



ALLIANCEBERNSTEIN®

HALBJAHRESBERICHT

AB FCP I

Multi-Asset/Asset Allocation

- DYNAMIC DIVERSIFIZIERT PORTFOLIO

Equity

- GLOBAL EQUITY BLEND PORTFOLIO
- EMERGING MARKETS GROWTH PORTFOLIO
- ASIA EX-JAPAN EQUITY PORTFOLIO
- JAPAN STRATEGIC VALUE PORTFOLIO
- CHINA LOW VOLATILITY EQUITY PORTFOLIO

Fixed Income

- SHORT DURATION BOND PORTFOLIO
- GLOBAL HIGH YIELD PORTFOLIO
- AMERICAN INCOME PORTFOLIO
- EUROPEAN INCOME PORTFOLIO
- EMERGING MARKETS DEBT PORTFOLIO
- MORTGAGE INCOME PORTFOLIO

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

RCS: K217

Auf Grundlage der Berichte können keine Zeichnungsaufträge eingereicht werden. Zeichnungen sind nur wirksam, wenn sie auf Grundlage des Dokuments mit wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) und des aktuellen Verkaufsprospekts in Verbindung mit dem Jahresbericht oder dem jüngsten Halbjahresbericht, falls dieser später herausgegeben wurde, erfolgen.

Nachhaltigkeitsbezogene Informationen, die gemäss Verordnung (EU) 2019/2088 (SFDR) erforderlich sind, sind im Abschnitt „Informationen für Anteilhaber“ verfügbar.

Das [A/B] Logo ist eine Dienstleistungsmarke von AllianceBernstein, und AllianceBernstein® ist ein eingetragenes Warenzeichen, das mit Erlaubnis des Inhabers, AllianceBernstein L.P., verwendet wird.

	Seite
Brief an die Anteilhaber	1
Wertentwicklung der Anteile	2
Verzeichnis der Anlagewerte	11
Zusammensetzung des Fondsvermögens.	122
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens.	126
Umlaufende Anteile	129
Statistische Informationen	135
Anmerkungen zum Halbjahresabschluss	149
Tabelle 1 – Gebührenstruktur.	168
Tabelle 2 – Portefeuilleumsatz.	179
Informationen für die Anteilhaber (ungeprüft).	180

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

20. März 2024

Sehr geehrte Anteilinhaber,

der vorliegende Bericht bietet Ihnen eine aktuelle Übersicht über AB FCP I (der „Fonds“) für den Halbjahresberichtszeitraum zum 29. Februar 2024.

In dem Sechsmonatszeitraum zum 29. Februar 2024 verzeichneten US-Aktien, internationale Aktien und Schwellenmarkt-Aktien Kursgewinne. Die globalen Zentralbanken – angeführt von der US-Notenbank Federal Reserve („Fed“) – begannen die Zinserhöhungen auszusetzen, doch die Aktienmärkte waren weiterhin von einer erhöhten Volatilität geprägt, während die restriktive Rhetorik der Zentralbanken auf „längerfristig höhere“ Zinsen hindeutete. Im Oktober führte das unerwartet starke Wirtschaftswachstum im dritten Quartal zu einem raschen Anstieg der Anleiherenditen, insbesondere bei der 10-jährigen US-Staatsanleihe, die erstmals seit 16 Jahren die Schwelle von 5% kurzzeitig überschritten hat. Gegenwind durch höhere Renditen bei Staatsanleihen, Konflikte im Nahen Osten und die Sorge, dass die Stärke der Wirtschaft und des Arbeitsmarktes eine weitere Straffung rechtfertigen könnte, belastete die Stimmung der Anleger weltweit und führte zu kurzfristigen Korrekturen bei allen wichtigen Indizes.

Die globalen Aktienmärkte legten im November zu, da die Inflation weiter abkühlte, die Konsumausgaben widerstandsfähig blieben und die US-Wirtschaft rascher wuchs als erwartet. Die Erwartungen an eine „sanfte Landung“ in den USA gewannen angesichts des Optimismus der Anleger, dass die Fed bereits in der zweiten Jahreshälfte damit beginnen könnte, die Zinsen zu senken, an Dynamik. Obwohl die Aktienmärkte in den Schwellenländern sich in diesem Zeitraum erholten, belasteten Chinas schleppende Konjunkturerholung, der problematische Immobiliensektor und das Fehlen wichtiger fiskalischer Impulse die Performance der Schwellenländer. An den Large-Cap-Märkten legten sowohl Wachstums- als auch Substanzwerte zu, wobei Wachstumswerte besser abschnitten als Substanzwerte, angeführt vom Technologiesektor und dem Optimismus in Bezug auf künstliche Intelligenz. Large-Cap-Aktien entwickelten sich besser als Small-Cap-Aktien, obwohl beide in absoluten Zahlen stiegen.

Die Renditen auf den Märkten für festverzinsliche Staatsanleihen waren volatil, da die Anleger ihre Erwartungen an die Inflation, das Wirtschaftswachstum und die Entscheidungen der Zentralbanken anpassten. Die globalen Renditen der Industrieländer erreichten Mitte Oktober ihren Höchststand, um dann Ende 2023 zu fallen und in den ersten beiden Monaten des Jahres wieder anzusteigen, als die Anleger eine erneute Abstimmung auf den Zeitpunkt und den Umfang der Zinssenkungen der grossen Zentralbanken im Laufe des Jahres 2024 vornahm. Die Renditen von Staatsanleihen entwickelten sich in diesem Zeitraum in allen grossen Industrieländern durchweg positiv und stiegen in Italien, der Schweiz, Neuseeland und Spanien am stärksten und in den USA am wenigsten. Insgesamt stiegen die Investment-Grade-Unternehmensanleihen der Industrieländer und übertrafen die Staatsanleihen. Auch in den USA und der Eurozone übertrafen sie die jeweiligen Märkte für Staatsanleihen.

Hochverzinsliche Unternehmensanleihen aus Industrieländern legten zu und übertrafen die Märkte für Staatsanleihen deutlich, insbesondere in den USA und in der Eurozone. Staatsanleihen der Schwellenländer in Hartwährung übertrafen die Staatsanleihen der Industrieländer. Auch Unternehmensanleihen in Hartwährung aus Schwellenländern entwickelten sich insgesamt gut und schnitten hinsichtlich der Kreditqualität besser ab als Investment-Grade- und Hochzinsanleihen von Unternehmen in Industrieländern. Hochzinsanleihen übertrafen Investment-Grade-Titel sowohl bei den Staatsanleihen als auch bei den Unternehmensanleihen der Schwellenländer. Anleihen aus Schwellenländern in lokaler Währung blieben hinter anderen riskanten Anleihesektoren zurück, da der US-Dollar in diesem Zeitraum gegenüber der Mehrheit der Währungen stieg.

