01.2044	12.700	13.757
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2053	26.000	13.013
France Government International Bond 3,000 % fällig am 25.06.2049	12.000	11.583
France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.05.2045	11.100	11.135
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 15.08.2054	10.300	10.236

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.10.2038	€ 36.200	€ 40.528
<b>AKTIEN</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	400.200	40.003
<b>PARI (000S)</b>		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 29.186	26.813
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2055	€ 18.950	21.145
France Government International Bond 3,000 % fällig am 25.05.2054	21.550	19.977
Bundesrepublik Deutschland 1,800 % fällig am 15.08.2053	23.100	19.360
Bundesrepublik Deutschland 4,250 % fällig am 04.07.2039	15.600	18.809
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 04.07.2044	13.500	13.555
Bundesrepublik Deutschland 4,750 % fällig am 04.07.2040	9.000	11.879
France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048	13.800	11.088
Netherlands Government International Bond 4,000 % fällig am 15.01.2037	9.100	10.394
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 15.08.2054	10.300	10.297
Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2038	14.100	9.405
France Government International Bond 1,250 % fällig am 25.05.2038	11.900	9.167
Belgium Government International Bond 1,400 % fällig am 22.06.2053	12.300	7.808
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2053	13.800	6.995
Action Logement Services 3,625 % fällig am 25.05.2043	7.000	6.684
Belgium Government International Bond 3,750 % fällig am 22.06.2045	5.400	5.728
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,625 % fällig am 10.01.2034	5.900	5.687
France Government International Bond 3,000 % fällig am 25.06.2049	5.800	5.342
Europäische Investitionsbank 3,000 % fällig am 15.02.2039	4.800	4.651
France Government International Bond 4,500 % fällig am 25.04.2041	3.600	4.236
Slovenia Government International Bond 0,000 % fällig am 12.02.2031	4.600	3.748
Belgium Government International Bond 3,500 % fällig am 22.06.2055	3.600	3.629
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 3,250 % fällig am 18.04.2028	3.600	3.609

(a) Der Euro Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
Bank of Queensland Ltd. 1,839 % fällig am 09.06.2027	€	2.400	€ 2.294	BNZ International Funding Ltd. 0,625 % fällig am 03.07.2025	€	2.700	€ 2.614
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,875 % fällig am 29.05.2026		2.200	2.189	ANZ New Zealand International Ltd. 0,895 % fällig am 23.03.2027		2.000	1.870
Pony S.A., Compartment German Auto Loans 4,270 % fällig am 14.11.2032		1.700	1.707	Deutsche Pfandbriefbank AG 6,223 % fällig am 26.04.2024	£	1.500	1.754
Hill FL BV 4,309 % fällig am 18.02.2032		1.700	1.703	KEB Hana Bank 3,750 % fällig am 04.05.2026	€	1.400	1.414
Fidelity National Information Services, Inc. 1,500 % fällig am 21.05.2027		1.400	1.315	KEB Hana Bank 0,010 % fällig am 26.01.2026		1.400	1.314
Boston Scientific Corp. 0,625 % fällig am 01.12.2027		1.400	1.269	Eika Boligkreditt AS 0,010 % fällig am 12.03.2027		1.100	1.005
Amprion GmbH 3,450 % fällig am 22.09.2027		1.200	1.193	Royal Bank of Canada 0,125 % fällig am 26.04.2027		1.100	1.004
Enel Finance International NV 0,375 % fällig am 17.06.2027		1.300	1.185	UniCredit Bank Austria AG 0,250 % fällig am 04.06.2027		1.100	1.003
Stratton Mortgage Funding PLC 0,000 % fällig am 20.06.2060	£	1.000	1.168	BPCE SFH S.A. 3,125 % fällig am 20.07.2027		1.000	997
Glencore Finance Europe Ltd. 1,500 % fällig am 15.10.2026	€	1.200	1.142	Kookmin Bank 2,375 % fällig am 27.01.2026		1.000	983
UBS Switzerland AG 4,056 % fällig am 21.04.2027		1.100	1.100	PKO Bank Hipoteczny S.A. 2,125 % fällig am 25.06.2025		1.000	979
Toronto-Dominion Bank 4,174 % fällig am 16.02.2027		1.100	1.100	Mitsubishi HC Capital UK PLC 0,250 % fällig am 03.02.2025		1.000	975
Cars Alliance Auto Loans Germany 4,099 % fällig am 18.01.2036		1.100	1.100	Cie de Financement Foncier S.A. 0,375 % fällig am 09.04.2027		1.000	922
Banco di Desio e della Brianza SpA 0,375 % fällig am 24.07.2026		1.100	1.028	Toronto-Dominion Bank 3,250 % fällig am 27.04.2026		900	898
Black Diamond CLO DAC 4,808 % fällig am 15.05.2032		1.025	1.022	Bank of Montreal 1,000 % fällig am 05.04.2026		900	862
Eika Boligkreditt AS 0,010 % fällig am 12.03.2027		1.100	1.006	Sparebanken Soer Boligkreditt A/S 0,010 % fällig am 26.10.2026		900	831
BPCE SFH S.A. 3,125 % fällig am 20.07.2027		1.000	1.006	EnBW International Finance BV 3,625 % fällig am 22.11.2026		700	702
UniCredit Bank Austria AG 0,250 % fällig am 04.06.2027		1.100	1.006	Toyota Motor Finance Netherlands BV 4,000 % fällig am 02.04.2027		600	610
Royal Bank of Canada 0,125 % fällig am 26.04.2027		1.100	1.003	Hamburg Commercial Bank AG 5,538 % fällig am 05.12.2025		600	605
Autonoría Spain 4,300 % fällig am 30.09.2041		1.000	1.003	Robert Bosch GmbH 3,625 % fällig am 02.06.2027		600	603
Revocar UG 4,168 % fällig am 21.02.2037		1.000	1.000	Bavarian Sky S.A. 4,016 % fällig am 20.03.2030		588	589
Compartment VCL 4,068 % fällig am 21.12.2029		1.000	1.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 6,522 % fällig am 14.09.2026	\$	600	559
Silver Arrow S.A. 3,999 % fällig am 15.06.2031		1.000	1.000	American Honda Finance Corp. 6,069 % fällig am 22.11.2024		500	464
Revocar UG 4,228 % fällig am 21.09.2036		950	953	Lseg Netherlands BV 4,125 % fällig am 29.09.2026	€	400	405
ANZ New Zealand International Ltd. 0,895 % fällig am 23.03.2027		1.000	936	NatWest Markets PLC 4,485 % fällig am 09.01.2026		400	402
Toronto-Dominion Bank 0,864 % fällig am 24.03.2027		1.000	935	Norddeutsche Landesbank-Girozentrale 2,875 % fällig am 14.05.2027		400	396
Red & Black Auto Italy SRL 4,646 % fällig am 28.07.2034		912	917	Societe Generale S.A. 1,125 % fällig am 23.01.2025		400	390
Mercedes-Benz International Finance BV 3,919 % fällig am 11.06.2026		900	898	BP Capital Markets PLC 1,573 % fällig am 16.02.2027		400	382
Kinder Morgan, Inc. 2,250 % fällig am 16.03.2027		900	864	DH Europe Finance SARL 0,200 % fällig am 18.03.2026		400	376
Euro-Galaxy CLO DAC 4,626 % fällig am 11.04.2031		842	835	Vodafone Group PLC 0,900 % fällig am 24.11.2026		400	376
Westpac Banking Corp. 1,079 % fällig am 05.04.2027		870	816	Medtronic Global Holdings S.C.A. 1,125 % fällig am 07.03.2027		400	375
				Comcast Corp. 0,250 % fällig am 20.05.2027		400	364
				Deutsche Börse AG 3,875 % fällig am 28.09.2026		300	302
				Orsted AS 3,625 % fällig am 01.03.2026		300	300
				Hamburg Commercial Bank AG 3,625 % fällig am 30.01.2026		300	299

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		KOSTEN		BESCHREIBUNG		ERLÖSE
KÄUFE BIS 30. JUNI 2024	AKTIEN	(000S)		VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024	AKTIEN	(000S)
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (a)	674.500 €	7.366		PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	44.000 €	4.370
	PARI (000S)				PARI (000S)	
Electricite de France S.A. 5,875 % fällig am 22.01.2029	£ 6.400	7.063		Forvia SE 2,750 % fällig am 15.02.2027	€ 4.400	4.169
Telefonica Europe BV 5,752 % fällig am 15.01.2032	€ 5.600	5.600		AT&T, Inc. 2,875 % fällig am 03.02.2025	€ 4.100	4.009
Verisure Holding AB 0,000 % fällig am 27.03.2028	€ 5.300	5.281		Grifols S.A. 3,200 % fällig am 01.05.2025	€ 4.000	3.735
Stonagate Pub Co. Financing PLC 8,250 % fällig am 31.07.2025	£ 3.700	4.237		Gatwick Airport Finance PLC 4,375 % fällig am 07.04.2026	£ 3.200	3.601
British Telecommunications PLC 8,375 % fällig am 20.12.2083	€ 2.900	3.610		Verisure Holding AB 3,250 % fällig am 15.02.2027	€ 3.600	3.444
Bayer AG 4,500 % fällig am 25.03.2082	€ 3.400	3.237		EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 4.300	3.422
Abertis Infraestructuras Finance BV 2,625 % fällig am 26.01.2027	€ 3.300	3.050		Electricite de France S.A. 2,875 % fällig am 15.12.2026	€ 3.600	3.352
iliad S.A. 5,375 % fällig am 02.05.2031	€ 2.900	2.900		Telecom Italia SpA 7,875 % fällig am 31.07.2028	€ 2.800	3.083
EP Infrastructure A/S 1,698 % fällig am 30.07.2026	€ 3.000	2.765		Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 3.300	2.999
Bayer AG 7,000 % fällig am 25.09.2083	€ 2.700	2.721		GTCR W-2 Merger Sub LLC 8,500 % fällig am 15.01.2031	£ 2.200	2.769
Thames Water Utilities Finance PLC 0,875 % fällig am 31.01.2028	€ 3.200	2.720		iliad S.A. 5,375 % fällig am 14.06.2027	€ 2.700	2.761
United Group BV 3,125 % fällig am 15.02.2026	€ 2.800	2.703		Telefonica Europe BV 5,752 % fällig am 15.01.2032	€ 2.700	2.722
Carnival PLC 1,000 % fällig am 28.10.2029	€ 3.400	2.642		Electricite de France S.A. 5,875 % fällig am 22.01.2029	£ 2.300	2.567
INEOS Finance PLC 6,375 % fällig am 15.04.2029	€ 2.600	2.600		Ardagh Packaging Finance PLC 2,125 % fällig am 15.08.2026	€ 3.000	2.530
IMA Industria Macchine Automatiche SpA 7,654 % fällig am 15.04.2029	€ 2.500	2.500		Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025	€ 2.400	2.320
Italmatch Chemicals SpA 10,000 % fällig am 06.02.2028	€ 2.250	2.359		Douglas GmbH 6,000 % fällig am 08.04.2026	€ 2.300	2.318
ContourGlobal Power Holdings S.A. 2,750 % fällig am 01.01.2026	€ 2.400	2.304		TUI AG 5,875 % fällig am 15.03.2029	€ 2.200	2.243
ELO SACA 5,875 % fällig am 17.04.2028	€ 2.300	2.299		Telecom Italia SpA 6,875 % fällig am 15.02.2028	€ 2.000	2.118
Cullinan Holdco SCSp 4,625 % fällig am 15.10.2026	€ 2.600	2.285		Citycon Treasury BV 1,250 % fällig am 08.09.2026	€ 2.300	2.100
IPD BV 7,086 % fällig am 15.06.2031	€ 2.200	2.200		Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 2.100	2.078
Webuild SpA 5,375 % fällig am 20.06.2029	€ 2.200	2.200		CAB SELAS 3,375 % fällig am 01.02.2028	€ 2.300	2.014
Q-Park Holding BV 5,125 % fällig am 15.02.2030	€ 2.200	2.200		Verisure Holding AB 3,875 % fällig am 15.07.2026	€ 2.000	1.965
TUI AG 5,875 % fällig am 15.03.2029	€ 2.200	2.176		Altarea S.C.A. 1,875 % fällig am 17.01.2028	€ 2.200	1.965
Grifols S.A. 3,200 % fällig am 01.05.2025	€ 2.300	2.155		Flutter Treasury Designated Activity Co. 5,000 % fällig am 29.04.2029	€ 1.800	1.828
ELO SACA 6,000 % fällig am 22.03.2029	€ 2.100	2.121		Cullinan Holdco SCSp 4,625 % fällig am 15.10.2026	€ 2.200	1.821
Ahlstrom Holding Oy 4,875 % fällig am 04.02.2028	\$ 2.500	2.116		Bayer AG 7,000 % fällig am 25.09.2083	€ 1.800	1.810
				Unibail-Rodamco-Westfield SE 7,250 % fällig am 03.07.2028	€ 1.700	1.781
				Lorca Telecom Bondco S.A. 4,000 % fällig am 18.09.2027	€ 1.800	1.753
				Telecom Italia SpA 2,375 % fällig am 12.10.2027	€ 1.800	1.656

(a) Der PIMCO European High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		KOSTEN (000S)		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>					
<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)</b>		698.000 €	70.454		
		<b>PARI (000S)</b>			
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 4,662 % fällig am 15.10.2028	€	45.200	45.555		
<b>Europäische Union</b> 3,125 % fällig am 05.12.2028		16.800	16.943		
<b>Europäische Finanzstabilisierungsfazilität</b> 2,625 % fällig am 16.07.2029		15.200	14.985		
<b>Europäische Finanzstabilisierungsfazilität</b> 2,875 % fällig am 13.02.2034		8.500	8.388		
<b>Europäische Union</b> 3,250 % fällig am 04.07.2034		8.100	8.230		
<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b> 2,625 % fällig am 10.01.2034		3.400	3.333		
<b>UBS Switzerland AG</b> 4,056 % fällig am 21.04.2027		3.000	3.000		
<b>Spain Government International Bond</b> 3,450 % fällig am 31.10.2034		2.820	2.815		
<b>Mercedes-Benz International Finance BV</b> 3,919 % fällig am 11.06.2026		2.800	2.795		
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.02.2053	\$	3.000	2.562		
<b>Toronto-Dominion Bank</b> 5,834 % fällig am 11.06.2029	£	2.000	2.350		
<b>Nykredit Realkredit A/S</b> 4,000 % fällig am 01.10.2056	DKK	14.400	1.866		
<b>Romania Government International Bond</b> 5,625 % fällig am 30.05.2037	€	1.100	1.094		
<b>Santander UK Group Holdings PLC</b> 7,482 % fällig am 29.08.2029	£	800	994		
<b>Barclays PLC</b> 4,918 % fällig am 08.08.2030	€	900	923		
<b>Hops Hill PLC</b> 0,000 % fällig am 21.04.2056	£	500	583		
<b>Credit Suisse AG AT1 Claim</b> 1,000 % fällig am 31.12.2060	\$	4.467	473		
<b>United Kingdom Gilt</b> 4,250 % fällig am 07.12.2046	£	400	446		
		<b>AKTIEN</b>			
<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)</b>		4.500	442		
<b>BESCHREIBUNG</b>					
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>					
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	\$	26.350 €	23.684		
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 1,400 % fällig am 26.05.2025	€	20.002	19.753		
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 2,350 % fällig am 15.09.2024		2.974	3.006		
<b>Realkredit Danmark A/S</b> 2,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	29.370	2.955		
<b>Spain Government International Bond</b> 3,250 % fällig am 30.04.2034	€	2.800	2.762		
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.02.2053	\$	3.000	2.577		
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)		2.004	1.811		
<b>Liberty Living Finance PLC</b> 2,625 % fällig am 28.11.2024	£	1.200	1.379		
<b>GN Store Nord A/S</b> 0,875 % fällig am 25.11.2024	€	1.300	1.270		
<b>LeasePlan Corp. NV</b> 3,500 % fällig am 09.04.2025		1.200	1.197		
<b>Harvest CLO DAC</b> 4,756 % fällig am 15.01.2032		1.200	1.190		
<b>Slovenia Government International Bond</b> 1,175 % fällig am 13.02.2062		2.100	1.139		
<b>Santander UK Group Holdings PLC</b> 7,482 % fällig am 29.08.2029	£	800	1.002		
<b>Aurium CLO DAC</b> 4,653 % fällig am 16.01.2031	€	997	991		
<b>Barclays PLC</b> 2,885 % fällig am 31.01.2027		900	882		
		<b>AKTIEN</b>			
<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)</b>		8.500	851		
		<b>PARI (000S)</b>			
<b>Santander UK Group Holdings PLC</b> 6,534 % fällig am 10.01.2029	\$	800	758		
<b>Electricite de France S.A.</b> 2,875 % fällig am 15.12.2026	€	800	747		
<b>Electricite de France S.A.</b> 2,625 % fällig am 01.12.2027		800	724		
<b>Westpac Banking Corp.</b> 3,457 % fällig am 04.04.2025		700	700		