Wir danken Ihnen für Ihre Anlage in den Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

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

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global Equity Blend Portfolio				
Klasse				
A	7.27%	13.47%	10.27%	172.90%
A EUR	7.63%	11.04%	2.18%	197.41%
A EUR H	6.17%	10.96%	6.63%	52.53%
A SGD	6.80%	13.22%	6.63%	76.60%
B	6.72%	12.27%	9.17%	122.30%
B SGD	6.28%	12.09%	5.58%	46.74%
C	7.02%	12.93%	9.76%	109.76%
C EUR	7.40%	10.61%	1.85%	-1.27%
I	7.72%	14.36%	11.14%	222.50%
I EUR	8.04%	11.89%	3.02%	251.36%
S HKD	8.16%	15.41%	12.36%	205.26%
S1	7.98%	14.91%	11.63%	213.35%
S1 EUR	8.29%	12.42%	3.49%	260.62%
S1 GBP	8.33%	9.47%	2.41%	308.73%
S1 SGD	7.50%	14.65%	7.98%	117.35%
Emerging Markets Growth Portfolio				
Klasse				
A	4.00%	2.88%	-2.92%	328.70%
A AUD H	2.96%	0.68%	-5.84%	18.33%
A EUR	4.37%	0.71%	-10.04%	141.24%
A HKD	3.84%	2.63%	-2.99%	27.93%
A PLN H	3.85%	3.66%	-0.47%	-2.04%
A SGD	3.55%	2.67%	-6.09%	35.60%
A SGD H	2.98%	0.93%	-4.58%	-5.53%
AD	4.00%	2.88%	-2.93%	19.52%
B	3.51%	1.87%	-3.91%	215.50%
C	3.78%	2.41%	-3.37%	123.10%
C EUR	4.13%	0.25%	-10.41%	111.61%
ED	3.56%	1.90%	-3.91%	-16.97%
I	4.44%	3.72%	-2.15%	199.10%
I AUD H	3.37%	1.50%	-5.01%	30.80%
I EUR	4.77%	1.51%	-9.29%	190.79%
N	3.78%	2.40%	-3.32%	39.20%
S1	4.53%	3.91%	-1.97%	171.75%
S1 EUR	4.86%	1.70%	-9.09%	225.81%
S1 GBP	4.90%	-0.96%	-10.05%	298.64%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio				
Klasse				
A	6.82%	6.18%	-1.51%	53.53%
A AUD H	6.05%	4.23%	-4.57%	46.13%
A EUR	7.20%	3.90%	-8.73%	113.21%
A HKD	6.68%	5.94%	-1.61%	55.15%
A SGD H	5.94%	4.29%	-3.38%	7.07%
AD	6.82%	6.22%	-1.48%	53.62%
AD AUD H	6.03%	4.21%	-4.53%	46.38%
AD CAD H	6.55%	5.34%	-2.89%	7.27%
AD EUR	7.20%	3.92%	-8.70%	113.42%
AD EUR H	5.95%	3.94%	-4.94%	5.32%
AD GBP H	6.58%	5.27%	-3.60%	19.67%
AD HKD	6.68%	5.93%	-1.61%	55.22%
AD NZD H	6.67%	5.56%	-3.72%	40.78%
AD ZAR H	8.32%	8.83%	-0.18%	112.71%
AY JPY	10.10%	16.94%	3.13%	148.79%
BY JPY	9.85%	16.39%	2.65%	134.84%
C	6.61%	5.73%	-1.98%	44.00%
C EUR	6.91%	3.37%	-9.24%	99.80%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Asia Ex-Japan Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
ED	6.38%	5.18%	-2.53%	-9.78%
ED AUD H	5.50%	3.14%	-5.49%	-6.63%
I	7.27%	7.04%	-0.70%	72.20%
I EUR	7.66%	4.78%	-8.04%	139.14%
I GBP	7.64%	2.00%	-9.00%	53.13%
S	7.81%	8.16%	0.29%	100.73%
S HKD	7.64%	7.87%	0.21%	76.36%
S1	7.31%	7.18%	-0.61%	76.20%
S1 EUR	7.70%	4.89%	-7.87%	144.94%
SD	7.81%	8.15%	0.29%	63.04%

Japan Strategic Value Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A	11.68%	29.85%	18.45%	59.16%
A CZK H	15.67%	39.24%	26.67%	47.96%
A EUR	8.72%	15.44%	4.89%	36.84%
A EUR H	13.84%	34.43%	20.73%	153.27%
A SGD	7.92%	17.69%	9.38%	3.80%
A SGD H	13.82%	34.79%	22.67%	60.93%
A USD	8.43%	17.98%	13.11%	23.69%
A USD H	14.76%	36.85%	23.95%	225.07%
AD	11.68%	29.86%	18.46%	97.38%
AD AUD H	14.05%	34.82%	21.60%	109.70%
AD NZD H	14.69%	36.80%	23.45%	128.00%
AD USD H	14.74%	36.76%	23.86%	105.35%
AD ZAR H	16.62%	41.31%	27.41%	241.10%
C	11.30%	28.94%	17.49%	46.52%
C EUR	8.37%	14.61%	3.98%	34.94%
C EUR H	13.46%	33.46%	19.72%	133.73%
C USD	8.01%	17.06%	12.16%	13.91%
I	12.13%	30.91%	19.37%	84.16%
I EUR	9.18%	16.33%	5.64%	69.63%
I EUR H	14.28%	35.41%	21.60%	182.20%
I USD	8.82%	18.88%	14.02%	43.22%
I USD H	15.20%	37.86%	24.87%	258.27%
S1 EUR	9.23%	16.45%	5.77%	67.47%
S1 USD	8.87%	19.00%	14.13%	51.32%
SD	12.54%	31.88%	20.30%	144.71%

China Low Volatility Equity Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A	-2.55%	-11.03%	-12.02%	308.80%
A EUR	-2.22%	-12.94%	-18.47%	129.91%
A HKD	-2.71%	-11.27%	-12.10%	2.84%
A PLN H	-2.31%	-10.14%	-10.24%	-29.35%
AD	-2.53%	-11.09%	-12.10%	7.52%
AD AUD H	-3.21%	-12.90%	-15.03%	-3.24%
AD CAD H	-2.75%	-11.84%	-13.16%	-2.89%
AD EUR H	-3.42%	-13.01%	-15.10%	-12.37%
AD GBP H	-2.67%	-11.69%	-13.75%	-5.54%
AD HKD	-2.71%	-11.27%	-12.09%	9.60%
AD NZD H	-2.69%	-11.71%	-14.24%	3.28%
AD SGD H	-3.43%	-12.73%	-13.77%	-2.08%
AD ZAR H	-1.25%	-9.28%	-11.44%	50.70%
B	-3.02%	-11.92%	-12.91%	214.10%
B EUR	-2.71%	-13.79%	-19.27%	88.95%
C	-2.77%	-11.46%	-12.42%	-7.36%
C EUR	-2.48%	-13.36%	-18.83%	11.49%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
China Low Volatility Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
I.....	-2.16%	-10.29%	-11.30%	403.00%
I EUR.....	-1.86%	-12.26%	-17.81%	168.75%
S1.....	-2.02%	-10.08%	-11.07%	85.66%
S1 EUR.....	-1.70%	-11.99%	-17.58%	138.84%