(a) Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	6.518.646	\$ 64.959	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	7.666.781	\$ 76.400
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,500 % fällig am 15.11.2033	\$ 7.800	8.076	<b>Japan Government International Bond</b> 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥ 1.050.000	6.839
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,000 % fällig am 15.02.2034	6.600	6.450	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,375 % fällig am 15.05.2034	\$ 6.300	6.359
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,375 % fällig am 15.05.2034	6.300	6.379	<b>Nordea Kredit Realkreditatieselskab</b> 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 42.878	4.578
<b>Ginnie Mae</b> 3,000 % fällig am 20.05.2052	5.784	4.986	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,500 % fällig am 15.11.2033	\$ 3.900	3.982
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 4,750 % fällig am 15.11.2053	3.600	3.885	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,000 % fällig am 15.02.2034	4.000	3.924
<b>China Government International Bond</b> 2,690 % fällig am 15.08.2032	CNY 27.000	3.804	<b>China Government International Bond</b> 2,690 % fällig am 15.08.2032	CNY 27.000	3.825
<b>China Government International Bond</b> 2,800 % fällig am 15.11.2032	26.200	3.730	<b>China Government International Bond</b> 2,800 % fällig am 15.11.2032	26.200	3.753
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 4,750 % fällig am 15.11.2043	\$ 3.100	3.216	<b>U.S. Treasury Bonds</b> 4,625 % fällig am 15.05.2054	\$ 3.000	3.113
<b>Yorkshire Building Society</b> 3,000 % fällig am 16.04.2031	€ 2.900	3.134	<b>Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara</b> 3,000 % fällig am 30.06.2030	3.500	2.981
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 4,625 % fällig am 15.05.2054	\$ 3.000	3.124	<b>Canada Government International Bond</b> 3,250 % fällig am 01.12.2033	CAD 4.000	2.886
<b>Canada Government International Bond</b> 3,500 % fällig am 01.03.2034	CAD 3.900	2.874	<b>Australia Government International Bond</b> 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD 4.100	2.514
<b>Westpac Banking Corp.</b> 3,131 % fällig am 15.04.2031	€ 2.600	2.822	<b>Deutsche Bank AG</b> 1,625 % fällig am 20.01.2027	€ 2.400	2.464
<b>National Australia Bank Ltd.</b> 3,146 % fällig am 05.02.2031	2.600	2.808	<b>China Government International Bond</b> 2,800 % fällig am 24.03.2029	CNY 14.200	2.026
<b>Singapore Government International Bond</b> 3,250 % fällig am 01.06.2054	SGD 3.539	2.613	<b>China Government International Bond</b> 3,290 % fällig am 23.05.2029	13.500	1.980
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 4,250 % fällig am 15.02.2054	\$ 2.500	2.424	<b>U.S. Treasury Bonds</b> 4,750 % fällig am 15.11.2053	\$ 1.800	1.911
<b>DBS Bank Ltd.</b> 5,784 % fällig am 14.05.2027	£ 1.800	2.247	<b>Societe Generale S.A.</b> 1,488 % fällig am 14.12.2026	2.000	1.866
<b>China Government International Bond</b> 2,800 % fällig am 24.03.2029	CNY 14.200	2.017	<b>Bulgaria Government International Bond</b> 4,375 % fällig am 13.05.2031	€ 1.600	1.800
<b>China Government International Bond</b> 3,290 % fällig am 23.05.2029	13.500	1.971	<b>China Government International Bond</b> 2,800 % fällig am 25.03.2030	CNY 12.100	1.722
<b>Mexico Government International Bond</b> 4,490 % fällig am 25.05.2032	€ 1.800	1.953	<b>Nykredit Realkredit A/S</b> 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 14.811	1.690

(a) Der Global Advantage Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	186.956.101	\$ 1.862.989	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	161.666.930	\$ 1.611.000
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.11.2053	\$ 349.190	357.126	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.11.2053	\$ 247.218	249.964
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2054	296.871	303.034	U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 15.05.2034	192.400	194.191
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.12.2053	284.978	290.741	U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.11.2033	156.410	160.083
U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.11.2033	262.900	272.297	China Government International Bond 2,690 % fällig am 15.08.2032	CNY 906.900	128.447
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2054	243.622	248.826	China Government International Bond 2,800 % fällig am 15.11.2032	879.000	125.717
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2054	237.976	243.001	Canada Government International Bond 3,250 % fällig am 01.12.2033	CAD 170.880	123.658
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.12.2053	237.421	242.493	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.12.2053	\$ 118.484	120.502
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2054	231.363	236.224	Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥ 17.912.450	117.838
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.03.2054	230.775	236.033	Fannie Mae 6,500 % fällig am 01.09.2053	\$ 99.385	101.440
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.11.2053	226.216	231.059	China Government International Bond 2,550 % fällig am 15.10.2028	CNY 680.400	96.085
U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 15.05.2034	192.400	194.805	U.S. Treasury Bonds 4,625 % fällig am 15.05.2054	\$ 90.700	94.099
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.02.2034	186.700	182.454	U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.02.2034	93.400	91.769
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.03.2052	186.958	160.187	Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD 146.900	90.065
U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.11.2053	137.050	148.195	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 785.458	88.724
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.04.2025	DKK 1.034.500	146.027	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052	\$ 81.413	78.379
China Government International Bond 2,690 % fällig am 15.08.2032	CNY 906.900	127.726	Australia Government International Bond 4,500 % fällig am 21.04.2033	AUD 108.700	74.921
China Government International Bond 2,800 % fällig am 15.11.2032	879.000	124.912	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.10.2053	\$ 73.526	74.878
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.04.2052	\$ 142.644	122.621	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.04.2054	73.369	74.802
U.S. Treasury Bonds 4,625 % fällig am 15.05.2054	112.800	117.454	U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.11.2053	68.500	72.712
U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.11.2043	100.000	103.742	China Government International Bond 2,800 % fällig am 24.03.2029	CNY 478.000	68.215
			China Government International Bond 3,290 % fällig am 23.05.2029	454.400	66.648
			China Government International Bond 2,800 % fällig am 25.03.2030	406.700	57.880
			China Government International Bond 2,600 % fällig am 15.09.2030	382.400	53.878
			Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 499.509	53.387

(a) Der Global Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2054	\$	158.696	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 15.04.2024	¥	10.000.000
U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.11.2033		98.000	U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.11.2033	\$	65.400
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.03.2054		75.538	U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 15.05.2034		52.900
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,800 % fällig am 15.04.2026	€	70.200	Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053		49.406
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.11.2053	\$	72.993	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052		49.881
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 15.04.2024	¥	10.000.000	Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥	6.820.000
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.12.2053	\$	64.294	U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.11.2043	\$	35.000
U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.11.2043		60.900	China Government International Bond 2,690 % fällig am 15.08.2032	CNY	242.000
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.03.2052		70.100	China Government International Bond 2,800 % fällig am 15.11.2032		234.500
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.12.2053		53.996	Canada Government International Bond 3,250 % fällig am 01.12.2033	CAD	45.600
U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 15.05.2034		52.900	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.10.2053	\$	30.010
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.02.2034		44.600	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.11.2053		26.753
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2054		38.996	U.S. Treasury Bonds 4,625 % fällig am 15.05.2054		24.900
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.11.2053		37.996	Deutsche Bank AG 3,961 % fällig am 26.11.2025		24.200
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.10.2053		37.996	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.04.2054		23.155
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.11.2053		37.996	China Government International Bond 2,550 % fällig am 15.10.2028	CNY	159.500
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2054		37.996	U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.02.2034	\$	22.300
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2054		37.996	China Government International Bond 2,800 % fällig am 24.03.2029	CNY	127.500
China Government International Bond 2,690 % fällig am 15.08.2032	CNY	242.000	China Government International Bond 3,290 % fällig am 23.05.2029		121.200
China Government International Bond 2,800 % fällig am 15.11.2032		234.500	Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.01.2053	\$	17.685
U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.11.2053	\$	30.200	Freddie Mac 5,000 % fällig am 01.04.2053		16.498
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2054		30.997	U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.11.2053		15.100
Japan Government International Bond 1,800 % fällig am 20.03.2054	¥	4.527.000	China Government International Bond 2,800 % fällig am 25.03.2030	CNY	108.500
U.S. Treasury Bonds 4,625 % fällig am 15.05.2054	\$	25.700	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.07.2053	\$	15.916
			China Government International Bond 2,600 % fällig am 15.09.2030	CNY	102.000
			Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.04.2054	\$	13.924
			Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.05.2053		14.557
			Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	CAD	19.300
			Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.12.2053	\$	12.998
			Deutsche Bank AG 4,125 % fällig am 04.04.2030	€	11.800

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	37.110.341	\$ 369.797	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	33.928.658	\$ 338.100
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.12.2053	\$ 46.007	46.949	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.10.2053	\$ 30.511	31.072
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.10.2053	38.564	39.284	China Government International Bond 2,440 % fällig am 15.10.2027	CNY 149.740	20.931
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2054	27.192	27.764	Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	CAD 18.800	13.000
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2054	15.898	16.239	China Government International Bond 2,550 % fällig am 15.10.2028	CNY 91.200	12.825
U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.11.2033	14.900	15.428	U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 15.05.2034	\$ 12.200	12.315
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.12.2053	14.999	15.320	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.04.2053	11.517	11.087
Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	CAD 18.800	12.999	South Korea Government International Bond 2,375 % fällig am 10.12.2028	KRW 13.776.070	9.570
China Government International Bond 2,550 % fällig am 15.10.2028	CNY 91.200	12.836	Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥ 1.320.000	8.622
U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 15.05.2034	\$ 12.200	12.353	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.10.2052	\$ 9.221	8.580
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.02.2034	10.400	10.163	Canada Government International Bond 3,250 % fällig am 01.12.2033	CAD 10.900	7.886
Province of Ontario 3,650 % fällig am 02.06.2033	CAD 13.400	9.572	U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.11.2033	\$ 7.500	7.658
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.10.2052	\$ 9.221	8.619	Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD 12.200	7.480
Japan Government International Bond 1,800 % fällig am 20.03.2054	¥ 1.273.000	7.929	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.10.2052	\$ 8.034	7.475
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.10.2052	\$ 8.034	7.509	China Government International Bond 2,690 % fällig am 15.08.2032	CNY 49.000	6.937
U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.11.2053	6.900	7.449	China Government International Bond 2,800 % fällig am 15.11.2032	47.500	6.788
Province of Quebec 3,600 % fällig am 01.09.2033	CAD 10.400	7.092	U.S. Treasury Bonds 4,625 % fällig am 15.05.2054	\$ 5.800	6.018
China Government International Bond 2,690 % fällig am 15.08.2032	CNY 49.000	6.903	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.04.2054	5.701	5.812
China Government International Bond 2,800 % fällig am 15.11.2032	47.500	6.762	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.09.2052	5.964	5.550
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.03.2052	\$ 7.333	6.355	U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.02.2034	5.200	5.109

(a) Der Global Bond Ex-US Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		KOSTEN		BESCHREIBUNG		ERLÖSE
KÄUFE BIS 30. JUNI 2024	AKTIEN	(000S)		VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024	AKTIEN	(000S)
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	86.845.969	\$	865.427	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	76.236.816	\$ 759.700
	<b>PARI</b>				<b>PARI</b>	
	<b>(000S)</b>				<b>(000S)</b>	
<b>Bayer AG</b>				<b>Telecom Italia SpA</b>		
7,000 % fällig am 25.09.2083	€	15.300	16.607	7,875 % fällig am 31.07.2028	€	14.800 17.621
<b>Verisure Holding AB</b>				<b>TransDigm, Inc.</b>		
0,000 % fällig am 27.03.2028		14.200	15.424	4,625 % fällig am 15.01.2029	\$	18.600 17.187
<b>Jane Street Group</b>				<b>Harbour Energy PLC</b>		
7,125 % fällig am 30.04.2031	\$	13.700	13.700	5,500 % fällig am 15.10.2026		17.300 16.920
<b>Ardagh Packaging Finance PLC</b>				<b>United Group BV</b>		
2,125 % fällig am 15.08.2026	€	13.544	13.380	3,625 % fällig am 15.02.2028	€	15.500 16.105
<b>Abertis Infraestructuras Finance BV</b>				<b>TK Elevator Midco GmbH</b>		
2,625 % fällig am 26.01.2027		12.400	12.490	4,375 % fällig am 15.07.2027		14.400 15.121
<b>Block, Inc.</b>				<b>Lorca Telecom Bondco S.A.</b>		
6,500 % fällig am 15.05.2032	\$	12.475	12.475	4,000 % fällig am 18.09.2027		14.000 14.727
<b>Newmark Group, Inc.</b>				<b>CAB SELAS</b>		
7,500 % fällig am 12.01.2029		11.900	11.959	3,375 % fällig am 01.02.2028		14.075 13.900
<b>U.S. Acute Care Solutions LLC</b>				<b>Catalent Pharma Solutions, Inc.</b>		
9,750 % fällig am 15.05.2029		12.000	11.769	2,375 % fällig am 01.03.2028		13.300 13.567
<b>Caesars Entertainment, Inc.</b>				<b>Grifols S.A.</b>		
8,097 % fällig am 06.02.2031		10.940	10.913	3,875 % fällig am 15.10.2028		14.800 13.360
<b>Service Properties Trust</b>				<b>Ardagh Packaging Finance PLC</b>		
8,375 % fällig am 15.06.2029		10.750	10.643	2,125 % fällig am 15.08.2026		13.544 12.462
<b>Sotera Health Holdings LLC</b>				<b>Mundys SpA</b>		
8,594 % fällig am 30.05.2031		10.625	10.572	1,875 % fällig am 12.02.2028		12.500 12.332
<b>Ladder Capital Finance Holdings LLLP</b>				<b>Electricite de France S.A.</b>		
4,750 % fällig am 15.06.2029		11.500	10.539	9,125 % fällig am 15.03.2033	\$	10.675 11.649
<b>Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.</b>				<b>Cerba Healthcare SACA</b>		
7,875 % fällig am 01.04.2030		10.525	10.525	3,500 % fällig am 31.05.2028	€	12.050 11.256
<b>Rand Parent LLC</b>				<b>Freedom Mortgage Corp.</b>		
8,500 % fällig am 15.02.2030		10.400	10.345	12,000 % fällig am 01.10.2028	\$	10.299 11.163
<b>DaVita, Inc.</b>				<b>Cheplapharm Arzneimittel GmbH</b>		
3,750 % fällig am 15.02.2031		12.000	10.134	4,375 % fällig am 15.01.2028	€	10.800 11.104
<b>Panther Escrow Issuer LLC</b>				<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>		
7,125 % fällig am 01.06.2031		10.000	10.000	4,000 % fällig am 13.11.2030	\$	12.000 10.725
<b>Castellum AB</b>				<b>Clarios Global LP</b>		
3,125 % fällig am 02.12.2026	€	10.400	9.434	4,375 % fällig am 15.05.2026	€	10.000 10.718
<b>Al Silk Midco Ltd.</b>				<b>DaVita, Inc.</b>		
8,785 % fällig am 04.03.2031		8.800	9.239	4,625 % fällig am 01.06.2030	\$	12.000 10.590
<b>ADT Security Corp.</b>				<b>Verisure Holding AB</b>		
4,875 % fällig am 15.07.2032	\$	10.058	9.215	3,250 % fällig am 15.02.2027	€	10.000 10.437

(a) Der Global High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>
<b>CCO Holdings LLC</b> 4,250 % fällig am 01.02.2031	\$	200	\$ 163	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.
<b>Verisure Holding AB</b> 5,500 % fällig am 15.05.2030	€	125	136	
<b>ZF North America Capital, Inc.</b> 6,750 % fällig am 23.04.2030	\$	125	128	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.
<b>Block, Inc.</b> 6,500 % fällig am 15.05.2032		125	127	
<b>United Rentals North America, Inc.</b> 6,125 % fällig am 15.03.2034		125	124	
<b>IQVIA, Inc.</b> 2,250 % fällig am 15.03.2029	€	125	121	
<b>Forvia SE</b> 2,375 % fällig am 15.06.2029		125	120	
<b>Vmed O2 UK Financing PLC</b> 3,250 % fällig am 31.01.2031		125	118	
<b>B.C. Unlimited Liability Co.</b> 3,875 % fällig am 15.01.2028	\$	125	117	
<b>Kronos International, Inc.</b> 9,500 % fällig am 15.03.2029	€	100	116	
<b>INEOS Quattro Finance PLC</b> 8,500 % fällig am 15.03.2029		100	113	
<b>TDC Net A/S</b> 6,500 % fällig am 01.06.2031		100	113	
<b>Nidda Healthcare Holding GmbH</b> 7,500 % fällig am 21.08.2026		100	111	
<b>Bayer AG</b> 7,000 % fällig am 25.09.2083		100	110	
<b>Lorca Telecom Bondco S.A.</b> 5,750 % fällig am 30.04.2029		100	110	
<b>Telefonica Europe BV</b> 5,752 % fällig am 15.01.2032		100	109	
<b>Loarre Investments SARL</b> 6,500 % fällig am 15.05.2029		100	109	
<b>Coty, Inc.</b> 4,500 % fällig am 15.05.2027		100	108	
<b>Eramet S.A.</b> 6,500 % fällig am 30.11.2029		100	108	
<b>Schaeffler AG</b> 4,750 % fällig am 14.08.2029		100	107	
<b>Mundys SpA</b> 4,750 % fällig am 24.01.2029		100	107	
<b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b> 4,750 % fällig am 15.03.2029		100	107	
<b>UniCredit SpA</b> 7,296 % fällig am 02.04.2034	\$	100	102	
<b>EDP - Energias de Portugal S.A.</b> 1,875 % fällig am 02.08.2081	€	100	101	
<b>Standard Industries, Inc.</b> 2,250 % fällig am 21.11.2026		100	101	
<b>BCP Modular Services Finance PLC</b> 4,750 % fällig am 30.11.2028		100	99	
<b>Nexi SpA</b> 2,125 % fällig am 30.04.2029		100	97	
<b>CAB SELAS</b> 3,375 % fällig am 01.02.2028		100	96	
<b>Sirius XM Radio, Inc.</b> 5,000 % fällig am 01.08.2027	\$	100	95	
<b>Castellum AB</b> 3,125 % fällig am 02.12.2026	€	100	94	
<b>PennyMac Financial Services, Inc.</b> 5,750 % fällig am 15.09.2031	\$	100	94	
<b>Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC</b> 2,000 % fällig am 01.09.2028	€	100	94	
<b>Live Nation Entertainment, Inc.</b> 3,750 % fällig am 15.01.2028	\$	100	93	
<b>WMG Acquisition Corp.</b> 3,750 % fällig am 01.12.2029		100	90	
<b>Cerba Healthcare SACA</b> 3,500 % fällig am 31.05.2028	€	100	90	

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)	
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	131.071.773	\$ 1.306.090	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	183.981.921	\$ 1.833.400	
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>		
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,625 % fällig am 30.04.2029	\$	188.200	187.918	\$	188.200	189.313
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)		107.140	106.604		183.662	127.133
<b>UBS Group AG</b> 9,016 % fällig am 15.11.2033		77.200	93.275		139.903	117.441
<b>Las Vegas Sands Corp.</b> 5,900 % fällig am 01.06.2027		51.200	51.133		100.444	98.879
<b>United Kingdom Gilt</b> 4,375 % fällig am 31.07.2054	£	32.890	41.546		105.800	77.698
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,000 % fällig am 01.05.2054	\$	41.459	39.914		64.200	66.482
<b>BNP Paribas S.A.</b> 5,738 % fällig am 20.02.2035		30.938	30.962		58.990	57.734
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 4,250 % fällig am 15.02.2054		30.700	29.296		67.320	49.289
<b>Boeing Co.</b> 6,858 % fällig am 01.05.2054		28.600	28.600		35.579	35.429
<b>Israel Government International Bond</b> 5,375 % fällig am 12.03.2029		21.700	21.585	ZAR	620.600	33.336
<b>Citigroup, Inc.</b> 5,449 % fällig am 11.06.2035		21.500	21.500		610.600	32.799
<b>UniCredit SpA</b> 5,375 % fällig am 16.04.2034	€	18.900	20.603	\$	30.700	29.012
<b>BNP Paribas S.A.</b> 2,871 % fällig am 19.04.2032	\$	23.200	19.482		34.754	28.599
<b>Lorca Telecom Bondco S.A.</b> 5,750 % fällig am 30.04.2029	€	17.700	18.827		38.663	28.189
<b>Athene Global Funding</b> 5,516 % fällig am 25.03.2027	\$	18.500	18.500		25.900	26.088
<b>ING Groep NV</b> 5,550 % fällig am 19.03.2035		18.400	18.400		25.400	24.966
<b>Aviation Capital Group LLC</b> 5,375 % fällig am 15.07.2029		17.400	17.269	€	18.600	22.242
<b>Enel Finance International NV</b> 5,125 % fällig am 26.06.2029		17.400	17.205	£	19.060	22.023
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.12.2052		18.349	17.151	\$	21.000	20.150

(a) Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,000 % fällig am 01.03.2054	\$	47.576	\$ 46.266	<b>U.S. Treasury Bonds</b> 2,375 % fällig am 15.02.2042	\$	58.900	\$ 41.422
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 3,000 % fällig am 15.08.2048		58.700	44.845	<b>U.S. Treasury Bonds</b> 4,750 % fällig am 15.11.2043		33.800	34.955
<b>United Kingdom Gilt</b> 4,375 % fällig am 31.07.2054	£	24.930	31.108	<b>U.S. Treasury Bonds</b> 3,000 % fällig am 15.08.2048		45.800	34.247
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 3,000 % fällig am 15.02.2048	\$	26.700	20.599	<b>U.S. Treasury Bonds</b> 3,250 % fällig am 15.05.2042		38.800	31.451
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 3,125 % fällig am 15.05.2048		24.400	19.284	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,250 % fällig am 31.05.2025		30.800	30.668
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 4,000 % fällig am 15.11.2042		17.600	16.055	<b>U.S. Treasury Bonds</b> 2,000 % fällig am 15.11.2041		39.500	26.162
<b>Province of Ontario</b> 4,100 % fällig am 04.03.2033	CAD	15.500	11.441	<b>Europäische Union</b> 2,750 % fällig am 04.12.2037	€	25.300	25.785
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 1,875 % fällig am 15.02.2041	\$	13.050	9.025	<b>U.S. Treasury Bonds</b> 2,250 % fällig am 15.05.2041	\$	32.500	23.861
<b>France Government International Bond</b> 3,000 % fällig am 25.06.2049	€	8.600	8.610	<b>U.S. Treasury Bonds</b> 4,000 % fällig am 15.11.2042		25.000	23.023
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,000 % fällig am 01.04.2054	\$	8.092	7.851	<b>U.S. Treasury Bonds</b> 3,125 % fällig am 15.05.2048		24.400	18.693
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,500 % fällig am 01.03.2054		7.548	7.143	<b>U.S. Treasury Bonds</b> 1,875 % fällig am 15.02.2041		26.100	18.073
<b>Volkswagen Leasing GmbH</b> 4,000 % fällig am 11.04.2031	€	5.500	5.984	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,250 % fällig am 30.06.2029		7.700	7.116
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,000 % fällig am 01.01.2054	\$	5.890	5.802	<b>Niederlandse Waterschapsbank NV</b> 3,000 % fällig am 20.04.2033	€	6.500	7.033
<b>Northern States Power Co.</b> 5,400 % fällig am 15.03.2054		5.800	5.778	<b>Europäische Union</b> 1,250 % fällig am 04.02.2043		8.000	6.112
<b>Air Products and Chemicals, Inc.</b> 4,600 % fällig am 08.02.2029		5.500	5.493	<b>Netherlands Government International Bond</b> 2,500 % fällig am 15.07.2033		5.600	6.040
<b>Eurogrid GmbH</b> 3,598 % fällig am 01.02.2029	€	4.900	5.334	<b>Volkswagen Leasing GmbH</b> 4,000 % fällig am 11.04.2031		5.500	5.978
<b>Green Storm BV</b> 4,190 % fällig am 22.02.2071		4.700	5.117	<b>Air Products and Chemicals, Inc.</b> 4,600 % fällig am 08.02.2029	\$	5.500	5.425
<b>P3 Group SARL</b> 4,625 % fällig am 13.02.2030		4.775	5.108	<b>Protective Life Global Funding</b> 6,422 % fällig am 11.12.2024		5.000	5.020
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,500 % fällig am 01.05.2054	\$	5.346	5.009	<b>ERAC USA Finance LLC</b> 3,800 % fällig am 01.11.2025		5.000	4.874
<b>Green Lion BV</b> 0,000 % fällig am 23.10.2060	€	4.600	4.922	<b>Europäische Union</b> 2,625 % fällig am 04.02.2048	€	5.160	4.863

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)		
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	25.347.842	\$ 252.592	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	25.177.705	\$ 250.900		
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>			
<b>France Government International Bond</b> 0,100 % fällig am 01.03.2025	€	83.855	88.330	<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 2,350 % fällig am 15.09.2024	€	57.234	62.002
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 2,375 % fällig am 15.10.2028 (b)	\$	27.963	28.705	<b>France Government International Bond</b> 0,100 % fällig am 01.03.2025		57.714	61.473
<b>United Kingdom Gilt</b> 0,125 % fällig am 22.03.2029	£	18.155	22.941	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	\$	57.206	56.382
<b>Europäische Union</b> 3,000 % fällig am 04.12.2034	€	19.400	20.539	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)		47.957	46.703
<b>Europäische Union</b> 3,125 % fällig am 05.12.2028		17.000	18.313	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)		47.193	46.041
<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b> 2,625 % fällig am 10.01.2034		16.000	17.033	<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 1,400 % fällig am 26.05.2025	€	40.964	43.368
<b>United Kingdom Gilt</b> 4,500 % fällig am 07.06.2028	£	13.300	16.731	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$	27.720	26.473
<b>Europäische Finanzstabilisierungsfazilität</b> 2,625 % fällig am 16.07.2029	€	15.400	16.263	<b>Europäische Union</b> 3,000 % fällig am 04.12.2034	€	19.400	20.562
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	\$	17.424	15.911	<b>United Kingdom Gilt</b> 1,625 % fällig am 22.10.2028	£	13.300	14.907
<b>Bundesrepublik Deutschland</b> 0,100 % fällig am 15.04.2026	€	14.595	15.384	<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 1,500 % fällig am 15.05.2029	€	13.562	14.695
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)	\$	16.027	15.383	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	\$	11.313	10.992
<b>France Government International Bond</b> 0,100 % fällig am 01.03.2029	€	13.947	14.687	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)		11.313	10.988
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 1,250 % fällig am 15.04.2028 (b)	\$	14.639	14.317	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)		11.205	10.973
<b>United Kingdom Gilt</b> 4,125 % fällig am 22.07.2029	£	9.200	11.515	<b>United Kingdom Gilt</b> 0,875 % fällig am 22.10.2029	£	9.700	10.289
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 1,800 % fällig am 15.05.2036	€	10.048	10.899	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	\$	9.183	8.713
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b> 4,662 % fällig am 15.10.2028		9.900	10.849	<b>Nykredit Realkredit A/S</b> 1,500 % fällig am 01.10.2052	DKK	74.872	8.482
<b>United Kingdom Gilt</b> 0,875 % fällig am 22.10.2029	£	9.700	10.419	<b>Nykredit Realkredit A/S</b> 3,000 % fällig am 01.10.2053		48.888	6.416
<b>Europäische Finanzstabilisierungsfazilität</b> 2,875 % fällig am 13.02.2034	€	8.600	9.065	<b>UniCredit SpA</b> 3,375 % fällig am 31.01.2027	€	4.100	4.381
<b>Europäische Union</b> 3,250 % fällig am 04.07.2034		8.200	8.900	<b>Europäische Union</b> 3,125 % fällig am 05.12.2028		4.000	4.302

(a) Der Global Low Duration Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	76.319.416	\$ 760.516
	<b>PARI (000S)</b>	
Europäische Union 3,000 % fällig am 04.12.2034	€ 41.900	44.360
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)	\$ 41.203	39.152
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,625 % fällig am 10.01.2034	€ 35.000	37.259
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,662 % fällig am 15.10.2028	20.100	22.028
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 2,875 % fällig am 13.02.2034	18.700	19.712
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 21.669	19.703
Bundesrepublik Deutschland 0,100 % fällig am 15.04.2033	€ 13.374	14.072
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.10.2028 (b)	\$ 12.647	12.762
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,800 % fällig am 15.05.2036	€ 10.450	11.321
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)	\$ 11.235	11.181
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.03.2050	£ 10.177	10.232
Europäische Investitionsbank 3,000 % fällig am 15.02.2039	€ 8.900	9.555
Cars Alliance Auto Loans Germany 4,099 % fällig am 18.01.2036	7.400	8.032
Revocar UG 4,168 % fällig am 21.02.2037	6.900	7.489
Auto ABS French Loans 4,148 % fällig am 24.07.2036	6.700	7.250
SC Germany S.A. Compartment Consumer 4,280 % fällig am 14.01.2038	6.300	6.749
BPCE Consumer Loans FCT 4,496 % fällig am 31.10.2042	6.300	6.728
E-Carat DE 0,000 % fällig am 25.11.2035	5.800	6.196
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.02.2054 (b)	\$ 5.697	5.604

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	78.625.813	\$ 783.500
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	\$ 39.902	35.070
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	32.495	31.607
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	23.808	23.558
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 14.398	19.026
United Kingdom Inflation-Linked Gilt 2,500 % fällig am 17.07.2024	3.700	17.794
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	\$ 17.183	17.082
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2033 (b)	17.528	16.640
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	€ 10.842	11.084
Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 84.898	9.443
Europäische Investitionsbank 3,000 % fällig am 15.02.2039	€ 8.900	9.344
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,250 % fällig am 15.09.2032	6.517	6.978
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 55.500	6.360
Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	50.768	5.814
Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2053	49.038	5.804
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % fällig am 01.10.2053	35.425	3.943
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,500 % fällig am 01.10.2043	26.666	3.106
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2052	\$ 3.121	2.905
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.09.2052	3.111	2.895
Friary PLC 5,783 % fällig am 21.10.2071	£ 2.200	2.812

(a) Der Global Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	418.045.083	\$ 4.165.760
	<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,500 % fällig am 15.04.2027	\$ 1.673.100	1.660.615
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,500 % fällig am 31.03.2026	1.661.900	1.648.274
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,000 % fällig am 01.09.2053	722.907	713.048
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.02.2054	413.623	422.019
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,000 % fällig am 01.10.2053	324.293	319.795
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.12.2053	299.000	304.778
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.03.2054	287.982	294.157
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.01.2054	280.747	285.846
<b>U.S. Treasury STRIPS</b> 0,000 % fällig am 15.05.2026	300.000	271.014
<b>U.S. Treasury STRIPS</b> 0,000 % fällig am 15.02.2027	300.000	263.343
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.01.2054	236.443	240.996
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.03.2054	203.670	208.239
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.12.2053	196.563	200.539
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.11.2053	187.369	191.380
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.12.2053	182.585	186.408
<b>U.S. Treasury STRIPS</b> 0,000 % fällig am 15.08.2026	200.000	178.976
<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b> 0,000 % fällig am 20.07.2053	£ 136.700	169.993
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.11.2053	\$ 141.416	144.100
<b>Mexico Government International Bond</b> 7,500 % fällig am 03.06.2027	MXN 2.342.500	132.609

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	301.174.552	\$ 3.001.171
	<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 1.343.858	1.341.789
<b>Fannie Mae</b> 6,500 % fällig am 01.09.2053	1.298.051	1.324.852
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,000 % fällig am 01.09.2053	786.553	788.520
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	543.471	543.557
<b>Fannie Mae</b> 3,000 % fällig am 01.05.2052	595.552	508.266
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 3,000 % fällig am 01.07.2052	361.009	308.098
<b>Ginnie Mae</b> 5,500 % fällig am 20.07.2053	304.536	303.870
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,500 % fällig am 01.08.2053	284.231	281.611
<b>Ginnie Mae</b> 5,500 % fällig am 20.08.2053	269.145	268.546
<b>Freddie Mac</b> 3,000 % fällig am 01.07.2052	260.986	222.736
<b>Israel Government International Bond</b> 5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 192.800	213.040
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.02.2053	\$ 184.121	171.553
<b>Freddie Mac</b> 5,000 % fällig am 01.08.2053	166.096	162.248
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.05.2053	163.399	152.330
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.02.2053	160.452	149.526
<b>Russia Government International Bond</b> 7,150 % fällig am 12.11.2025	RUB 20.520.713	135.460
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.07.2053	\$ 144.535	134.518
<b>Freddie Mac</b> 3,000 % fällig am 01.09.2052	141.501	120.762
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.10.2053	112.211	114.231