Short Duration Bond Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A.....	2.79%	4.44%	1.75%	120.66%
A EUR.....	3.04%	2.23%	-5.71%	28.67%
A2.....	2.60%	4.40%	1.75%	77.56%
A2 EUR.....	3.00%	2.21%	-5.72%	28.37%
A2 EUR H.....	1.76%	2.44%	-0.73%	-7.53%
A2 HKD.....	2.49%	4.15%	1.67%	35.40%
A2 SGD H.....	2.00%(1)	-	-	2.00%
AA.....	2.61%	4.39%	1.79%	4.29%
AA AUD H.....	1.95%	2.95%	0.33%	5.75%
AA CAD H.....	2.28%	3.73%	1.30%	1.24%
AA GBP H.....	2.47%	3.89%	0.81%	-2.88%
AA HKD.....	2.48%	4.15%	1.67%	5.32%
AA SGD H.....	1.77%	2.75%	0.72%	0.87%
AJ.....	2.81%	4.58%	1.93%	97.51%
AT.....	2.66%	4.30%	1.76%	59.69%
AT AUD H.....	1.96%	3.01%	0.36%	22.36%
AT CAD H.....	2.37%	3.76%	1.27%	7.40%
AT EUR.....	2.89%	2.07%	-5.70%	68.19%
AT EUR H.....	1.78%	2.44%	-0.70%	-8.35%
AT GBP H.....	2.46%	3.82%	0.81%	0.10%
AT HKD.....	2.48%	4.14%	1.66%	35.29%
AT NZD H.....	2.58%	4.30%	1.42%	14.14%
AT SGD H.....	1.74%	2.76%	0.75%	-0.04%
AX.....	2.68%	4.69%	2.05%	189.84%
C.....	2.45%	4.03%	1.34%	56.83%
C2.....	2.51%	3.99%	1.30%	52.88%
I.....	2.97%	5.08%	2.37%	151.29%
I2.....	2.96%	5.02%	2.33%	46.92%
I2 EUR H.....	2.11%	3.03%	-0.20%	-0.13%
IT.....	2.96%	5.00%	2.33%	9.76%
N2.....	2.38%	3.91%	1.28%	-2.60%
NT.....	2.32%	3.86%	1.27%	-2.74%
S.....	3.20%	5.51%	2.85%	6.63%
S1.....	3.07%	3.64%(2)	-	3.64%
S1 2.....	3.04%	5.23%	2.63%	15.33%
S1 2 EUR.....	3.42%	3.02%	-4.91%	33.31%
S1 EUR H.....	2.23%	2.57%(2)	-	2.57%
SA.....	3.20%	5.54%	2.85%	17.88%