(a) Der Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	7.557.196	\$ 75.306	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	7.546.606	\$ 75.200
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 31.03.2026	\$ 11.400	11.315	U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 31.01.2031	\$ 9.800	9.598
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.02.2054	10.864	10.955	U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 30.06.2029	6.800	6.700
U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.04.2027	11.000	10.930	U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 28.02.2029	3.300	3.270
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 31.01.2031	9.800	9.760	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.02.2053	3.064	2.780
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)	8.501	8.115	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	2.253	2.249
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2054	7.773	7.440	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.05.2052	1.695	1.492
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.12.2053	7.168	7.332	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	596	596
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 30.06.2029	6.800	6.708	U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.03.2029	500	455
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2054	5.200	5.318	TransDigm, Inc. 6,750 % fällig am 15.08.2028	300	303
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.04.2054	5.133	5.026	GTCR W Merger Sub LLC 8,335 % fällig am 31.01.2031	250	251
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.04.2054	4.300	4.393	Poseidon Bidco SASU 9,175 % fällig am 30.09.2028	€ 200	219
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 28.02.2029	3.300	3.285	Fannie Mae 3,500 % fällig am 14.01.2045	\$ -	-
Great Hall Mortgages PLC 5,813 % fällig am 18.06.2038	£ 2.400	2.916	(a) Der Income Fund II legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.04.2054	\$ 2.577	2.399	(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
SLM Student Loan Trust 4,282 % fällig am 25.10.2039	€ 2.309	2.333	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
Marzio Finance SRL 4,685 % fällig am 28.05.2049	2.000	2.189	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Stratton Hawksmoor PLC 6,733 % fällig am 25.02.2053	£ 1.700	2.125			
Trinity Square PLC 0,000 % fällig am 15.07.2059	1.700	2.121			
Great Hall Mortgages PLC 5,653 % fällig am 18.06.2039	1.500	1.847			

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)		
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.537.643	\$ 45.218	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.592.949	\$ 45.770		
			Invesco Physical Gold ETC	45.092	9.587		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2034 (b)	\$	PARI (000S) 7.899	7.823	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2034 (b)	\$	PARI (000S) 8.047	7.855
Invesco Physical Gold ETC		AKTIEN 27.660	6.184	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2033	€	4.348	4.123
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,800 % fällig am 15.05.2036	€	PARI (000S) 3.682	3.989	Invesco Physical Gold ETC		AKTIEN 19.960	4.003
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.12.2052	\$	2.975	2.780	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.12.2052	\$	PARI (000S) 2.975	2.768
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.10.2028 (b)		1.606	1.644	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)		2.340	2.237
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.02.2054 (b)		600	590	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)		2.410	2.126
				U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)		1.410	1.346
Welltower, Inc.		AKTIEN 4.700	446	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	10.067	1.120
Federal Realty Investment Trust		1.100	109	United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.11.2042	£	888	1.016
Healthpeak Properties, Inc.		5.500	106	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	€	953	974
				United Kingdom Gilt 4,125 % fällig am 22.07.2030	£	200	870
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)	\$	PARI (000S) 100	100	Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	7.434	827
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.07.2053		100	93	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050		6.606	752
				Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050		6.292	700
Healthcare Realty Trust, Inc.		AKTIEN 5.100	84	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2046 (b)	\$	780	617
Regency Centers Corp.		1.100	70	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2052	DKK	4.000	456
Kimco Realty Corp.		3.400	64	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2051	£	488	438
Extra Space Storage, Inc.		400	63	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2039		382	420
Marathon Oil Corp.		1.800	51				
Highwoods Properties, Inc.		2.100	49				
COPT Defense Properties		1.900	46				
Americold Realty Trust, Inc.		1.800	45				

(a) Der Inflation Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,875 % fällig am 31.05.2026	\$	142.600	\$ 142.697	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,250 % fällig am 30.06.2029	\$	148.100	\$ 137.578
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,250 % fällig am 31.01.2026		111.500	111.020	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,250 % fällig am 31.01.2026		111.500	110.274
		<b>AKTIEN</b>				<b>AKTIEN</b>	
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>		10.113.393	100.780	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>		9.984.850	99.500
		<b>PARI (000S)</b>				<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,500 % fällig am 31.03.2026	\$	69.000	68.502	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,250 % fällig am 31.12.2024	\$	86.300	85.804
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,250 % fällig am 31.12.2024		21.000	20.882	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,500 % fällig am 31.03.2026		69.000	68.540
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,250 % fällig am 31.05.2025		19.800	19.682	<b>U.S. Treasury Notes</b> 5,000 % fällig am 31.08.2025		47.600	47.864
<b>Brazil Letras do Tesouro Nacional</b> 0,000 % fällig am 01.04.2025	BRL	77.400	13.229	<b>U.S. Treasury Notes</b> 5,000 % fällig am 30.09.2025		42.000	42.259
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,250 % fällig am 30.06.2029	\$	8.300	7.711	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,250 % fällig am 31.05.2025		39.600	39.365
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)		5.503	5.006	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,750 % fällig am 31.07.2025		39.300	39.360
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)		5.161	4.857	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,375 % fällig am 30.11.2028		31.200	31.527
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,875 % fällig am 30.04.2026		4.600	4.589	<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,875 % fällig am 30.11.2025		27.600	27.765
<b>Republic of Poland Government International Bond</b> 4,625 % fällig am 18.03.2029		2.400	2.382	<b>U.S. Treasury Notes</b> 0,250 % fällig am 31.05.2025		27.900	26.320
<b>AbbVie, Inc.</b> 4,800 % fällig am 15.03.2027		2.200	2.197	<b>Brazil Letras do Tesouro Nacional</b> 0,000 % fällig am 01.07.2024	BRL	71.800	13.252
<b>Morgan Stanley</b> 4,361 % fällig am 19.03.2027	€	2.000	2.177			<b>AKTIEN</b>	
<b>BPCE S.A.</b> 6,612 % fällig am 19.10.2027	\$	2.100	2.158	<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)</b>		121.800	12.151
<b>Morgan Stanley</b> 6,374 % fällig am 13.04.2028		2.000	2.000			<b>PARI (000S)</b>	
<b>General Motors Financial Co., Inc.</b> 5,400 % fällig am 08.05.2027		2.000	1.998	<b>Expedia Group, Inc.</b> 5,000 % fällig am 15.02.2026	\$	3.393	3.357
<b>Cassa Depositi e Prestiti SpA</b> 5,875 % fällig am 30.04.2029		2.000	1.983	<b>Societe Generale S.A.</b> 2,625 % fällig am 22.01.2025		2.500	2.427
<b>Citibank N.A.</b> 5,438 % fällig am 30.04.2026		1.900	1.900	<b>CPI Property Group S.A.</b> 2,750 % fällig am 12.05.2026	€	2.200	2.171
<b>Southern California Edison Co.</b> 5,350 % fällig am 01.03.2026		1.800	1.800	<b>Morgan Stanley</b> 4,361 % fällig am 19.03.2027		2.000	2.137
				<b>Freddie Mac</b> 4,000 % fällig am 01.09.2052	\$	966	899
				<b>Fannie Mae</b> 5,000 % fällig am 01.08.2053		394	387

(a) Der Low Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	24.014.235	\$ 239.290	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	25.067.648	\$ 249.800
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 3,875 % fällig am 15.04.2029 (b)	\$ 33.292	36.590	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.04.2029	\$ 17.800	17.894
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.03.2054	20.542	20.021	U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 31.10.2024	17.100	17.025
U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.04.2029	17.800	17.773	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.01.2025	13.700	13.616
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2049	10.888	10.124	Bank of America Corp. 2,375 % fällig am 19.06.2024	€ 10.200	11.035
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)	10.011	9.961	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 3,875 % fällig am 15.04.2029 (b)	\$ 9.402	10.151
Bank of America Corp. 5,202 % fällig am 25.04.2029	4.700	4.709	France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2025	€ 9.000	9.462
Lloyds Banking Group PLC 5,462 % fällig am 05.01.2028	4.353	4.353	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 139.500	7.527
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 31.01.2029	£ 4.000	4.303	Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 13.03.2025	€ 6.700	7.253
Jubilee Place BV 4,519 % fällig am 17.09.2060	€ 4.000	4.282	Marriott International, Inc. 5,550 % fällig am 15.10.2028	\$ 5.500	5.570
Caisse de Refinancement de l'Habitat S.A. 2,750 % fällig am 12.01.2029	3.800	4.138	Societe Generale S.A. 1,488 % fällig am 14.12.2026	5.500	5.070
Bayer U.S. Finance LLC 6,125 % fällig am 21.11.2026	\$ 3.477	3.504	Cheniere Energy, Inc. 4,625 % fällig am 15.10.2028	5.269	5.061
Las Vegas Sands Corp. 6,000 % fällig am 15.08.2029	3.400	3.398	Lloyds Banking Group PLC 5,462 % fällig am 05.01.2028	4.100	4.076
PVH Corp. 4,125 % fällig am 16.07.2029	€ 3.100	3.356	Energy Transfer LP 5,550 % fällig am 15.02.2028	4.000	4.022
Toyota Motor Finance Netherlands BV 3,125 % fällig am 11.01.2027	3.000	3.280	Toyota Motor Finance Netherlands BV 3,125 % fällig am 11.01.2027	€ 3.000	3.252
DBS Bank Ltd. 3,209 % fällig am 19.08.2026	3.000	3.227	American Tower Corp. 5,800 % fällig am 15.11.2028	\$ 3.000	3.056
Bank of Nova Scotia 3,500 % fällig am 17.04.2029	3.000	3.219	Enbridge, Inc. 5,900 % fällig am 15.11.2026	3.000	3.053
Enel Finance International NV 5,125 % fällig am 26.06.2029	\$ 3.200	3.164	CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,200 % fällig am 01.10.2028	3.000	3.032
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,381 % fällig am 13.03.2029	3.000	3.000	Volkswagen Group of America Finance LLC 6,298 % fällig am 07.06.2024	3.000	3.005
AerCap Ireland Capital DAC 2,450 % fällig am 29.10.2026	3.200	2.953	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,381 % fällig am 13.03.2029	3.000	2.997

(a) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		KOSTEN		BESCHREIBUNG		ERLÖSE
KÄUFE BIS 30. JUNI 2024	AKTIEN	(000S)		VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024	AKTIEN	(000S)
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	11.096.393	\$	110.576	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	8.038.234	\$ 80.100
		<b>PARI</b>				<b>PARI</b>
<b>Hayfin Emerald CLO DAC</b>		<b>(000S)</b>		<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		<b>(000S)</b>
0,000 % fällig am 18.07.2038	€	21.000	22.798	0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$	31.948
<b>Market Bidco Ltd.</b>				<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		
8,578 % fällig am 04.11.2027		21.400	22.381	0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)		9.721
<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>				<b>Aroundtown S.A.</b>		
0,000 % fällig am 20.07.2053	£	17.800	22.135	1,500 % fällig am 28.05.2026	€	8.700
<b>Jubilee Place BV</b>				<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>		
4,519 % fällig am 17.09.2060	€	20.600	22.053	6,125 % fällig am 08.03.2034	\$	7.800
<b>Trinity Square PLC</b>				<b>Sandoz Finance BV</b>		
0,000 % fällig am 15.07.2059	£	17.500	22.052	3,970 % fällig am 17.04.2027	€	5.400
<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>				<b>AIB Group PLC</b>		
6,634 % fällig am 20.02.2054		16.851	21.135	5,250 % fällig am 23.10.2031		5.000
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>				<b>T-Mobile USA, Inc.</b>		
0,000 % fällig am 25.06.2049		14.400	18.344	4,800 % fällig am 15.07.2028	\$	5.500
<b>Mortimer BTL PLC</b>				<b>Volkswagen Leasing GmbH</b>		
6,403 % fällig am 22.12.2056		12.962	16.478	3,625 % fällig am 11.10.2026	€	4.400
<b>Auto ABS Italian Stella Loans SRL</b>				<b>RTX Corp.</b>		
4,372 % fällig am 29.12.2036	€	12.400	13.357	5,750 % fällig am 15.01.2029	\$	4.000
<b>Mexico Government International Bond</b>				<b>Community Health Systems, Inc.</b>		
2,750 % fällig am 27.11.2031	MXN	244.997	12.648	5,625 % fällig am 15.03.2027		3.393
<b>St. Paul's CLO DAC</b>				<b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b>		
4,712 % fällig am 25.04.2030	€	11.318	12.053	6,750 % fällig am 02.03.2026	€	2.654
<b>TransDigm, Inc.</b>				<b>Rolls-Royce PLC</b>		
8,595 % fällig am 28.02.2031	\$	11.987	12.052	3,375 % fällig am 18.06.2026	£	2.059
<b>Cumulus Static CLO DAC</b>				<b>Israel Government International Bond</b>		
5,025 % fällig am 15.11.2033	€	10.900	11.794	5,000 % fällig am 30.10.2026	€	2.100
<b>Marzio Finance SRL</b>				<b>TransDigm, Inc.</b>		
4,472 % fällig am 28.09.2049		10.900	11.687	8,595 % fällig am 28.02.2031	\$	2.200
<b>ING Groep NV</b>				<b>Market Bidco Finco PLC</b>		
3,875 % fällig am 12.08.2029		10.500	11.251	4,750 % fällig am 04.11.2027	€	2.100
<b>JAB Holdings BV</b>				<b>Altice France S.A.</b>		
4,375 % fällig am 25.04.2034		10.400	11.198	8,125 % fällig am 01.02.2027	\$	2.100
<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>				<b>Poseidon Bidco SASU</b>		
5,581 % fällig am 22.04.2030	\$	11.100	11.100	9,175 % fällig am 30.09.2028	€	1.600
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b>				<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>		
5,707 % fällig am 22.04.2028		11.100	11.100	3,750 % fällig am 25.02.2026	\$	1.400
<b>Freddie Mac</b>				<b>Sands China Ltd.</b>		
4,750 % fällig am 25.07.2056		11.500	11.033	4,050 % fällig am 08.01.2026		1.200
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>						
6,134 % fällig am 28.06.2050	£	8.400	10.659			
<b>Venture Global LNG, Inc.</b>						
9,500 % fällig am 01.02.2029	\$	9.900	10.643			
<b>Fieldstone Mortgage Investment Trust</b>						
6,240 % fällig am 25.12.2035		12.460	10.520			
<b>GLP Capital LP</b>						
5,300 % fällig am 15.01.2029		10.800	10.496			
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>						
0,000 % fällig am 20.06.2060	£	8.000	10.142			
<b>CVC Cordatus Loan Fund DAC</b>						
4,608 % fällig am 15.08.2032	€	9.385	10.135			
<b>Precise Mortgage Funding PLC</b>						
6,190 % fällig am 16.07.2060	£	7.900	10.076			
<b>Imperial Brands Finance Netherlands BV</b>						
5,250 % fällig am 15.02.2031	€	8.900	10.045			
<b>Boeing Co.</b>						
4,875 % fällig am 01.05.2025	\$	9.800	9.725			
<b>JDE Peet's NV</b>						
4,500 % fällig am 23.01.2034	€	8.400	9.383			
<b>Towd Point Mortgage Trust</b>						
3,250 % fällig am 25.03.2058	\$	9.524	9.186			
<b>CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC</b>						
5,289 % fällig am 15.08.2033	€	8.500	9.182			
<b>Barclays PLC</b>						
4,506 % fällig am 31.01.2033		8.500	9.120			
<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b>						
5,381 % fällig am 13.03.2029	\$	9.000	9.000			
<b>Palmer Square BDC CLO Ltd.</b>						
6,925 % fällig am 15.07.2037		8.700	8.700			
<b>Morgan Stanley</b>						
4,813 % fällig am 25.10.2028	€	7.616	8.503			
<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>						
6,125 % fällig am 08.03.2034	\$	8.400	8.391			

(a) Der Low Duration Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund</b>	3.440.024	\$ 34.280	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	3.331.735	\$ 33.200
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>Brazil Letras do Tesouro Nacional</b> 0,000 % fällig am 01.04.2025	BRL 68.200	11.658	<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,125 % fällig am 30.09.2024	\$ 17.000	16.689
<b>U.S. Treasury Notes</b> 4,875 % fällig am 30.04.2026	\$ 4.400	4.389	<b>Brazil Letras do Tesouro Nacional</b> 0,000 % fällig am 01.07.2024	BRL 63.100	11.648
<b>Freddie Mac</b> 2,000 % fällig am 25.11.2050	21.138	2.523	<b>Cedar Funding CLO Ltd.</b> 6,586 % fällig am 20.01.2031	\$ 4.069	4.076
<b>Freddie Mac</b> 2,000 % fällig am 25.02.2051	18.253	2.212	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	4.119	3.715
<b>Fannie Mae</b> 3,500 % fällig am 25.01.2051	10.850	2.034	<b>CPI Property Group S.A.</b> 1,750 % fällig am 14.01.2030	€ 2.700	2.104
<b>Broadcom, Inc.</b> 0,000 % fällig am 14.08.2026	1.500	1.496	<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b> 4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 1.800	1.996
<b>Athene Global Funding</b> 4,823 % fällig am 23.02.2027	€ 1.200	1.297	<b>UBS AG</b> 0,250 % fällig am 01.09.2028	€ 2.000	1.858
<b>Peru Government International Bond</b> 6,950 % fällig am 12.08.2031	PEN 4.800	1.286	<b>Altice France S.A.</b> 4,250 % fällig am 15.10.2029	2.000	1.662
<b>Enel Finance International NV</b> 5,125 % fällig am 26.06.2029	\$ 1.300	1.285	<b>IRB Holding Corp.</b> 8,179 % fällig am 15.12.2027	\$ 1.500	1.498
<b>Peru Government International Bond</b> 6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN 4.600	1.157	<b>AES Corp.</b> 5,450 % fällig am 01.06.2028	1.400	1.399
<b>Volkswagen Leasing GmbH</b> 3,625 % fällig am 11.10.2026	€ 1.000	1.092	<b>DAE Funding LLC</b> 3,375 % fällig am 20.03.2028	1.400	1.289
<b>Freddie Mac</b> 3,500 % fällig am 25.05.2051	\$ 5.856	1.065	<b>Barclays PLC</b> 7,125 % fällig am 15.06.2025	£ 1.000	1.234
<b>Cape Lookout Re Ltd.</b> 13,355 % fällig am 05.04.2027	700	700	<b>CTP NV</b> 0,625 % fällig am 27.09.2026	€ 1.200	1.193
<b>Polestar Re Ltd.</b> 18,605 % fällig am 07.01.2027	700	700	<b>Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.</b> 3,250 % fällig am 12.11.2025	1.100	1.117
<b>Freddie Mac</b> 2,500 % fällig am 25.06.2051	4.518	664	<b>TP ICAP Finance PLC</b> 5,250 % fällig am 29.05.2026	£ 900	1.110
<b>Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC</b> 0,000 % fällig am 05.04.2032	1.048	631	<b>NE Property BV</b> 2,000 % fällig am 20.01.2030	€ 1.100	1.007
<b>Schaeffler AG</b> 4,500 % fällig am 28.03.2030	€ 500	540	<b>United Airlines, Inc.</b> 4,375 % fällig am 15.04.2026	\$ 800	772
<b>TER Finance Jersey Ltd.</b> 7,020 % fällig am 02.01.2025	\$ 500	471	<b>Apidos CLO</b> 6,596 % fällig am 20.04.2031	765	766
<b>Freddie Mac</b> 3,500 % fällig am 25.12.2051	2.430	437	<b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b> 6,060 % fällig am 25.04.2037	1.000	693

(a) Der Low Duration Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
<b>Prologis International Funding S.A.</b> 0,875 % fällig am 09.07.2029	€	125	\$ 115	<b>Mizuho Financial Group, Inc.</b> 0,214 % fällig am 07.10.2025	€	100	\$ 103
<b>Electricite de France S.A.</b> 4,125 % fällig am 17.06.2031		100	107	<b>Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide</b> 1,875 % fällig am 31.03.2028		27	27
<b>NXP BV</b> 2,500 % fällig am 11.05.2031	\$	50	42	<b>Hilton Domestic Operating Co., Inc.</b> 3,625 % fällig am 15.02.2032	\$	20	17
<b>Volkswagen Leasing GmbH</b> 4,000 % fällig am 11.04.2031	€	30	33	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.			
<b>Volkswagen Leasing GmbH</b> 3,625 % fällig am 11.10.2026		30	32	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.			
<b>Romania Government International Bond</b> 5,375 % fällig am 22.03.2031		30	32				
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b> 0,855 % fällig am 12.02.2026	\$	30	29				
<b>Morgan Stanley</b> 6,407 % fällig am 01.11.2029		25	26				
<b>Kilroy Realty LP</b> 2,650 % fällig am 15.11.2033		20	15				

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	484.965	\$ 4.833	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	361.269	\$ 3.600
TC Energy Corp.	84.600	3.316	Targa Resources Corp.	25.200	2.837
Enbridge, Inc.	91.100	3.229	Diamondback Energy, Inc.	13.000	2.355
		<b>PARI (000S)</b>	Marathon Oil Corp.	74.500	2.001
Venture Global LNG, Inc. 9,875 % fällig am 01.02.2032	\$ 2.350	2.463	Chesapeake Energy Corp.	22.500	1.759
		<b>AKTIEN</b>	Occidental Petroleum Corp.	28.366	1.693
EQT Corp.	41.200	1.679	Cheniere Energy, Inc.	8.900	1.395
Chesapeake Energy Corp.	18.400	1.648	EQT Corp.	31.800	1.219
Parkland Corp.	34.600	1.079	Enbridge, Inc.	28.900	1.023
Cheniere Energy, Inc.	5.900	942	Antero Resources Corp.	37.700	945
DTE Midstream LLC	11.200	744	Devon Energy Corp.	19.700	885
Kinder Morgan, Inc.	27.600	525	Williams Cos., Inc.	19.200	753
Williams Cos., Inc.	11.600	418	DTE Midstream LLC	8.400	490
		<b>PARI (000S)</b>	ONEOK, Inc.	4.300	332
Vital Energy, Inc. 7,875 % fällig am 15.04.2032	\$ 100	101	Hess Midstream LP	9.110	289

(a) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>Fannie Mae</b> 6,335 % fällig am 25.01.2054	\$	16.800	<b>Freddie Mac</b> 3,500 % fällig am 01.06.2052	\$	2193
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b> 0,000 % fällig am 25.06.2049	£	10.600	<b>DBGS Mortgage Trust</b> 6,926 % fällig am 15.06.2033	2.422	1.865
<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b> 0,000 % fällig am 20.07.2053		10.600	<b>Freddie Mac</b> 4,000 % fällig am 01.11.2038	1.738	1.669
<b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b> 5,720 % fällig am 25.03.2037	\$	18.621	<b>Ginnie Mae</b> 3,000 % fällig am 20.01.2052	11.646	1.630
<b>Domi BV</b> 4,419 % fällig am 15.06.2056	€	10.600	<b>Freddie Mac</b> 4,000 % fällig am 01.04.2039	1.628	1.563
<b>Blackrock European CLO DAC</b> 4,526 % fällig am 15.10.2031		10.039	<b>Freddie Mac</b> 4,000 % fällig am 01.05.2039	1.623	1.553
<b>Ginnie Mae</b> 6,200 % fällig am 01.08.2074	\$	10.300	<b>Freddie Mac</b> 4,000 % fällig am 01.07.2039	1.408	1.352
<b>Trinity Square PLC</b> 0,000 % fällig am 15.07.2059	£	6.400	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,500 % fällig am 15.04.2024 (a)	1.131	1.134
<b>Fannie Mae</b> 2,000 % fällig am 25.06.2052	\$	56.623	<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 25.06.2050	4.583	917
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,000 % fällig am 01.02.2054		6.034	<b>Verus Securitization Trust</b> 3,195 % fällig am 25.10.2063	1.000	855
<b>Seasoned Loans Structured Transaction Trust</b> 6,305 % fällig am 25.05.2034		5.400	<b>Fannie Mae</b> 0,000 % fällig am 25.02.2052	55.619	821
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,000 % fällig am 01.02.2054		5.420	<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.05.2038	828	795
<b>Countrywide Alternative Loan Trust</b> 5,740 % fällig am 25.04.2047		5.485	<b>Fannie Mae</b> 3,000 % fällig am 01.07.2052	884	746
<b>Fannie Mae</b> 5,810 % fällig am 01.06.2031		4.300	<b>Freddie Mac</b> 4,000 % fällig am 01.08.2038	575	552
<b>Atlas Funding PLC</b> 0,000 % fällig am 20.09.2061	£	3.200	<b>Freddie Mac</b> 4,500 % fällig am 25.05.2050	685	155
<b>Fannie Mae</b> 5,270 % fällig am 01.08.2032	\$	3.870			
<b>CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC</b> 5,289 % fällig am 15.08.2033	€	3.500	(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
<b>Fannie Mae</b> 5,570 % fällig am 01.01.2030	\$	3.630	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
<b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b> 5,123 % fällig am 15.08.2033	€	2.800	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
<b>Auburn PLC</b> 0,000 % fällig am 20.07.2045	£	2.400			
<b>GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC</b> 4,717 % fällig am 20.04.2034	€	2.800			
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,500 % fällig am 01.03.2054	\$	2.894			
<b>Marzio Finance SRL</b> 4,472 % fällig am 28.09.2049	€	2.600			
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.05.2049	\$	2.927			
<b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b> 5,943 % fällig am 15.08.2033	€	2.500			
<b>Dryden Euro CLO DAC</b> 5,656 % fällig am 15.10.2032		2.500			
<b>Rockford Tower Europe CLO DAC</b> 5,220 % fällig am 24.04.2037		2.400			

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	23.091.613	\$ 230.114	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	7.857.560	\$ 78.300
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	\$ 95.320	92.962	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 34.002	33.951
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)	37.272	36.058	<b>Citibank N.A.</b> 5,864 % fällig am 29.09.2025	11.200	11.368
<b>Fannie Mae</b> 2,520 % fällig am 01.03.2025	22.000	21.387	<b>Dutch Property Finance BV</b> 5,702 % fällig am 28.04.2050	€ 9.579	10.365
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 1,750 % fällig am 15.01.2034 (b)	14.881	14.478	<b>Wells Fargo Bank N.A.</b> 5,550 % fällig am 01.08.2025	\$ 6.400	6.453
<b>Fannie Mae</b> 3,210 % fällig am 01.07.2026	14.675	14.134	<b>Bank of America N.A.</b> 5,650 % fällig am 18.08.2025	6.100	6.162
<b>Trinitas CLO Ltd.</b> 6,663 % fällig am 25.01.2034	13.500	13.500	<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b> 2,301 % fällig am 15.10.2025	700	683
<b>Citibank N.A.</b> 5,438 % fällig am 30.04.2026	12.650	12.650	<b>Deutsche Bank S.A. Espanola</b> 3,625 % fällig am 23.11.2026	€ 600	665
<b>Fannie Mae</b> 2,170 % fällig am 01.09.2026	13.412	12.582	<b>Home Equity Asset Trust</b> 4,925 % fällig am 25.10.2035	\$ 100	97
<b>Fannie Mae</b> 3,100 % fällig am 01.01.2026	12.600	12.148	(a) Der StocksPLUS™ Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b> 2,393 % fällig am 02.06.2028	12.300	11.322	(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,000 % fällig am 01.04.2054	10.433	10.492	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.02.2054	10.203	10.426	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
<b>Fannie Mae</b> 3,230 % fällig am 01.05.2026	10.775	10.396			
<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b> 3,509 % fällig am 23.01.2029	11.000	10.391			
<b>Citigroup, Inc.</b> 3,520 % fällig am 27.10.2028	10.800	10.202			
<b>Silverstone Master Issuer PLC</b> 5,703 % fällig am 21.01.2070	£ 7.900	10.036			
<b>Toronto-Dominion Bank</b> 4,994 % fällig am 05.04.2029	\$ 9.900	9.900			
<b>Bank of America Corp.</b> 3,593 % fällig am 21.07.2028	9.100	8.656			
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 6,500 % fällig am 01.02.2054	8.404	8.588			

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
Stratton Mortgage Funding PLC 0,000 % fällig am 25.06.2049	£	250	\$ 318	Wells Fargo & Co. 1,338 % fällig am 04.05.2025	€	100 \$ 109
Hayfin Emerald CLO DAC 0,000 % fällig am 18.07.2038	€	250	271	Frost CMBS DAC 5,083 % fällig am 20.11.2033		98 104
		<b>AKTIEN</b>		Bank of America N.A. 5,650 % fällig am 18.08.2025	\$	100 101
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		21.579	215		<b>AKTIEN</b>	
		<b>PARI (000S)</b>		PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		10.035 100
Stratton Mortgage Funding PLC 6,134 % fällig am 28.06.2050	£	100	127		<b>PARI (000S)</b>	
Marzio Finance SRL 4,472 % fällig am 28.09.2049	€	100	107	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2052	DKK	400 46
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)	\$	101	101	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$	25 23
JPMorgan Chase & Co. 5,040 % fällig am 23.01.2028		100	100	(a) Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
Morgan Stanley Bank N.A. 4,952 % fällig am 14.01.2028		100	100	(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.04.2054		99	100	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.09.2024	¥	-	-	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.05.2024		-	-			
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 01.07.2024		-	-			
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.09.2024		-	-			
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.04.2024		-	-			
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.06.2024		-	-			
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 26.08.2024		-	-			
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.09.2024		-	-			
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 27.05.2024		-	-			

BESCHREIBUNG			KOSTEN (000S)		ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>	
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	9.117.219	\$	90.853	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	9.081.704 \$ 90.500
	<b>PARI (000S)</b>				<b>PARI (000S)</b>
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.10.2052	\$ 11.007		10.288	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.10.2052	\$ 11.007 10.242
U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.04.2027	7.000		6.948	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	5.296 5.288
U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 31.03.2026	6.800		6.744	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	3.468 3.468
	<b>AKTIEN</b>				<b>AKTIEN</b>
Home Depot, Inc.	6.920		2.324	Procter & Gamble Co.	13.331 2.143
Philip Morris International, Inc.	16.193		1.652	Nintendo Co. Ltd.	32.700 1.751
	<b>PARI (000S)</b>				<b>PARI (000S)</b>
Towd Point Mortgage Funding PLC 0,000 % fällig am 20.07.2053	£ 1.300		1.617	Societe Generale S.A. 6,446 % fällig am 10.01.2029	\$ 1.700 1.746
Palmer Square BDC CLO Ltd. 6,925 % fällig am 15.07.2037	\$ 1.600		1.600	Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	2.400 1.632
	<b>AKTIEN</b>				<b>AKTIEN</b>
Rio Tinto PLC	22.949		1.536	UBS Group AG 3,869 % fällig am 12.01.2029	1.670 1.569
Target Corp.	8.143		1.365	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 26.100 1.435
BlackRock, Inc.	1.608		1.253	Russia Government International Bond 7,150 % fällig am 12.11.2025	RUB 214.863 1.418
Cummins, Inc.	4.253		1.220		<b>AKTIEN</b>
QUALCOMM, Inc.	7.135		1.038	Apartment Income REIT Corp.	35.975 1.385
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	2.187		990	Merck & Co., Inc.	10.342 1.350
British American Tobacco PLC	31.528		985		<b>PARI (000S)</b>
BHP Group Ltd.	31.056		929	Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.07.2053	\$ 1.335 1.332
	<b>PARI (000S)</b>			Israel Government International Bond 5,000 % fällig am 30.10.2026	€ 1.200 1.326
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.07.2053	\$ 968		905	Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.08.2053	\$ 1.251 1.249
	<b>AKTIEN</b>			Pacific Gas & Electric Co. 4,950 % fällig am 01.07.2050	1.481 1.248
Gilead Sciences, Inc.	12.509		894		<b>AKTIEN</b>
Devon Energy Corp.	18.985		888	CRH PLC	15.380 1.244
	<b>PARI (000S)</b>			Mitsubishi Corp.	50.400 1.093
Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK)				Electronic Arts, Inc.	8.023 1.076
8,000 % fällig am 31.12.2026	€ 700		853		

(a) Der Strategic Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	80.060.089	\$ 797.793
	<b>PARI (000S)</b>	
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.10.2052	\$ 32.997	30.842
<b>United Kingdom Gilt</b> 4,375 % fällig am 31.07.2054	£ 19.890	24.923
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.11.2052	\$ 19.576	18.298
<b>Mexico Government International Bond</b> 7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN 324.000	18.226
<b>BNP Paribas S.A.</b> 5,497 % fällig am 20.05.2030	\$ 11.100	11.084
<b>BPCE S.A.</b> 3,875 % fällig am 11.01.2029	€ 9.500	10.352
<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b> 0,000 % fällig am 20.07.2053	£ 8.200	10.197
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,125 % fällig am 15.04.2025	\$ 10.219	9.928
<b>UBS Group AG</b> 4,125 % fällig am 09.06.2033	€ 8.300	9.004
<b>Morgan Stanley Bank N.A.</b> 6,436 % fällig am 14.01.2028	\$ 8.800	8.800
<b>PacifiCorp</b> 5,300 % fällig am 15.02.2031	8.800	8.785
<b>Citigroup, Inc.</b> 5,174 % fällig am 13.02.2030	8.700	8.700
<b>Saudi Arabia Government International Bond</b> 4,750 % fällig am 16.01.2030	8.700	8.639
<b>Brazil Government International Bond</b> 6,125 % fällig am 15.03.2034	8.700	8.554
<b>Cooperatieve Rabobank UA</b> 5,447 % fällig am 05.03.2030	8.400	8.400
<b>Southern California Edison Co.</b> 5,350 % fällig am 01.03.2026	8.400	8.400
<b>Banco Santander S.A.</b> 5,552 % fällig am 14.03.2028	8.400	8.400
<b>Bank of America Corp.</b> 3,824 % fällig am 20.01.2028	8.700	8.347
<b>Credit Agricole S.A.</b> 6,316 % fällig am 03.10.2029	7.500	7.724