Global High Yield Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A.....	6.81%	10.50%	6.72%	256.57%
A EUR.....	7.15%	8.34%	-0.82%	198.29%
A2.....	6.80%	10.77%	7.01%	290.07%
A2 CHF H.....	4.63%	6.17%	2.48%	0.87%
A2 EUR.....	7.17%	8.41%	-0.80%	218.53%
A2 EUR H.....	5.82%	8.51%	3.99%	56.40%
A2 HKD.....	6.65%	10.49%	6.93%	209.96%
A2 PLN H.....	7.10%	12.11%	9.67%	12.50%
A2 SGD.....	6.35%	10.55%	3.50%	68.62%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
A2 SGD H	5.84%	8.89%	5.55%	46.13%
AA	6.83%	10.78%	6.99%	30.92%
AA AUD H	5.81%	8.86%	5.00%	25.82%
AA CAD H	6.42%	9.86%	6.07%	18.59%
AA EUR H	5.83%	8.46%	3.91%	5.20%
AA GBP H	6.49%	10.06%	5.41%	13.43%
AA HKD	6.66%	10.49%	6.92%	28.11%
AA NZD H	6.51%	10.47%	6.19%	28.76%
AA RMB H	5.45%	7.62%	3.86%	41.47%
AA SGD H	5.82%	8.92%	5.57%	22.22%
AA ZAR H	8.28%	13.85%	9.64%	98.27%
AK	6.75%	10.72%	7.03%	35.53%
AK EUR	7.19%	8.37%	-0.88%	63.16%
AK EUR H	5.82%	8.48%	3.90%	12.36%
AR EUR H	5.81%	8.41%	3.79%	6.68%
AT	6.86%	10.57%	7.11%	335.56%
AT AUD H	5.90%	8.92%	4.89%	93.86%
AT CAD H	6.35%	9.81%	6.13%	48.07%
AT EUR	7.20%	8.39%	-0.87%	165.65%
AT EUR H	5.82%	8.50%	3.90%	55.49%
AT GBP H	6.40%	9.86%	5.34%	48.86%
AT HKD	6.67%	10.48%	6.90%	210.41%
AT NZD H	6.57%	10.39%	6.04%	49.08%
AT RMB H	5.47%	7.63%	3.85%	78.53%
AT SGD	6.31%	10.67%	3.51%	104.89%
AT SGD H	5.77%	8.85%	5.57%	45.88%
B	6.48%	9.85%	5.77%	170.38%
B2	6.26%	9.64%	5.97%	246.05%
BT	6.46%	9.84%	5.79%	168.10%
BT AUD H	5.43%	7.87%	3.90%	69.20%
C	6.46%	10.15%	6.39%	199.31%
C EUR	6.86%	7.76%	-1.35%	161.75%
C2	6.52%	10.19%	6.52%	140.00%
C2 EUR	6.93%	7.87%	-1.33%	186.95%
C2 EUR H	5.54%	7.97%	3.46%	21.93%
CT	6.55%	10.27%	6.51%	43.23%
EA	6.54%	10.22%	6.48%	9.83%
EA AUD H	5.61%	8.39%	4.52%	0.04%
EA ZAR H	8.00%	13.34%	9.17%	25.95%
I	7.15%	11.57%	7.41%	315.97%
I EUR	7.46%	8.99%	-0.23%	238.79%
I2	7.18%	11.34%	7.52%	124.70%
I2 AUD H	6.15%	9.45%	5.41%	93.13%
I2 CHF H	4.83%	6.81%	3.14%	5.67%
I2 EUR	7.48%	8.95%	-0.31%	183.56%
I2 EUR H	6.02%	9.05%	4.53%	67.87%
I2 SGD	6.58%	11.06%	4.05%	77.60%
I2 SGD H	6.07%	9.46%	6.16%	28.07%
IA AUD H	6.11%	9.46%	5.45%	32.62%
IQD	7.18%	11.33%	7.52%	65.29%
IT	7.05%	11.37%	7.58%	41.21%
IT AUD H	6.22%	9.54%	5.43%	38.62%
IT CAD H	6.62%	10.39%	6.63%	34.18%
IT EUR H	6.07%	8.98%	4.43%	-0.08%
IT GBP H	6.83%	10.56%	5.82%	29.03%
IT HKD	6.92%	11.03%	7.46%	42.36%
IT RMB H	5.76%	8.24%	4.37%	55.44%
J	6.23%	9.59%	6.13%	180.11%
N2	6.53%	10.15%	6.43%	31.67%
NT	6.48%	10.15%	6.41%	31.75%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S1	7.21%	11.52%	7.77%	101.33%
S1 EUR H	6.17%	6.63%(2)	–	6.63%
S1D	7.20%	11.53%	7.75%	65.94%
S1D2	7.20%	11.51%	11.18%	19.18%
S1L GBP H	6.84%	9.70%(3)	–	9.70%
SA	7.67%	12.52%	8.72%	52.18%
SHK	7.64%	12.46%	8.70%	50.95%
SK	7.34%	11.81%	8.01%	172.13%
W	7.21%	11.51%	7.66%	11.41%
W EUR	7.56%	9.09%	-0.23%	14.17%
W2	7.17%	11.50%	7.72%	15.67%
W2 CHF H	4.92%	6.94%	3.21%	-3.40%
W2 EUR H	6.14%	9.20%	4.68%	1.33%
WT	7.25%	11.55%	7.71%	15.72%
WT AUD H	6.33%	9.67%	5.67%	6.06%
WT CAD H	6.74%	10.59%	6.79%	7.22%
WT EUR H	6.13%	9.23%	4.68%	0.24%
WT GBP H	6.77%	10.58%	5.98%	4.88%
WT RMB H	5.83%	8.34%	4.49%	11.15%
American Income Portfolio				
Klasse				
A	3.94%	5.83%	1.52%	373.76%
A EUR	4.35%	3.61%	-5.83%	120.24%
A2	3.90%	5.87%	1.61%	238.32%
A2 CHF H	1.62%	1.33%	-2.87%	-3.67%
A2 DUR PH	5.59%	9.66%	9.34%	38.47%
A2 EUR	4.27%	3.61%	-5.81%	118.34%
A2 EUR H	2.90%	3.56%	-1.43%	18.13%
A2 HKD	3.75%	5.60%	1.54%	106.40%
A2 PLN H	4.06%	6.91%	4.05%	5.64%
A2 SGD	3.47%	5.62%	-1.73%	43.19%
A2 SGD H	2.94%	4.02%	0.26%	33.00%
AA	3.89%	5.87%	1.61%	24.72%
AA AUD H	3.10%	4.16%	-0.42%	22.64%
AA CAD H	3.54%	5.06%	0.79%	14.04%
AA DUR PH	5.51%	9.64%	9.38%	37.34%
AA EUR H	2.89%	3.53%	-1.37%	-0.38%
AA GBP H	3.51%	4.98%	0.02%	8.34%
AA HKD	3.75%	5.61%	1.54%	21.14%
AA NZD H	3.55%	5.42%	0.70%	23.48%
AA RMB H	2.62%	2.85%	-1.42%	34.37%
AA SGD H	3.00%	4.09%	0.26%	16.63%
AA ZAR H	5.35%	8.89%	4.19%	92.67%
AK	3.96%	5.89%	1.58%	23.70%
AK EUR	4.24%	3.53%	-5.85%	48.92%
AK EUR H	2.92%	3.61%	-1.49%	2.85%
AR EUR	4.24%	3.55%	-5.81%	23.32%
AR EUR H	2.81%	3.52%	-1.43%	-2.23%
AT	3.96%	5.86%	1.54%	160.74%
AT AUD H	2.99%	4.13%	-0.33%	61.44%
AT CAD H	3.52%	5.00%	0.83%	36.24%
AT DUR PH	5.58%	9.64%	9.34%	38.36%
AT EUR	4.18%	3.61%	-5.83%	134.41%
AT EUR H	2.97%	3.68%	-1.42%	19.91%
AT GBP H	3.62%	5.03%	0.00%	23.30%
AT HKD	3.76%	5.61%	1.54%	106.36%
AT NZD H	3.67%	5.52%	0.70%	33.60%
AT RMB H	2.61%	2.84%	-1.46%	53.65%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
American Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AT SGD.	3.50%	5.74%	-1.70%	60.74%
AT SGD H.	2.88%	4.00%	0.39%	32.99%
B.	3.62%	5.20%	0.93%	281.61%
B2.	3.57%	5.14%	0.89%	179.88%
BT.	3.63%	5.23%	0.83%	126.76%
C.	3.63%	5.38%	1.25%	299.74%
C EUR.	3.89%	3.07%	-6.15%	95.32%
C2.	3.69%	5.41%	1.16%	298.79%
C2 EUR.	4.04%	3.14%	-6.23%	96.14%
C2 EUR H.	2.70%	3.08%	-1.87%	11.40%
CT.	3.70%	5.32%	1.15%	23.41%
EA.	3.71%	5.36%	1.12%	1.55%
EA AUD H.	2.74%	3.52%	-0.85%	-6.23%
EA ZAR H.	5.13%	8.42%	3.71%	19.05%
I.	4.15%	6.41%	2.07%	269.46%
I EUR.	4.50%	4.08%	-5.26%	149.08%
I2.	4.23%	6.48%	2.16%	116.51%
I2 AUD H.	3.26%	4.66%	0.27%	3.33%
I2 CHF H.	1.99%	1.92%	-2.33%	2.53%
I2 EUR.	4.53%	4.14%	-5.28%	158.19%
I2 EUR H.	3.18%	4.12%	-0.89%	29.73%
I2 HKD.	4.05%	6.32%	2.22%	26.81%
I2 SGD H.	3.25%	4.68%	0.86%	20.73%
IA.	4.15%	6.48%	2.22%	27.18%
IA AUD H.	3.31%	4.68%	0.16%	20.38%
IT.	4.22%	6.51%	2.16%	31.53%
IT AUD H.	3.38%	4.69%	0.18%	28.48%
IT CAD H.	3.84%	5.64%	1.35%	20.45%
IT EUR H.	3.12%	4.13%	-0.89%	6.44%
IT GBP H.	3.76%	5.59%	0.55%	15.25%
IT HKD.	4.03%	6.17%	2.09%	32.15%
IT JPY.	7.37%	17.20%	7.01%	93.67%
IT JPY H.	1.12%	0.28%	-3.24%	3.31%
IT NZD H.	3.90%	6.00%	1.17%	25.03%
IT RMB H.	2.89%	3.42%	-0.88%	4.65%
IT SGD.	6.49%(4)	-	-	6.49%
IT SGD H.	3.25%	4.56%	0.78%	27.86%
J.	3.45%	5.06%	1.02%	186.72%
N2.	3.67%	5.35%	1.08%	16.87%
NT.	3.67%	5.30%	1.01%	16.83%