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	82.860.408	\$ 825.700
	<b>PARI (000S)</b>	
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 5,000 % fällig am 01.04.2053	\$ 59.734	58.427
<b>Freddie Mac</b> 5,000 % fällig am 01.04.2053	39.312	38.452
<b>Freddie Mac</b> 5,000 % fällig am 01.05.2053	32.803	32.086
<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.10.2052	32.997	30.705
<b>Fannie Mae</b> 3,000 % fällig am 01.05.2052	35.011	29.410
<b>Canada Government International Bond</b> 2,250 % fällig am 01.12.2029	CAD 38.600	26.161
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 1,625 % fällig am 15.11.2050	\$ 35.800	19.640
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.11.2052	19.577	18.217
<b>U.S. Treasury Notes</b> 1,750 % fällig am 30.06.2024	16.700	16.423
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 3,000 % fällig am 01.07.2052	17.523	14.750
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 1,375 % fällig am 15.08.2050	24.100	12.348
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 0,500 % fällig am 15.04.2024	10.465	10.456
<b>ONEOK, Inc.</b> 6,625 % fällig am 01.09.2053	7.900	8.445
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 3,250 % fällig am 15.05.2042	9.900	8.285
<b>Ecopetrol S.A.</b> 8,375 % fällig am 19.01.2036	6.800	6.803
<b>Fannie Mae</b> 3,500 % fällig am 01.08.2052	7.380	6.700
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b> 4,000 % fällig am 01.10.2052	6.999	6.513
<b>G City Europe Ltd.</b> 4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 6.300	6.505
<b>U.S. Treasury Bonds</b> 3,000 % fällig am 15.02.2049	\$ 8.100	6.313

(a) Der Total Return Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	444.716 \$	4.432	Eversource Energy 4,200 % fällig am 27.06.2024	1.100	1.098
	<b>PARI (000S)</b>		ING Groep NV 7,016 % fällig am 28.03.2026	1.000	1.009
Freddie Mac 5,700 % fällig am 06.03.2026	\$ 3.000	3.000	Volkswagen Group of America Finance LLC 6,302 % fällig am 12.09.2025	1.000	1.006
Mitsubishi HC Capital, Inc. 3,637 % fällig am 13.04.2025	2.301	2.248	Hyundai Capital America 6,250 % fällig am 03.11.2025	1.000	1.006
Danske Bank A/S 6,466 % fällig am 09.01.2026	2.000	2.013	Santander UK Group Holdings PLC 1,089 % fällig am 15.03.2025	1.000	998
Federal Home Loan Bank 6,000 % fällig am 03.05.2027	2.000	2.000	Israel Electric Corp. Ltd. 5,000 % fällig am 12.11.2024	1.000	994
HSBC Holdings PLC 0,976 % fällig am 24.05.2025	2.000	1.996	Becton Dickinson & Co. 3,363 % fällig am 06.06.2024	1.000	994
Ally Financial, Inc. 5,125 % fällig am 30.09.2024	2.000	1.992	KT Corp. 4,000 % fällig am 08.08.2025	1.000	982
Swedbank AB 5,337 % fällig am 20.09.2027	2.000	1.974	T-Mobile USA, Inc. 3,500 % fällig am 15.04.2025	1.000	980
AES Corp. 3,300 % fällig am 15.07.2025	2.000	1.946	Societe Generale S.A. 2,625 % fällig am 22.01.2025	1.000	973
Carrier Global Corp. 2,242 % fällig am 15.02.2025	2.000	1.938			
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 6,785 % fällig am 13.01.2026	1.900	1.928			
Svenska Handelsbanken AB 6,281 % fällig am 10.06.2025	1.900	1.911			
Svenska Handelsbanken AB 6,031 % fällig am 28.05.2027	1.900	1.902			
Southwest Airlines Co. 5,250 % fällig am 04.05.2025	1.900	1.893			
BNP Paribas S.A. 3,375 % fällig am 09.01.2025	1.900	1.863			
Bank of Queensland Ltd. 5,440 % fällig am 14.05.2025	AUD 2.800	1.851			
Cooperatieve Rabobank UA 6,064 % fällig am 09.01.2026	\$ 1.800	1.809			
HCA, Inc. 5,375 % fällig am 01.02.2025	1.800	1.795			
Warnermedia Holdings, Inc. 3,638 % fällig am 15.03.2025	1.800	1.764			
Zimmer Biomet Holdings, Inc. 1,450 % fällig am 22.11.2024	1.800	1.744			
Citigroup, Inc. 6,048 % fällig am 30.10.2024	1.700	1.702			
Morgan Stanley 3,620 % fällig am 17.04.2025	1.600	1.594			
American Honda Finance Corp. 6,139 % fällig am 23.04.2025	1.500	1.506			
Nordea Bank Abp 6,114 % fällig am 19.03.2027	1.500	1.503			
Athene Global Funding 6,049 % fällig am 24.05.2024	1.500	1.499			
NatWest Group PLC 4,269 % fällig am 22.03.2025	1.500	1.496			
Credit Agricole S.A. 3,250 % fällig am 04.10.2024	1.500	1.484			
Black Hills Corp. 1,037 % fällig am 23.08.2024	1.500	1.483			
VMware LLC 4,500 % fällig am 15.05.2025	1.500	1.483			
TD SYNEX Corp. 1,250 % fällig am 09.08.2024	1.500	1.476			
American Tower Corp. 2,950 % fällig am 15.01.2025	1.500	1.467			
Ford Motor Credit Co. LLC 4,134 % fällig am 04.08.2025	1.500	1.463			
Rogers Communications, Inc. 2,950 % fällig am 15.03.2025	1.500	1.460			
Revvity, Inc. 0,850 % fällig am 15.09.2024	1.500	1.458			
Global Payments, Inc. 2,650 % fällig am 15.02.2025	1.457	1.424			
Lloyds Banking Group PLC 3,870 % fällig am 09.07.2025	1.400	1.388			
Georgia Power Co. 6,114 % fällig am 08.05.2025	1.300	1.305			
Amgen, Inc. 5,250 % fällig am 02.03.2025	1.300	1.296			
Bank of America Corp. 3,093 % fällig am 01.10.2025	1.200	1.189			
Electricite de France S.A. 3,625 % fällig am 13.10.2025	1.200	1.171			

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	571.986 \$	5.700
	<b>PARI (000S)</b>	
<b>Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.</b> 6,730 % fällig am 15.07.2031	\$ 4.900	4.904
<b>Freddie Mac</b> 5,700 % fällig am 06.03.2026	3.000	2.999
<b>Aozora Bank Ltd.</b> 5,900 % fällig am 02.03.2026	2.000	2.020
<b>Nomura Holdings, Inc.</b> 2,648 % fällig am 16.01.2025	1.900	1.844
<b>Aozora Bank Ltd.</b> 1,050 % fällig am 09.09.2024	1.800	1.749
<b>Energy Transfer LP</b> 4,500 % fällig am 15.04.2024	1.500	1.495
<b>General Motors Financial Co., Inc.</b> 6,114 % fällig am 08.03.2024	899	899
<b>Enel Finance International NV</b> 2,650 % fällig am 10.09.2024	900	880
<b>Spire Missouri, Inc.</b> 5,871 % fällig am 02.12.2024	800	799
<b>NetApp, Inc.</b> 3,300 % fällig am 29.09.2024	700	688
<b>Banque Federative du Credit Mutuel S.A.</b> 2,375 % fällig am 21.11.2024	700	682
<b>PSP Capital, Inc.</b> 5,611 % fällig am 03.03.2025	600	600
<b>Bank of America Corp.</b> 5,759 % fällig am 14.06.2024	500	500
<b>Deutsche Bank AG</b> 0,898 % fällig am 28.05.2024	500	491
<b>Capital One Financial Corp.</b> 6,697 % fällig am 09.05.2025	400	401

(a) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054	£	10.250	£ 9.786	United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.10.2025	£	10.500	£ 10.311
		<b>AKTIEN</b>		United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 30.01.2026		11.000	10.176
PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)		86.600	8.889	United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053		9.700	8.425
		<b>PARI (000S)</b>		<b>AKTIEN</b>			
United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 31.07.2053	£	13.500	6.825	PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)		77.000	7.902
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.10.2028 (b)	\$	5.118	4.112			<b>PARI (000S)</b>	
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2029	€	4.400	3.268	United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 31.07.2053	£	10.100	5.144
Agence Francaise de Developpement 4,125 % fällig am 22.07.2027	£	3.200	3.192	United Kingdom Gilt 4,375 % fällig am 31.07.2054		5.100	4.916
Land Berlin 3,000 % fällig am 13.03.2054	€	3.700	3.117	United Kingdom Gilt 1,625 % fällig am 22.10.2028		5.000	4.545
SW Finance PLC 7,000 % fällig am 16.04.2040	£	1.900	1.891	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.10.2028 (b)	\$	5.176	4.187
Auckland Council 3,000 % fällig am 18.03.2034	€	2.100	1.781	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2029	€	4.400	3.244
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 07.03.2027	£	1.800	1.776	Agence Francaise de Developpement 4,125 % fällig am 22.07.2027	£	3.200	3.160
UBS Group AG 7,375 % fällig am 07.09.2033		1.500	1.686	Land Berlin 3,000 % fällig am 13.03.2054	€	3.700	3.069
Barclays PLC 5,851 % fällig am 21.03.2035		1.600	1.599	NRW Bank 5,375 % fällig am 22.07.2026	£	2.800	2.843
Southern Water Services Finance Ltd. 3,000 % fällig am 28.05.2037		2.250	1.541	International Bank for Reconstruction & Development 5,750 % fällig am 07.06.2032		2.400	2.653
Spain Government International Bond 5,250 % fällig am 06.04.2029		1.487	1.529	Asian Development Bank 6,125 % fällig am 15.08.2025		2.550	2.588
Sartorius Finance BV 4,875 % fällig am 14.09.2035	€	1.600	1.458	United Kingdom Gilt 0,000 % fällig am 14.10.2024		2.400	2.342
Banco BPM SpA 3,250 % fällig am 28.05.2031		1.500	1.272	United Kingdom Gilt 0,000 % fällig am 28.10.2024		2.200	2.152
UBS Group AG 4,125 % fällig am 09.06.2033		1.400	1.203	United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.07.2052		2.300	2.017
Bavarian Sky UK PLC 0,000 % fällig am 21.06.2032	£	1.200	1.200	Enel Finance International NV 2,875 % fällig am 11.04.2029		2.100	1.905
Westpac Banking Corp. 5,835 % fällig am 03.07.2028		1.200	1.200	EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€	2.650	1.807
Morgan Stanley 3,955 % fällig am 21.03.2035	€	1.400	1.197	SW Finance PLC 7,000 % fällig am 16.04.2040	£	1.900	1.798

(a) Der UK Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 2,375 % fällig am 15.10.2028 (a)	\$	4.936	£ 4.003	<b>United Kingdom Gilt</b> 1,250 % fällig am 31.07.2051	£	13.200	£ 6.405
<b>Freddie Mac</b> 4,000 % fällig am 01.04.2053		4.000	2.941	<b>Freddie Mac</b> 4,000 % fällig am 01.04.2053	\$	4.000	2.939
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b> 1,125 % fällig am 15.01.2033 (a)		3.004	2.206	<b>Orsted A/S</b> 5,125 % fällig am 13.09.2034	£	1.900	1.884
<b>Freddie Mac</b> 3,459 % fällig am 21.09.2049	£	2.500	1.865	<b>Walmart, Inc.</b> 5,625 % fällig am 27.03.2034		1.600	1.727
<b>Anglian Water Services Financing PLC</b> 6,000 % fällig am 20.06.2039		1.500	1.573	<b>Pfizer, Inc.</b> 2,735 % fällig am 15.06.2043		2.400	1.716
<b>SW Finance PLC</b> 7,000 % fällig am 16.04.2040		1.500	1.464	<b>National Gas Transmission PLC</b> 5,750 % fällig am 05.04.2035		1.100	1.128
<b>EP Infrastructure A/S</b> 2,045 % fällig am 09.10.2028	€	1.800	1.354	<b>Comcast Corp.</b> 1,875 % fällig am 20.02.2036		1.550	1.114
<b>Motability Operations Group PLC</b> 5,625 % fällig am 24.01.2054	£	1.300	1.300	<b>Toro European CLO DAC</b> 4,832 % fällig am 12.01.2032	€	1.300	1.098
<b>Manchester Airport Group Funding PLC</b> 5,750 % fällig am 30.09.2042		1.300	1.295	<b>Verizon Communications, Inc.</b> 4,750 % fällig am 17.02.2034	£	1.000	970
<b>Vonovia SE</b> 5,500 % fällig am 18.01.2036		1.300	1.283	<b>Cisco Systems, Inc.</b> 5,300 % fällig am 26.02.2054	\$	1.200	970
<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b> 5,000 % fällig am 09.06.2036		1.200	1.275	<b>Time Warner Cable LLC</b> 5,250 % fällig am 15.07.2042	£	1.100	941
<b>Electricite de France S.A.</b> 5,125 % fällig am 22.09.2050		1.400	1.222	<b>Welltower OP LLC</b> 4,500 % fällig am 01.12.2034		1.000	905
<b>Berkshire Hathaway Finance Corp.</b> 2,625 % fällig am 19.06.2059		1.900	1.114	<b>South Eastern Power Networks PLC</b> 5,375 % fällig am 26.02.2042		900	899
<b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b> 6,750 % fällig am 15.06.2054	\$	1.300	1.019	<b>Heathrow Funding Ltd.</b> 4,625 % fällig am 31.10.2048		1.000	883
<b>Prologis LP</b> 5,625 % fällig am 04.05.2040	£	1.000	998	<b>London &amp; Quadrant Housing Trust</b> 4,625 % fällig am 05.12.2033		900	859
<b>Suez SACA</b> 6,625 % fällig am 05.10.2043		900	993	<b>Northern Gas Networks Finance PLC</b> 4,875 % fällig am 15.11.2035		900	842
<b>United Utilities Water Finance PLC</b> 5,125 % fällig am 06.10.2038		1.000	978	<b>United Kingdom Gilt</b> 1,750 % fällig am 22.07.2057		1.600	839
<b>Libra Longhurst Group Treasury PLC</b> 5,125 % fällig am 02.08.2038		1.000	961	<b>Venture Global LNG, Inc.</b> 9,500 % fällig am 01.02.2029	\$	1.000	839
<b>HSBC Holdings PLC</b> 7,000 % fällig am 07.04.2038		900	956	<b>Scottish Hydro Electric Transmission PLC</b> 2,125 % fällig am 24.03.2036	£	1.100	797
<b>Cisco Systems, Inc.</b> 5,300 % fällig am 26.02.2054	\$	1.200	948	<b>Bayer AG</b> 7,000 % fällig am 25.09.2083	€	900	792
<b>Orbit Capital PLC</b> 2,000 % fällig am 24.11.2038	£	1.400	941	<b>National Grid Electricity Distribution South Wales PLC</b> 5,350 % fällig am 10.07.2039	£	800	789
<b>E.ON International Finance BV</b> 5,875 % fällig am 30.10.2037		900	918	<b>Scottish Widows Ltd.</b> 7,000 % fällig am 16.06.2043		700	764
<b>AT&amp;T, Inc.</b> 7,000 % fällig am 30.04.2040		800	900	<b>Sovereign Housing Capital PLC</b> 5,705 % fällig am 10.09.2039		700	739
<b>Barclays PLC</b> 5,851 % fällig am 21.03.2035		900	894	<b>HSBC Bank Capital Funding Sterling LP</b> 5,844 % fällig am 05.11.2031		700	730
<b>South Eastern Power Networks PLC</b> 5,375 % fällig am 26.02.2042		900	887	<b>Diageo Finance PLC</b> 2,750 % fällig am 08.06.2038		900	688
<b>Drax Finco PLC</b> 5,875 % fällig am 15.04.2029	€	1.000	856	<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.08.2052	\$	900	661
<b>IPD BV</b> 7,086 % fällig am 15.06.2031		1.000	844	<b>Southern Gas Networks PLC</b> 6,375 % fällig am 15.05.2040	£	600	636
<b>Vodafone Group PLC</b> 3,375 % fällig am 08.08.2049	£	1.200	817	<b>Engie S.A.</b> 5,000 % fällig am 01.10.2060		700	616
<b>Nestle Finance International Ltd.</b> 5,125 % fällig am 07.12.2038		800	809	<b>ING Groep NV</b> 6,250 % fällig am 20.05.2033		600	600
<b>Yorkshire Water Finance PLC</b> 2,750 % fällig am 18.04.2041		1.200	806	<b>Orange S.A.</b> 5,375 % fällig am 22.11.2050		600	596
<b>National Grid Electricity Distribution South Wales PLC</b> 5,350 % fällig am 10.07.2039		800	799	<b>Aegon Ltd.</b> 6,625 % fällig am 16.12.2039		500	567
<b>Gacfi First Investment Co.</b> 5,625 % fällig am 11.06.2039		800	798	<b>United Kingdom Gilt</b> 3,750 % fällig am 22.10.2053		600	522
<b>UBS Group AG</b> 7,375 % fällig am 07.09.2033		700	788	<b>Barclays PLC</b> 8,875 % fällig am 15.09.2027		500	512
<b>Segro PLC</b> 2,875 % fällig am 11.10.2037		1.000	763	<b>Wellcome Trust Finance PLC</b> 4,625 % fällig am 25.07.2036		500	506
<b>Scottish Widows Ltd.</b> 7,000 % fällig am 16.06.2043		700	760	<b>Riverside Finance PLC</b> 3,875 % fällig am 05.12.2044		600	466
<b>Thames Water Utilities Finance PLC</b> 5,125 % fällig am 28.09.2037		800	688	<b>Lorca Telecom Bondco S.A.</b> 5,750 % fällig am 30.04.2029	€	500	433
<b>Tesco Corporate Treasury Services PLC</b> 5,125 % fällig am 22.05.2034		700	678				