S.	4.58%	7.25%	2.91%	42.93%
S1.	4.32%	6.71%	2.44%	57.87%
S1D.	4.26%	6.67%	2.48%	44.51%
S1D2.	4.34%	6.70%	2.39%	-1.63%
SA.	4.60%	7.24%	2.91%	39.09%
SHK.	4.56%	7.18%	2.89%	32.12%
W.	4.25%	6.57%	2.35%	12.20%
W2.	4.33%	6.64%	2.34%	12.47%
W2 CHF H.	2.03%	2.11%	-2.13%	-6.40%
W2 EUR H.	3.24%	4.34%	-0.70%	-2.33%
WT.	4.26%	6.60%	2.29%	12.40%
WT AUD H.	3.35%	4.85%	0.40%	4.47%
WT EUR H.	3.22%	4.35%	-0.66%	-4.98%
WT GBP H.	3.96%	5.79%	0.82%	-1.06%
WT HKD.	4.14%	6.36%	2.26%	12.56%
WT SGD H.	3.24%	4.66%	1.03%	7.08%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
European Income Portfolio				
Klasse				
A	5.93%	8.25%	2.08%	109.40%
A USD	5.56%	10.62%	10.23%	106.39%
A2	5.96%	8.33%	2.08%	108.00%
A2 CHF H	4.60%	5.74%	0.54%	3.07%
A2 PLN H	7.07%	11.67%	7.65%	15.35%
A2 USD	5.59%	10.68%	10.14%	107.57%
A2 USD H	6.85%	10.45%	4.96%	31.07%
AA	5.94%	8.28%	2.07%	18.30%
AA AUD H	6.01%	8.69%	2.94%	38.04%
AA HKD H	6.43%	9.21%	3.69%	29.36%
AA RMB H	5.55%	7.37%	1.93%	42.70%
AA SGD H	5.90%	8.64%	3.65%	31.91%
AA USD H	6.95%	10.49%	4.92%	39.66%
AK	5.90%	8.32%	2.13%	23.65%
AR	5.92%	8.30%	2.15%	10.70%
AT	6.11%	8.43%	2.07%	103.92%
AT AUD H	6.06%	8.80%	3.02%	91.30%
AT SGD H	5.89%	8.59%	3.61%	31.86%
AT USD	5.56%	10.62%	10.23%	46.68%
AT USD H	6.90%	10.51%	4.99%	76.05%
B USD	5.21%	9.73%	9.32%	72.70%
B2	5.54%	7.55%	1.40%	75.20%
B2 USD	5.28%	9.92%	9.36%	71.87%
C	5.82%	7.82%	1.51%	83.97%
C USD	5.40%	10.11%	9.52%	82.27%
C2	5.71%	7.82%	1.60%	94.50%
C2 USD	5.36%	10.22%	9.67%	94.18%
C2 USD H	6.61%	9.96%	4.50%	23.67%
CK	5.77%	7.80%	1.55%	18.01%
CT USD H	6.66%	9.97%	4.57%	23.81%
I	6.10%	8.77%	2.76%	140.36%
I USD	5.79%	11.29%	10.70%	211.13%
I2	6.24%	8.86%	2.62%	88.90%
I2 AUD H	6.30%	9.31%	3.60%	105.93%
I2 CHF H	4.86%	6.33%	1.13%	6.47%
I2 USD	5.89%	11.29%	10.74%	60.34%
I2 USD H	7.17%	11.08%	5.54%	89.20%
IA	6.22%	8.90%	2.63%	17.27%
IA HKD H	6.69%	9.80%	4.32%	31.69%
IA USD H	7.21%	10.41%	4.84%	37.46%
IT	6.21%	8.85%	2.65%	17.17%
IT USD H	7.19%	11.09%	5.56%	41.02%
NT USD H	6.67%	9.90%	4.35%	16.11%
S1	6.35%	9.15%	2.87%	69.11%
S1 USD	6.03%	11.57%	10.99%	35.56%
S1 USD H	7.31%	11.28%	5.73%	78.20%
S1D	6.35%	9.19%	2.89%	19.81%
SA USD H	7.55%	11.88%	6.33%	56.86%
SHK	6.62%	9.67%	3.38%	24.55%
W2	6.33%	9.14%	2.86%	1.93%
W2 CHF H	4.97%	6.49%	1.24%	2.80%
W2 USD H	7.24%	11.27%	5.74%	10.60%
WA	6.36%	9.13%	2.78%	1.89%
WA USD H	7.34%	11.27%	5.73%	10.63%
WT	6.26%	9.03%	2.84%	1.89%
WT USD H	7.31%	11.25%	5.69%	10.56%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Emerging Markets Debt Portfolio				
Klasse				
A	7.28%	11.18%	5.63%	108.50%
A EUR	7.72%	8.83%	-2.23%	130.98%
A2	7.34%	11.22%	5.59%	109.53%
A2 CHF H	4.95%	6.48%	1.13%	-12.40%
A2 EUR	7.70%	8.87%	-2.14%	132.27%
A2 EUR H	6.23%	8.76%	2.38%	21.67%
A2 HKD	7.16%	10.95%	5.52%	58.06%
A2 PLN H	7.09%	11.99%	8.37%	-0.72%
A2 SGD H	6.27%	9.30%	4.22%	27.73%
AA	7.27%	11.24%	5.63%	20.86%
AA AUD H	6.30%	9.36%	3.41%	15.55%
AA CAD H	6.80%	10.33%	4.82%	6.03%
AA EUR H	6.22%	8.80%	2.44%	-6.28%
AA GBP H	6.89%	10.12%	3.63%	0.94%
AA HKD	7.17%	10.96%	5.52%	15.41%
AA NZD H	7.09%	10.87%	4.25%	13.43%
AA ZAR H	8.79%	14.30%	7.95%	81.11%
AI	7.33%	11.22%	5.60%	-9.37%
AI AUD H	6.34%	9.42%	3.47%	-13.06%
AR EUR	7.61%	8.78%	-2.17%	21.35%
AT	7.39%	11.29%	5.56%	109.50%
AT AUD H	6.43%	9.42%	3.37%	57.12%
AT CAD H	6.93%	10.40%	4.71%	7.37%
AT EUR	7.70%	8.82%	-2.20%	126.38%
AT EUR H	6.17%	8.69%	2.34%	21.77%
AT GBP H	6.89%	10.20%	3.82%	2.17%
AT HKD	7.16%	10.96%	5.52%	58.07%
AT NZD H	7.03%	10.88%	4.26%	19.48%
AT SGD H	6.30%	9.36%	4.15%	27.63%
BT	6.80%	10.12%	4.56%	75.08%
C	7.03%	10.67%	5.16%	92.55%
C EUR	7.41%	8.32%	-2.47%	113.51%
C2	7.10%	10.74%	5.13%	93.13%
C2 EUR	7.46%	8.37%	-2.58%	114.06%
C2 EUR H	5.97%	8.30%	1.94%	14.80%
CT	7.06%	10.78%	5.23%	8.67%
EA	7.07%	10.67%	5.01%	-7.20%
EA AUD H	6.11%	8.84%	2.90%	-14.01%
EA ZAR H	8.51%	13.75%	7.44%	6.30%
EI	7.07%	10.67%	5.08%	-10.70%
EI AUD H	6.08%	8.79%	2.85%	-14.44%
I	7.61%	11.84%	6.25%	130.05%
I2	7.61%	11.84%	6.20%	131.07%
I2 AUD H	6.62%	9.96%	4.02%	3.07%
I2 CHF H	5.27%	7.04%	1.68%	-6.80%
I2 EUR	7.98%	9.45%	-1.59%	156.15%
I2 EUR H	6.52%	9.35%	2.94%	31.80%
IT AUD H	6.62%	9.93%	4.04%	17.61%
IT EUR H	6.51%	9.33%	2.91%	-1.87%
N2	7.02%	10.57%	4.99%	6.67%
NT	7.09%	10.73%	5.03%	6.78%
S	8.00%	12.65%	6.97%	66.24%
S1 2	7.71%	12.01%	6.35%	115.20%
S1 EUR H	6.61%	9.59%	3.15%	27.93%
S1 GBP H	7.22%	10.98%	4.55%	39.53%
S1L	7.73%	9.40%(3)	-	9.40%
SA	8.01%	12.62%	6.92%	34.32%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Mortgage Income Portfolio				
Klasse				
A	5.71%	12.04%	8.59%	35.97%
A2	5.73%	12.04%	8.64%	36.53%
A2 EUR	6.10%	9.66%	0.68%	73.38%
A2 HKD	5.56%	11.73%	8.51%	20.58%
A2X	5.83%	12.21%	8.69%	54.57%
A2X EUR	6.17%	9.77%	0.79%	26.39%
AA	5.75%	12.06%	8.59%	36.46%
AA AUD H	4.98%	10.58%	7.17%	35.15%
AA HKD	5.55%	11.76%	8.52%	34.72%
AA RMB H	4.49%	8.94%	5.67%	45.12%
AA SGD H	4.76%	10.29%	7.55%	30.92%
AA ZAR H	7.29%	15.57%	12.01%	117.84%
AR EUR H	4.82%	9.82%	5.74%	11.04%
AT	5.72%	12.06%	8.62%	36.37%
AT AUD H	5.01%	10.59%	7.19%	35.29%
AT EUR	6.02%	9.65%	0.67%	73.07%
AT GBP H	5.54%	11.39%	7.39%	9.41%
AT HKD	5.56%	11.71%	8.49%	20.45%
AT SGD H	4.80%	10.29%	7.62%	30.77%
AX	5.62%	12.08%	8.82%	99.94%
AX EUR	6.11%	9.54%	0.61%	51.90%
BX	5.57%	11.78%	8.33%	75.21%
BX EUR	5.89%	9.26%	0.34%	8.55%
C	5.47%	11.53%	8.19%	30.06%
C2	5.45%	11.53%	8.17%	30.27%
C2 EUR	5.85%	9.17%	0.23%	65.51%
CX	5.57%	11.77%	8.33%	75.06%
I	6.00%	12.65%	9.19%	43.87%
I EUR	6.40%	10.26%	1.25%	82.46%
I2	6.03%	12.66%	9.21%	44.20%
I2 EUR	6.37%	10.30%	1.29%	83.26%
I2 EUR H	5.22%	10.56%	6.39%	7.47%
IT EUR H	5.15%	10.52%	6.50%	6.72%
IX	5.91%	12.68%	9.42%	97.86%
N2	5.46%	11.41%	8.05%	13.27%
NT	5.51%	11.49%	8.04%	13.40%
S	6.36%	13.44%	9.98%	54.96%
S1	6.09%	12.85%	9.42%	47.29%
S1 AUD H	5.41%	11.35%	9.99%	15.94%
S1 EUR H	5.26%	10.76%	14.54%	5.73%
S1L	6.13%	9.25%(3)	–	9.25%
SA	6.37%	13.40%	9.95%	51.34%

Die Wertentwicklung der Anteilklassen der einzelnen Portefeuilles basiert auf dem Nettoinventarwert zum 29. Februar 2024, wobei die Auswirkungen der von der Verwaltungsgesellschaft rückerstatteten bzw. erlassenen Aufwendungen einberechnet wurden. Verkaufsgebühren, die beim Kauf oder bei der Rücknahme von Anteilen erhoben werden können, wurden nicht berücksichtigt. Die Wertentwicklung der ausschüttenden Anteilklassen umfasst die während des Berichtszeitraums ausgeschütteten und wieder angelegten Beträge. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie für aktuelle oder zukünftige Ergebnisse. Die Wertentwicklungszahlen berücksichtigen nicht die Provisionen und Kosten im Zusammenhang mit der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen. Anlagerenditen und der Wert des angelegten Kapitals unterliegen Schwankungen, so dass die Anteile eines Anlegers bei Rücknahme mehr oder weniger als die ursprünglichen Anschaffungskosten wert sein können.

* Sechsmonatszeitraum zum 29. Februar 2024

Rendite berechnet ab Auflegungsdatum am:

- (1) 16. Oktober 2023
- (2) 18. Juli 2023
- (3) 6. Juli 2023
- (4) 19. Oktober 2023

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
NXP Semiconductors NV	6,744	\$ 1,684,203	1.8%
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	109,445	2,398,445	2.5
		<u>4,082,648</u>	<u>4.3</u>
SOFTWARE			
Microsoft Corp.	11,219	4,640,566	4.9
		<u>8,723,214</u>	<u>9.2</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
BYD Co., Ltd. - Class H	40,552	998,792	1.1
		<u>9,722,006</u>	<u>10.3</u>
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS- AUSRÜSTUNG			
Calix, Inc.	14,356	500,607	0.5
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Flex Ltd.	35,673	1,004,197	1.0
Halma PLC.	20,379	593,471	0.6
Keyence Corp.	1,312	614,992	0.6
Keysight Technologies, Inc.	6,455	996,059	1.0
LG Innotek Co., Ltd.	2,254	342,572	0.4
Nan Ya Printed Circuit Board Corp.	53,813	360,541	0.4
		<u>3,911,832</u>	<u>4.0</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Accenture PLC - Class A	3,293	1,234,157	1.3
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASML Holding NV	1,180	1,119,837	1.2
Infineon Technologies AG	24,310	872,856	0.9
NVIDIA Corp.	1,414	1,118,458	1.2
ON Semiconductor Corp.	6,811	537,507	0.6
		<u>3,648,658</u>	<u>3.9</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	1,740	974,862	1.0
Bentley Systems, Inc. - Class B.	10,927	561,298	0.6
Fair Isaac Corp.	804	1,021,601	1.1
Intuit, Inc.	1,697	1,125,195	1.2
Oracle Corp.	10,927	1,220,310	1.3
Palo Alto Networks, Inc.	2,606	809,344	0.8
		<u>5,712,610</u>	<u>6.0</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	17,670	975,258	1.0
Western Digital Corp.	14,232	846,377	0.9
		<u>1,821,635</u>	<u>1.9</u>
		<u>16,829,499</u>	<u>17.6</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Alcon, Inc.	10,617	905,295	0.9
Becton Dickinson & Co.	3,933	926,469	1.0
GE HealthCare Technologies, Inc.	8,208	749,187	0.8
Medtronic PLC.	8,126	677,419	0.7
STERIS PLC	3,418	796,122	0.8
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	7,226	898,623	0.9
		<u>4,953,115</u>	<u>5.1</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	11,540	852,153	0.9
HCA Healthcare, Inc.	2,739	853,841	0.9
Humana, Inc.	1,883	659,554	0.7
UnitedHealth Group, Inc.	1,666	822,333	0.9
		<u>3,187,881</u>	<u>3.4</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Bruker Corp.	8,747	756,922	0.8
Danaher Corp.	3,905	988,609	1.0
ICON PLC	3,602	1,154,755	1.2