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	54.587.835	\$ 543.963	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	56.799.185	\$ 566.000
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 7,875 % fällig am 01.04.2030	\$ 9.000	9.000	TransDigm, Inc. 4,625 % fällig am 15.01.2029	\$ 17.375	16.128
EQM Midstream Partners LP 6,375 % fällig am 01.04.2029	8.750	8.750	Las Vegas Sands Corp. 3,900 % fällig am 08.08.2029	15.275	13.872
Acrisure Finance, Inc. 8,250 % fällig am 01.02.2029	8.400	8.400	Telecom Italia SpA 7,875 % fällig am 31.07.2028	€ 9.500	11.356
Newmark Group, Inc. 7,500 % fällig am 12.01.2029	8.100	8.144	SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	\$ 10.000	8.859
Jane Street Group 7,125 % fällig am 30.04.2031	8.100	8.100	Acrisure Finance, Inc. 8,250 % fällig am 01.02.2029	8.400	8.314
INEOS Finance PLC 7,500 % fällig am 15.04.2029	7.000	7.000	Getty Images, Inc. 9,750 % fällig am 01.03.2027	8.250	8.251
U.S. Acute Care Solutions LLC 9,750 % fällig am 15.05.2029	7.000	6.865	Grifols S.A. 4,750 % fällig am 15.10.2028	9.675	8.206
HUB International Ltd. 7,250 % fällig am 15.06.2030	6.600	6.732	Cerba Healthcare SACA 3,500 % fällig am 31.05.2028	€ 7.850	7.337
Sotera Health Holdings LLC 8,594 % fällig am 30.05.2031	6.600	6.567	EQM Midstream Partners LP 4,500 % fällig am 15.01.2029	\$ 7.700	7.257
DISH Network Corp. 11,750 % fällig am 15.11.2027	6.500	6.553	INEOS Finance PLC 7,500 % fällig am 15.04.2029	7.000	6.957
Cotiviti Corp. 8,579 % fällig am 01.05.2031	6.525	6.492	DISH DBS Corp. 5,750 % fällig am 01.12.2028	10.200	6.932
RHP Hotel Properties LP 6,500 % fällig am 01.04.2032	6.275	6.275	Ford Motor Credit Co. LLC 4,000 % fällig am 13.11.2030	7.500	6.699
Service Properties Trust 8,375 % fällig am 15.06.2029	6.300	6.237	Innophos Holdings, Inc. 9,375 % fällig am 15.02.2028	7.200	6.240
Panther Escrow Issuer LLC 7,125 % fällig am 01.06.2031	6.000	6.000	Tenet Healthcare Corp. 6,125 % fällig am 01.10.2028	6.200	6.154
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. 8,750 % fällig am 15.04.2030	6.000	5.865	United Airlines, Inc. 4,625 % fällig am 15.04.2029	6.600	6.138
Allegiant Travel Co. 7,250 % fällig am 15.08.2027	5.725	5.623	DISH Network Corp. 11,750 % fällig am 15.11.2027	6.000	6.019
Block, Inc. 6,500 % fällig am 15.05.2032	5.300	5.300	CCO Holdings LLC 4,500 % fällig am 15.08.2030	7.000	6.018
Cloud Software Group, Inc. 8,250 % fällig am 30.06.2032	5.125	5.125	Novelis Corp. 3,875 % fällig am 15.08.2031	7.000	6.002
Transocean, Inc. 8,250 % fällig am 15.05.2029	5.100	5.100	Caesars Entertainment, Inc. 4,625 % fällig am 15.10.2029	6.700	5.955

(a) Der US High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		KOSTEN (000S)		BESCHREIBUNG		ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS 30. JUNI 2024	AKTIEN			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024	AKTIEN	
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	10.329.856	\$	102.936	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	11.500.141	\$ 114.600
	<b>PARI (000S)</b>				<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Notes</b>				<b>U.S. Treasury Bonds</b>		
4,500 % fällig am 15.11.2033	\$	15.900	16.348	2,500 % fällig am 15.02.2046	\$	14.600 10.429
<b>U.S. Treasury Notes</b>				<b>U.S. Treasury Notes</b>		
4,625 % fällig am 30.04.2029		9.500	9.486	4,625 % fällig am 30.04.2029		9.500 9.540
<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>				<b>U.S. Treasury Notes</b>		
5,000 % fällig am 01.01.2054		5.700	5.615	2,750 % fällig am 15.08.2032		10.000 9.037
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>				<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>		
2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)		5.336	5.310	5,000 % fällig am 01.01.2054		5.692 5.560
<b>U.S. Treasury Bonds</b>				<b>South Africa Government International Bond</b>		
4,250 % fällig am 15.02.2054		4.600	4.401	10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	62.900 3.392
<b>U.S. Treasury Bonds</b>				<b>U.S. Treasury Bonds</b>		
1,375 % fällig am 15.08.2050		5.300	2.649	1,375 % fällig am 15.08.2050	\$	5.300 2.683
<b>U.S. Treasury Notes</b>				<b>New York Life Global Funding</b>		
2,750 % fällig am 15.02.2032		2.900	2.579	1,200 % fällig am 07.08.2030		2.800 2.245
<b>Duke Energy Corp.</b>				<b>Guardian Life Global Funding</b>		
3,750 % fällig am 01.04.2031	€	2.000	2.156	1,100 % fällig am 23.06.2025		2.300 2.204
<b>United Kingdom Gilt</b>				<b>Southern California Edison Co.</b>		
4,375 % fällig am 31.07.2054	£	1.530	1.934	6,650 % fällig am 01.04.2029		2.035 2.151
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b>				<b>Reliance Standard Life Global Funding</b>		
6,428 % fällig am 22.04.2028	\$	1.900	1.900	2,500 % fällig am 30.10.2024		2.200 2.145
<b>Citibank N.A.</b>				<b>Nomura Holdings, Inc.</b>		
5,570 % fällig am 30.04.2034		1.750	1.756	5,386 % fällig am 06.07.2027		2.100 2.116
<b>Las Vegas Sands Corp.</b>				<b>Philip Morris International, Inc.</b>		
3,900 % fällig am 08.08.2029		1.900	1.740	5,125 % fällig am 15.02.2030		2.000 2.005
<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>				<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>		
4,125 % fällig am 17.08.2027		1.775	1.679	3,272 % fällig am 29.09.2025		1.800 1.788
<b>Barclays PLC</b>				<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		
5,851 % fällig am 21.03.2035	£	1.300	1.657	0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)		1.698 1.672
<b>Edison International</b>				<b>Hyundai Capital America</b>		
5,450 % fällig am 15.06.2029	\$	1.600	1.599	2,000 % fällig am 15.06.2028		1.600 1.412
<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b>				<b>Deutsche Bank AG</b>		
4,875 % fällig am 08.02.2036	€	1.400	1.518	6,720 % fällig am 18.01.2029		1.300 1.348
<b>Israel Government International Bond</b>				<b>HSBC Holdings PLC</b>		
5,750 % fällig am 12.03.2054	\$	1.500	1.439	2,357 % fällig am 18.08.2031		1.600 1.324
<b>Energy Transfer LP</b>				<b>Metropolitan Life Global Funding</b>		
5,950 % fällig am 15.05.2054		1.400	1.404	1,875 % fällig am 11.01.2027		1.400 1.290
<b>Barclays PLC</b>				<b>Expedia Group, Inc.</b>		
5,690 % fällig am 12.03.2030		1.400	1.400	5,000 % fällig am 15.02.2026		1.300 1.289

(a) Der US Investment Grade Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2024</b>			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)	\$	44.106	\$ 44.158	Aozora Bank Ltd. 1,050 % fällig am 09.09.2024	\$	16.700	\$ 16.105
Cars Alliance Auto Loans Germany 4,099 % fällig am 18.01.2036	€	19.000	20.623	Barclays PLC 3,932 % fällig am 07.05.2025		15.500	15.448
Federal Home Loan Bank 5,500 % fällig am 20.02.2026	\$	20.000	20.000	Athene Global Funding 6,049 % fällig am 24.05.2024		14.200	14.210
Freddie Mac 5,550 % fällig am 20.02.2026		19.000	19.000	Societe Generale S.A. 2,625 % fällig am 22.01.2025		11.600	11.283
Freddie Mac 5,700 % fällig am 06.03.2026		18.500	18.500	Toyota Motor Credit Corp. 5,860 % fällig am 22.08.2024		8.900	8.912
Freddie Mac 5,650 % fällig am 06.03.2026		18.000	18.000				
Freddie Mac 5,500 % fällig am 13.02.2026		18.000	18.000	<b>AKTIEN</b>			
American Honda Finance Corp. 5,914 % fällig am 12.02.2025		17.200	17.200	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		622.122	6.200
Barclays PLC 2,852 % fällig am 07.05.2026		17.300	16.743				
Citigroup, Inc. 3,106 % fällig am 08.04.2026		16.900	16.473	Societe Generale S.A. 6,408 % fällig am 21.01.2026	\$	2.975	2.979
Boeing Co. 4,875 % fällig am 01.05.2025		16.400	16.217	Citibank N.A. 5,951 % fällig am 30.04.2026		2.400	2.404
Silver Arrow S.A. 5,761 % fällig am 31.01.2031	£	12.300	15.293	Athene Global Funding 2,750 % fällig am 25.06.2024		2.109	2.093
Bayer U.S. Finance LLC 4,250 % fällig am 15.12.2025	\$	15.400	14.994	FS KKR Capital Corp. 1,650 % fällig am 12.10.2024		2.000	1.952
Haleon U.S. Capital LLC 3,024 % fällig am 24.03.2024		15.000	14.954	Societe Generale S.A. 6,408 % fällig am 21.01.2026		1.800	1.802
Federal Home Loan Bank 6,000 % fällig am 03.05.2027		14.500	14.500	RAAC Trust 7,560 % fällig am 25.05.2044		1.336	1.302
Towd Point Mortgage Funding PLC 0,000 % fällig am 20.07.2053	£	10.000	12.436	Societe Generale S.A. 2,625 % fällig am 16.10.2024		1.300	1.278
Goldman Sachs Group, Inc. 3,272 % fällig am 29.09.2025	\$	12.000	11.862	LeasePlan Corp NV 2,875 % fällig am 24.10.2024		600	590
Athene Global Funding 2,500 % fällig am 14.01.2025		11.843	11.541	VF Corp 2,400 % fällig am 23.04.2025		500	482
Societe Generale S.A. 6,408 % fällig am 21.01.2026		11.467	11.478	Schaeffler AG 4,750 % fällig am 14.08.2029	€	300	324
Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % fällig am 01.03.2025		11.350	11.341				
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.04.2025	DKK	78.200	11.001	(a) Der US Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.			
VMware LLC 4,500 % fällig am 15.05.2025	\$	11.000	10.873	(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.			
HCA, Inc. 5,250 % fällig am 15.04.2025		10.600	10.548	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.			
		<b>AKTIEN</b>		Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		99.850	9.980				

## Abkürzungen der Kontrahenten:

<b>AZD</b>	Australia and New Zealand Banking Group	<b>DUB</b>	Deutsche Bank AG	<b>MSC</b>	Morgan Stanley & Co. LLC.
<b>BOA</b>	Bank of America N.A.	<b>FAR</b>	Wells Fargo Bank National Association	<b>MYC</b>	Morgan Stanley Capital Services LLC
<b>BOM</b>	Bank of Montreal	<b>FBF</b>	Credit Suisse International	<b>MYI</b>	Morgan Stanley & Co. International PLC
<b>BOS</b>	BoFA Securities, Inc.	<b>FCT</b>	Credit Suisse Capital LLC	<b>NGF</b>	Nomura Global Financial Products, Inc.
<b>BPG</b>	BNP Paribas Securities Corp.	<b>FICC</b>	Fixed Income Clearing Corporation	<b>NOM</b>	Nomura Securities International, Inc.
<b>BPS</b>	BNP Paribas S.A.	<b>GLM</b>	Goldman Sachs Bank USA	<b>RBC</b>	Royal Bank of Canada
<b>BRC</b>	Barclays Bank PLC	<b>GRE</b>	NatWest Markets Securities, Inc.	<b>RCE</b>	Royal Bank of Canada Europe Limited
<b>BSH</b>	Banco Santander S.A. - New York Branch	<b>GSC</b>	Goldman Sachs & Co. LLC	<b>RYL</b>	NatWest Markets Plc
<b>BSN</b>	The Bank of Nova Scotia - Toronto	<b>GST</b>	Goldman Sachs International	<b>SAL</b>	Citigroup Global Markets, Inc.
<b>BYL</b>	Barclays Bank PLC Niederlassung London	<b>HUS</b>	HSBC Bank USA N.A.	<b>SCX</b>	Standard Chartered Bank, London
<b>CBK</b>	Citibank N.A.	<b>IND</b>	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	<b>SOG</b>	Societe Generale Paris
<b>CDI</b>	Natixis Singapore	<b>JLN</b>	JP Morgan Chase Bank N.A. London	<b>SSB</b>	State Street Bank and Trust Co.
<b>CEW</b>	Canadian Imperial Bank of Commerce World Markets	<b>JML</b>	JP Morgan Securities Plc	<b>STR</b>	State Street FICC Repo
<b>CIB</b>	Canadian Imperial Bank of Commerce	<b>JPM</b>	JP Morgan Chase Bank N.A.	<b>TDM</b>	TD Securities (USA) LLC
<b>CKL</b>	Citibank N.A. London	<b>JPS</b>	J.P. Morgan Securities LLC	<b>TOR</b>	The Toronto-Dominion Bank
<b>CLY</b>	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	<b>MAC</b>	Macquarie Bank Limited	<b>UAG</b>	UBS AG Stamford
<b>COM</b>	Commerz Bank AG	<b>MBC</b>	HSBC Bank Plc	<b>ULO</b>	UBS AG London
<b>DBL</b>	Deutsche Bank AG London	<b>MEI</b>	Merrill Lynch International	<b>WFS</b>	Wells Fargo Securities, LLC
<b>DEU</b>	Deutsche Bank Securities, Inc.	<b>MFK</b>	Barclays Capital, Inc.		

## Währungskürzel:

<b>AED</b>	Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	<b>HUF</b>	Ungarischer Forint	<b>PYG</b>	Paraguayischer Guarani
<b>ARS</b>	Argentinischer Peso	<b>IDR</b>	Indonesische Rupie	<b>QAR</b>	Qatari Riyal
<b>AUD</b>	Australischer Dollar	<b>ILS</b>	Israelischer Schekel	<b>RON</b>	Rumänischer neuer Leu
<b>BRL</b>	Brasilianischer Real	<b>INR</b>	Indische Rupie	<b>RSB</b>	Serbischer Dinar
<b>CAD</b>	Kanadischer Dollar	<b>JPY (oder ¥)</b>	Japanischer Yen	<b>RUB</b>	Russischer Rubel
<b>CHF</b>	Schweizer Franken	<b>KES</b>	Kenia-Schilling	<b>SEK</b>	Schwedische Krone
<b>CLP</b>	Chilenischer Peso	<b>KRW</b>	Südkoreanischer Won	<b>SGD</b>	Singapur-Dollar
<b>CNH</b>	Chinese Renminbi (Offshore)	<b>KWD</b>	Kuwait-Dinar	<b>THB</b>	Thailändischer Baht
<b>CNY</b>	Chinese Renminbi (Mainland)	<b>KZT</b>	Kasachischer Tenge	<b>TRY</b>	Türkische neue Lira
<b>COP</b>	Kolumbianischer Peso	<b>MXN</b>	Mexikanischer Peso	<b>TWD</b>	Taiwanesischer Dollar
<b>CZK</b>	Tschechische Krone	<b>MYR</b>	Malaysischer Ringgit	<b>UGX</b>	Uganda-Schilling
<b>DKK</b>	Dänische Krone	<b>NGN</b>	Nigerianische Naira	<b>USD (oder \$)</b>	US-Dollar
<b>DOP</b>	Dominikanischer Peso	<b>NOK</b>	Norwegische Krone	<b>UYU</b>	Uruguayischer Peso
<b>EGP</b>	Ägyptisches Pfund	<b>NZD</b>	Neuseeland-Dollar	<b>UZS</b>	Usbekischer So'm
<b>EUR (oder €)</b>	Euro	<b>PEN</b>	Peruanischer neuer Sol	<b>VND</b>	Vietnamesischer Dong
<b>GBP (oder £)</b>	Britisches Pfund	<b>PHP</b>	Philippinischer Peso	<b>ZAR</b>	Südafrikanischer Rand
<b>GHS</b>	Ghanaischer Cedi	<b>PKR</b>	Pakistanische Rupie	<b>ZMW</b>	Sambischer Kwacha
<b>HKD</b>	Hongkong-Dollar	<b>PLN</b>	Polnischer Zloty		

## Börsenkürzel:

<b>CBOT</b>	Chicago Board of Trade	<b>FTSE</b>	Financial Times Stock Exchange	<b>OTC</b>	Over the Counter
<b>EUREX</b>	Eurex Exchange				

## Index-/Spread-Kürzel:

<b>ABX.HE</b>	Asset-Backed Securities Index - Home Equity	<b>CNREPOFIX</b>	China Fixing Repo Rates 7-Day		
<b>ACS</b>	Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index	<b>CPALEMU</b>	Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index	<b>NDUEACWF</b>	MSCI ACWI Index Future
<b>AMNAX</b>	Alerian Midstream Energy Total Return Index	<b>CPTFEMU</b>	Eurozone HICP ex-Tobacco Index	<b>PIMCODBU</b>	PIMCO Custom Commodity Basket
<b>AMZX</b>	Alerian MLP Total Return Index	<b>CPURNSA</b>	Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index	<b>PrimeX.ARM</b>	Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage
<b>BCOMF1TC</b>	Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return	<b>DAX</b>	Deutscher Aktien Index 30	<b>S&amp;P 500</b>	Standard & Poor's 500 Index
<b>BCOMTR</b>	Bloomberg Commodity Index Total Return	<b>FRCPXTOB</b>	Französischer Verbraucherpreisindex ohne Tabak	<b>SIBCSORA</b>	Singapore Overnight Rate Average
<b>BCOMTR1</b>	Bloomberg Custom Commodity Index	<b>FTSE/JSE</b>	South African Performance Index	<b>SONIO</b>	Sterling Overnight Interbank Average Rate
<b>BOVESPA</b>	Brazil Bovespa Index	<b>FTSE/MIB</b>	Index der 40 italienischen Aktien mit der höchsten Liquidität/Marktkapitalisierung der Borsa Italiana	<b>SPI 200</b>	Australian Equity Futures Index
<b>CAC</b>	Cotation Assistée en Continu	<b>IBEX 35</b>	Spanish Continuous Exchange Index	<b>SRFXON3</b>	Swiss Overnight Rate Average (6PM)
<b>CAONREPO</b>	Canadian Overnight Repo Rate Average	<b>IBR</b>	Indicador Bancario de Referencia	<b>TOPIX</b>	Tokyo Price Index
<b>CDX.EM</b>	Credit Derivatives Index — Emerging Markets	<b>JMABDEWU</b>	J.P. Morgan Custom	<b>TRNGLU</b>	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD
<b>CDX.HY</b>	Credit Derivatives Index - High Yield	<b>JMABNIU5</b>	J.P. Morgan Custom Commodity Index	<b>UKRPI</b>	United Kingdom Retail Prices Index
<b>CDX.IG</b>	Credit Derivatives Index – Investment Grade	<b>KOSPI</b>	Korea Composite Stock Price Index	<b>VSTOXX</b>	Euro Stoxx 50 Volatility Index
<b>CIXBSTR3</b>	Individuell zusammengestellter Rohstoffindex	<b>KOSPI2</b>	Korea Stock Exchange KOSPI 200 Index	<b>WIG20</b>	Nach Marktkapitalisierung gewichteter Börsenindex der 20 größten Unternehmen an der Warschauer Börse
<b>CMBX</b>	Commercial Mortgage-Backed Index	<b>MUTKCALM</b>	Tokyo Overnight Average Rate		

## Kommunalanleihen- oder Behördenkürzel:

<b>AGM</b>	Assured Guaranty Municipal	<b>NPFGC</b>	National Public Finance Guarantee Corp.	<b>ST</b>	State
------------	----------------------------	--------------	-----------------------------------------	-----------	-------

## Sonstige Kürzel:

<b>ABS</b>	Asset-Backed Security	<b>FED</b>	Federal Reserve	<b>REIT</b>	Real Estate Investment Trust
<b>ALT</b>	Alternate Loan Trust	<b>HIBOR</b>	Hong Kong Interbank Offered Rate	<b>REMIC</b>	Real Estate Mortgage Investment Conduit
<b>BABs</b>	Build America Bonds	<b>JIBAR</b>	Johannesburg Interbank Agreed Rate	<b>RMBS</b>	Residential Mortgage-Backed Security
<b>BBR</b>	Bank Bill Rate	<b>JSC</b>	Joint Stock Company	<b>STIBOR</b>	Stockholm Interbank Offered Rate
<b>BBSW</b>	Bank Bill Swap Reference Rate	<b>KLIBOR</b>	Kuala Lumpur Interbank Offered Rate	<b>TAIBOR</b>	Taipei Interbank Offered Rate
<b>BRL-CDI</b>	Brazil Interbank Deposit Rate	<b>KORIBOR</b>	Korea Interbank Offered Rate	<b>TBA</b>	To-Be-Announced
<b>BTP</b>	Buoni del Tesoro Poliennali „Long-term Treasury Bond“	<b>LIBOR</b>	London Interbank Offered Rate	<b>TBD</b>	To-Be-Determined
<b>CBO</b>	Collateralized Bond Obligation	<b>MIBOR</b>	Mumbai Interbank Offered Rate	<b>TBD %</b>	Bei Abrechnung des Darlehens oder zum Zeitpunkt der Finanzierung zu ermittelnder Zinssatz
<b>CREST</b>	Certificateless Registry for Electronic Share Transfer	<b>MSCI</b>	Morgan Stanley Capital International	<b>TELBOR</b>	Tel Aviv Inter-Bank Offered Rate
<b>CDO</b>	Collateralized Debt Obligation (besicherte Schuldverschreibungen)	<b>NIBOR</b>	Norwegian Interbank Offered Rate	<b>THB-THORON</b>	Thai Overnight Repurchase Rate
<b>CHILIBOR</b>	Chile Interbank Offered Rate	<b>OAT</b>	Obligations Assimilables du Trésor	<b>TIIE</b>	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio „Gleichgewichtszinssatz im Interbankengeschäft“
<b>CLO</b>	Collateralized Loan Obligation (durch Kreditportfolio besicherte Wertpapiere)	<b>OIS</b>	Overnight Index Swap	<b>WIBOR</b>	Warsaw Interbank Offered Rate
<b>DAC</b>	Designated Activity Company	<b>PIK</b>	Payment-in-Kind (Sachausschüttung)		
<b>EURIBOR</b>	Euro Interbank Offered Rate	<b>PRIBOR</b>	Prague Interbank Offered Rate		

**VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited,  
Third Floor,  
Harcourt Building,  
Harcourt Street,  
Dublin,  
D02 F721,  
Irland.

**ANLAGEBERATUNGSGESELLSCHAFT**

Pacific Investment Management  
Company LLC,  
650 Newport Center Drive,  
Newport Beach, Kalifornien 92660,  
USA.

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
Großbritannien.

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

PIMCO Europe GmbH,  
Seidlstraße 24-24a,  
80335 München  
Deutschland.

**ADMINISTRATOR**

State Street Fund Services (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

**VERWAHRSTELLE**

State Street Custodial Services (Ireland)  
Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

**VERTRIEBSSTELLEN**

PIMCO Europe GmbH,  
Seidlstraße 24-24a,  
80335 München  
Deutschland.

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
Großbritannien.

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

PIMCO Asia Limited,  
22nd Floor, Suite 2201,  
Two International Finance Centre,  
8 Finance Street, Central,  
Hongkong.

PIMCO Australia Pty Ltd.,  
Level 19, 5 Martin Place,  
363 George Street,  
Sydney, New South Wales 2000,  
Australien.

**ZAHLSTELLE IN ÖSTERREICH**

UniCredit Bank Austria AG,  
Schottengasse 6-8,  
1010 Wien,  
Österreich.

**REPRÄSENTANZ IN SINGAPUR**

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

**ITALIENISCHE  
KORRESPONDENZBANKEN**

Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.,  
Piazza Velasca, 7/9,  
20122 Mailand,  
Italien.

State Street Bank International GmbH  
– Succursale Italia,  
Via Ferrante Aporti, 10,  
Mailand,  
Italien.

Société Générale Securities Services  
S.p.A. („SGSS“),  
Via Santa Chiara, 19,  
Turin,  
Italien.

AllFunds Bank S.A.U.,  
Succursale di Milano,  
Via Bocchetto, 6,  
20123 Mailand,  
Italien.

Banca Sella Holding S.p.A.,  
Piazza Gaudenzio Sella, 1,  
13900 Biella,  
Italien.

Monte dei Paschi di Siena S.p.A.,  
Via Verii, 14,  
Mantua,  
Italien.

RBC Investor Services Bank S.A.,  
Niederlassung Mailand,  
Via Vittor Pisani, 26,  
20124 Mailand,  
Italien.

CACEIS Bank, Niederlassung Italien,  
Piazza Cavour 2,  
20121 Mailand,  
Italien.

**REPRÄSENTANZ IN HONGKONG**

PIMCO Asia Limited,  
22nd Floor, Suite 2201,  
Two International Finance Centre,  
8 Finance Street,  
Hongkong.

**ZAHLSTELLE UND REPRÄSENTANZ  
IN LUXEMBURG**

Société Générale Luxembourg,  
(Centre Opérationel/FED),  
28-32, Place de la Gare,  
L-1616, Luxemburg.

**ZAHLSTELLE UND REPRÄSENTANZ  
IN DER SCHWEIZ**

BNP PARIBAS Paris,  
Niederlassung Zürich,  
Selnaustrasse 16,  
8002 Zürich,  
Schweiz.

**REPRÄSENTANZ IM VEREINIGTEN  
KÖNIGREICH**

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
Großbritannien.

**ZAHLSTELLE IN BELGIEN**

ABN AMRO BANK S.A.,  
Borsbeeksebrug 30,  
2600 Antwerpen,  
Belgien.

**DEUTSCHE ZAHL- UND  
INFORMATIONSTELLE**

Marcard, Stein & Co AG,  
Ballindamm 36,  
20095 Hamburg,  
Deutschland.

**ZAHLSTELLE IN PORTUGAL**

Banco Activobank (Portugal) S.A.,  
Rua Augusta 86,  
1149-023, Lissabon,  
Portugal.

**ZAHLSTELLE IN SCHWEDEN**

SEB Merchant Banking,  
SE-106 40,  
Stockholm,  
Schweden.

**ZAHLSTELLE IN GRIECHENLAND**

Eurobank Asset Management M.F.M.C.,  
10 Stadiou Street,  
GR 10564 Athen,  
Griechenland.

**ZAHLSTELLE IN UNGARN**

European Investment Centre,  
Tomasikova 64,  
831 04 Bratislava,  
Slowakische Republik.

**ZAHLSTELLE IN DER  
TSCHECHISCHEN REPUBLIK**

European Investment Centre,  
Veveří 2581/102,  
616 00 Brno,  
Tschechische Republik.

**ZENTRALSTELLE UND  
FINANZVERMITTLER IN FRANKREICH**

Société Générale,  
29, Boulevard Haussmann,  
75009 Paris,  
Frankreich.

**ZAHLSTELLE IN LIECHTENSTEIN**

LGT Bank Ltd.,  
Herrengasse 12,  
FL-9490 Vaduz,  
Liechtenstein.

**ZAHLSTELLE AUF ZYPERN**

EUROBANK CYPRUS LTD.,  
28, Spyrou Kyprianou Avenue,  
1075 Nikosia,  
Zypern.

**RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT**

Dillon Eustace LLP,  
33 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 XK09,  
Irland.

**RECHTSBERATER FÜR US-RECHT**

Dechert LLP,  
1900 K Street N.W.,  
Washington, D.C. 20006,  
USA.

**UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER**

PricewaterhouseCoopers  
Chartered Accountants und Statutory  
Audit Firm,  
One Spencer Dock,  
North Wall Quay,  
Dublin 1,  
D01 X9R7,  
Irland.

**SEKRETÄR**

Walkers Corporate Services (Ireland) Limited,  
The Exchange,  
George's Dock,  
Dublin D01 P2V6,  
Irland.

**BETREUENDER MAKLER**

Dillon Eustace LLP,  
33 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 XK09,  
Irland.

**INGETRAGENER GESCHÄFTSSITZ**

PIMCO Funds: Global Investors  
Series plc,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

**VERWALTUNGSRAT DER  
GESELLSCHAFT UND  
VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

V. Mangala Ananthanarayanan<sup>1</sup> (Indien)  
Ryan P. Blute<sup>1</sup> (USA)  
Craig A. Dawson<sup>1</sup> (USA)  
David M. Kennedy (unabhängiges  
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)  
Frances Ruane (unabhängiges  
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)

Der Prospekt, die Prospektergänzungen, die Gründungsurkunde und Satzung, die Basisinformationsblätter sowie die Jahres- und Halbjahresberichte sind kostenlos in der Geschäftsstelle der Repräsentanz oder der Vertreter im jeweiligen Land erhältlich.

Eine Kopie der Liste der Portfolioveränderungen in dem am 30. Juni 2024 abgelaufenen Berichtszeitraum kann von den Anteilhabern kostenlos bei der Verwahrstelle oder den Zahlstellen sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Repräsentanz in der Schweiz bezogen werden.

<sup>1</sup> Mitarbeiter von PIMCO.

**PIMCO Europe Ltd (Registernummer 2604517, 11 Baker Street, London W1U 3AH, Vereinigtes Königreich)** wurde von der Financial Conduct Authority (FCA) (12 Endeavour Square, London E20 1JN) im Vereinigten Königreich zugelassen und steht unter deren Aufsicht. Die von PIMCO Europe Ltd erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Kleinanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.

**PIMCO Europe GmbH (Registernummer 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 München, Deutschland), die italienische Niederlassung der PIMCO Europe GmbH (Registernummer 10005170963), via Turati nn. 25/27 (angolo via Cavaliere n. 4), 20121 Mailand, Italien), die irische Niederlassung der PIMCO Europe GmbH (Registernummer 909462, 57B Harcourt Street Dublin D02 F721, Irland), die britische Niederlassung der PIMCO Europe GmbH (Registernummer 2604517, 11 Baker Street, London W1U 3AH, Vereinigtes Königreich), die spanische Niederlassung der PIMCO Europe GmbH (N.I.F. W2765338E, Paseo de la Castellana 43, Oficina 05-111, 28046 Madrid, Spanien) und die französische Niederlassung der PIMCO Europe GmbH (Registernummer 918745621 R.C.S. Paris, 50-52 Boulevard Haussmann, 75009 Paris, Frankreich)** sind von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) (Marie-Curie-Str. 24-28, 60439 Frankfurt am Main) in Deutschland zugelassen und werden von dieser gemäß § 15 des Gesetzes zur Beaufsichtigung von Wertpapierinstituten (WpIG) reguliert. Die italienische, irische, britische, spanische und französische Niederlassung werden zusätzlich von folgenden Behörden beaufsichtigt:

(1) Niederlassung Italien: die Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) (Giovanni Battista Martini, 3 — 00198 Rom) gemäß Artikel 27 des Testo unico delle disposizioni in materia di intermediazione finanziaria (Einheitsgesetz über die Finanzvermittlung); (2) Niederlassung Irland: die Zentralbank von Irland (New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1 D01 F7X3) gemäß Verordnung 43 der EU-Verordnungen (Märkte für Finanzinstrumente) von 2017 in der jeweils gültigen Fassung; (3) Niederlassung Vereinigtes Königreich: die Financial Conduct Authority (FCA) (12 Endeavour Square, London E20 1JN); (4) Niederlassung Spanien: die Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) (Edison, 4, 28006 Madrid) gemäß den Verpflichtungen in Artikel 168 und 203 bis 224 sowie den Verpflichtungen in Titel V, Artikel I des Ley del Mercado de Valores (LSM) (Gesetz über den Wertpapiermarkt) und in Artikel 111, 114 und 117 des Real Decreto 217/2008 und (5) Niederlassung Frankreich: ACPR/Banque de France (4 Place de Budapest, CS 92459, 75436 Paris Cedex 09) gemäß Art. 35 der Richtlinie 2014/65/EU über Märkte für Finanzinstrumente und unter der Aufsicht von ACPR und AMF. Die von PIMCO Europe GmbH erbrachten Dienstleistungen stehen nur professionellen Kunden im Sinne von § 67 Abs. 2 WpHG (Wertpapierhandelsgesetz) zur Verfügung. Sie sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten.

**PIMCO (Schweiz) GmbH (eingetragen in der Schweiz, Registernummer CH-020.4.038.582-2, Brandschenkestrasse 41 Zürich 8002, Schweiz).** Die von PIMCO (Schweiz) GmbH erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Kleinanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.