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
IQVIA Holdings, Inc.	3,102	\$ 766,687	0.8%
West Pharmaceutical Services, Inc.	1,773	635,303	0.7
		<u>4,302,276</u>	<u>4.5</u>
PHARMAZEUTIKA			
Bristol-Myers Squibb Co.	13,598	690,078	0.7
Johnson & Johnson	3,929	633,988	0.7
Roche Holding AG.	3,576	935,097	1.0
Royalty Pharma PLC - Class A	23,148	702,301	0.7
		<u>2,961,464</u>	<u>3.1</u>
		<u>15,404,736</u>	<u>16.1</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE.	4,509	746,119	0.8
BAE Systems PLC.	48,800	765,999	0.8
Hexcel Corp.	11,767	876,166	0.9
Spirit AeroSystems Holdings, Inc. - Class A(a).	14,571	416,735	0.4
		<u>2,805,019</u>	<u>2.9</u>
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Tetra Tech, Inc.	5,599	992,848	1.0
Veralto Corp.	12,400	1,071,637	1.1
Waste Management, Inc.	7,097	1,459,600	1.5
		<u>3,524,085</u>	<u>3.6</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Dycom Industries, Inc.	6,742	852,800	0.9
MasTec, Inc.	4,570	344,828	0.4
WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	12,223	583,645	0.6
WSP Global, Inc.	4,476	710,517	0.7
		<u>2,491,790</u>	<u>2.6</u>
MASCHINEN			
Amada Co., Ltd.	45,033	500,688	0.5
Deere & Co.	1,914	698,674	0.7
Middleby Corp. (The)	4,363	663,916	0.7
SMC Corp.	1,023	617,298	0.6
Stanley Black & Decker, Inc.	4,842	432,315	0.5
TOMRA Systems ASA	34,574	460,126	0.5
		<u>3,373,017</u>	<u>3.5</u>
SCHIFFFAHRT TRANSPORT			
Star Bulk Carriers Corp.	18,838	449,660	0.5
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Experian PLC.	23,356	1,000,224	1.0
RELX PLC.	16,319	714,827	0.7
Robert Half, Inc.	8,336	670,197	0.7
		<u>2,385,248</u>	<u>2.4</u>
		<u>15,028,819</u>	<u>15.5</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
KB Financial Group, Inc.	13,064	623,061	0.7
NatWest Group PLC	289,626	875,714	0.9
Resona Holdings, Inc.	116,030	633,246	0.7
Wells Fargo & Co.	20,759	1,154,009	1.2
		<u>3,286,030</u>	<u>3.5</u>
KAPITALMÄRKTE			
Charles Schwab Corp. (The)	10,839	723,797	0.8
Deutsche Boerse AG	2,904	607,862	0.6
London Stock Exchange Group PLC.	9,360	1,051,196	1.1
MSCI, Inc.	2,038	1,143,237	1.2
Partners Group Holding AG.	506	728,174	0.8
		<u>4,254,266</u>	<u>4.5</u>
FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Visa, Inc. - Class A.	5,590	1,579,917	1.7
VERSICHERUNGEN			
Aflac, Inc.	12,035	971,746	1.0
AIA Group Ltd. - Class H	72,875	587,462	0.6
Intact Financial Corp.	0*	12	0.0
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	101,102	449,618	0.5
Progressive Corp. (The)	6,617	1,254,334	1.3
		<u>3,263,172</u>	<u>3.4</u>
		<u>12,383,385</u>	<u>13.1</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
AUTOMOBILKOMponentEN			
Aptiv PLC	8,379	\$ 666,041	0.7%
Lear Corp.	3,092	424,641	0.4
		<u>1,090,682</u>	<u>1.1</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Stellantis NV	22,850	597,462	0.6
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
ADT, Inc.	77,054	559,410	0.6
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Entain PLC	48,437	558,920	0.6
Hyatt Hotels Corp. - Class A	5,847	898,081	0.9
		<u>1,457,001</u>	<u>1.5</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
TopBuild Corp.	2,081	837,377	0.9
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
JD Sports Fashion PLC	409,161	611,403	0.6
		<u>5,153,335</u>	<u>5.3</u>
KOMMUNIKATIONSdienstLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSdienstEN			
Charter Communications, Inc. - Class A	2,176	639,559	0.7
Comcast Corp. - Class A	13,748	589,082	0.6
		<u>1,228,641</u>	<u>1.3</u>
UNTERHALTUNG			
Ubisoft Entertainment SA	22,677	520,528	0.5
Walt Disney Co. (The)	7,089	791,025	0.8
		<u>1,311,553</u>	<u>1.3</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND dienstLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	6,044	844,760	0.9
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSdienstEN			
T-Mobile US, Inc.	4,994	815,447	0.9
		<u>4,200,401</u>	<u>4.4</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola Co. (The)	18,954	1,137,626	1.2
HAUSHALTSPRODUKTE			
Procter & Gamble Co. (The)	4,946	786,128	0.8
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Dabur India Ltd.	82,882	539,369	0.6
Haleon PLC	182,378	765,118	0.8
Unilever PLC	15,888	775,892	0.8
		<u>2,080,379</u>	<u>2.2</u>
		<u>4,004,133</u>	<u>4.2</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
LyondellBasell Industries NV - Class A	9,529	955,542	1.0
BAUMATERIAL			
CRH PLC	11,544	973,274	1.0
METALL UND BERGBAU			
Anglo American PLC.	18,132	390,690	0.4
ArcelorMittal SA	24,146	629,871	0.7
ATI, Inc.	11,086	545,220	0.6
Endeavour Mining PLC	18,905	305,019	0.3
		<u>1,870,800</u>	<u>2.0</u>
		<u>3,799,616</u>	<u>4.0</u>
ENERGIE			
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -dienstEN			
Baker Hughes Co.	16,111	476,730	0.5
Shell PLC	50,951	1,600,835	1.7
		<u>2,077,565</u>	<u>2.2</u>
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Cameco Corp.	17,242	698,803	0.7
Neste Oyj	16,958	464,856	0.5
		<u>1,163,659</u>	<u>1.2</u>
		<u>3,241,224</u>	<u>3.4</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
EDP - Energias de Portugal SA			195,604	\$ 778,982	0.8%
Enel SpA			100,468	639,283	0.7
NextEra Energy, Inc.			18,811	1,038,198	1.1
				<u>2,456,463</u>	<u>2.6</u>
				<u>82,501,611</u>	<u>86.2</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$81,733,777)				\$ 92,223,617	96.5%
Termineinlagen					
BNP Paribas, Paris(b)	3.15 %	–		2	0.0
Citibank, New York(b)	4.68 %	–		1,622,131	1.7
DNB, Oslo(b)	2.75 %	–		755	0.0
HSBC, Hong Kong(b)	2.69 %	–		9,393	0.0
HSBC, London(b)	4.15 %	–		9,618	0.0
HSBC, Paris(b)	2.86 %	–		11,772	0.0
MUFG, Tokyo(b)	(0.36)%	–		4,840	0.0
Nordea, Oslo(b)	3.32 %	–		4,627	0.0
Scotiabank, Toronto(b)	3.83 %	–		21,374	0.0
SEB, Stockholm(b)	0.71 %	–		9,476	0.0
SEB, Stockholm(b)	2.50 %	–		4,794	0.0
SEB, Stockholm(b)	2.86 %	–		4,699	0.0
SEB, Stockholm(b)	3.32 %	–		3	0.0
SEB, Stockholm(b)	4.68 %	–		1,286,879	1.3
SMBC, London(b)	(0.36)%	–		4,737	0.0
SMBC, London(b)	4.68 %	–		2,847	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>2,997,947</u>	<u>3.0</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>347,895</u>	<u>0.5</u>
Nettovermögen				<u>\$ 95,569,459</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Bank of America NA	USD 119	CNH 858	03/07/2024	\$ 52
Bank of America NA	USD 138	EUR 128	03/14/2024	714
Bank of America NA	USD 653	CAD 872	03/15/2024	(10,049)
Bank of America NA	USD 534	KRW 696,380	04/18/2024	(10,761)
Bank of America NA	TWD 2,956	USD 94	05/24/2024	584
Barclays Bank PLC	BRL 1,110	USD 223	03/04/2024	(399)
Barclays Bank PLC	USD 122	JPY 18,312	03/08/2024	352
Barclays Bank PLC	INR 67,074	USD 803	03/14/2024	(5,873)
Barclays Bank PLC	USD 222	BRL 1,110	04/02/2024	426
BNP Paribas	USD 201	BRL 1,000	03/04/2024	127
BNP Paribas	USD 68	CNH 485	03/07/2024	(257)
BNP Paribas	USD 595	EUR 549	03/14/2024	(1,827)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 4,355	USD 4,710	03/04/2024	3,410
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 76	USD 81	03/04/2024	(636)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 116	EUR 108	03/04/2024	585
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,689	EUR 4,323	03/04/2024	(17,253)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 74	USD 80	03/14/2024	584
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 96	USD 71	03/15/2024	554
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 19	USD 21	04/02/2024	55
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,595	EUR 4,244	04/02/2024	(3,108)
Citibank NA	JPY 13,540	USD 94	03/08/2024	3,649
Citibank NA	HKD 2,792	USD 358	03/14/2024	1,785
Citibank NA	KRW 2,650,040	USD 2,027	04/18/2024	37,521
Citibank NA	USD 810	AUD 1,228	04/18/2024	(10,703)
Deutsche Bank AG	USD 282	SEK 2,969	04/30/2024	4,935
Goldman Sachs Bank USA	CNH 9,676	USD 1,355	03/07/2024	12,554
Goldman Sachs Bank USA	USD 583	CNH 4,174	03/07/2024	(3,991)
Goldman Sachs Bank USA	USD 1,129	JPY 162,946	03/08/2024	(41,763)
Goldman Sachs Bank USA	EUR 83	USD 90	03/14/2024	415
HSBC Bank USA	TWD 4,593	USD 148	05/24/2024	1,873
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL 1,000	USD 203	03/04/2024	1,582
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 225	BRL 1,110	03/04/2024	(1,756)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 144	JPY 21,704	03/08/2024	581
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 104	JPY 15,377	03/08/2024	(1,707)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 236	EUR 215	03/14/2024	(3,358)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 72	INR 5,984	03/14/2024	531
Morgan Stanley Capital Services LLC	KRW 165,974	USD 126	04/18/2024	1,223

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	154	KRW	206,074	04/18/2024	\$ 1,087
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	131	KRW	171,417	04/18/2024	(2,313)
Morgan Stanley Capital Services LLC	GBP	2,218	USD	2,814	04/19/2024	13,903
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	135	CHF	118	05/08/2024	(650)
Morgan Stanley Capital Services LLC	TWD	44,838	USD	1,441	05/24/2024	16,517
NatWest Markets PLC	USD	293	EUR	267	03/14/2024	(4,879)
NatWest Markets PLC	USD	116	ZAR	2,218	04/19/2024	(525)
UBS AG	GBP	235	USD	298	04/19/2024	1,227
UBS AG	NOK	3,008	USD	284	04/30/2024	1,016
UBS AG	CHF	980	USD	1,115	05/08/2024	(1,547)
UBS AG	USD	360	CHF	314	05/08/2024	(2,470)
						\$ (17,983)
					Wertsteigerung	\$ 107,842
					Wertminderung	\$ (125,825)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

* Anteilsbetrag weniger als 0.50.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	– Australian Dollar
BRL	– Brazilian Real
CAD	– Canadian Dollar
CHF	– Swiss Franc
CNH	– Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
HKD	– Hong Kong Dollar
INR	– Indian Rupee
JPY	– Japanese Yen
KRW	– South Korean Won
NOK	– Norwegian Krone
SEK	– Swedish Krona
TWD	– New Taiwan Dollar
USD	– United States Dollar
ZAR	– South African Rand

Glossar:

MSCI – Morgan Stanley Capital International

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Sinbon Electronics Co., Ltd.	1,073,000	\$ 8,774,893	1.5%
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
FPT Corp.	229,863	1,017,382	0.2
Globant SA.	36,326	8,106,873	1.4
		<u>9,124,255</u>	<u>1.6</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASPEED Technology, Inc.	14,100	1,221,243	0.2
Broadcom, Inc.	14,815	19,266,759	3.3
MediaTek, Inc.	474,000	17,104,916	2.9
Realtek Semiconductor Corp.	525,000	9,462,097	1.6
SK Hynix, Inc.	148,118	17,460,813	3.0
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	2,659,000	58,270,713	9.9
		<u>122,786,541</u>	<u>20.9</u>
SOFTWARE			
TOTVS SA.	1,016,900	6,278,019	1.1
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	525,052	28,979,153	4.9
Samsung Electronics Co., Ltd. (Preference Shares)	135,480	6,487,687	1.1
		<u>35,466,840</u>	<u>6.0</u>
		<u>182,430,548</u>	<u>31.1</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Al Rajhi Bank	586,658	13,932,082	2.4
Bank Central Asia Tbk PT.	16,271,500	10,239,103	1.7
Bank for Foreign Trade of Vietnam JSC	3,338,373	13,181,950	2.2
Bank Mandiri Persero Tbk PT.	23,474,000	10,485,221	1.8
HDFC Bank Ltd.	1,337,367	22,660,774	3.8
IDFC First Bank Ltd.	5,501,602	5,371,870	0.9
Itau Unibanco Holding SA (Preference Shares)	1,567,700	10,703,413	1.8
NU Holdings Ltd./Cayman Islands - Class A	1,257,960	13,938,197	2.4
		<u>100,512,610</u>	<u>17.0</u>
KAPITALMÄRKTE			
Banco BTG Pactual SA.	1,291,700	9,455,646	1.6
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
Kaspi.KZ JSC (ADR)(a)	57,330	5,961,747	1.0
VERSICHERUNGEN			
AIA Group Ltd. - Class H	2,079,000	16,759,208	2.8
PICC Property & Casualty Co., Ltd. - Class H	3,460,000	4,730,234	0.8
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	2,776,000	12,345,342	2.1
		<u>33,834,784</u>	<u>5.7</u>
		<u>149,764,787</u>	<u>25.3</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
BREIT ANGELEGTER EINZELHANDEL			
Alibaba Group Holding Ltd. - Class H	610,500	5,612,743	0.9
MercadoLibre, Inc.	3,720	5,934,516	1.0
PDD Holdings, Inc. (ADR)	120,219	14,972,074	2.5
		<u>26,519,333</u>	<u>4.4</u>
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
New Oriental Education & Technology Group, Inc. - Class H	1,639,600	15,409,431	2.6
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Americana Restaurants International PLC.	1,363,982	1,272,948	0.2
Galaxy Entertainment Group Ltd. - Class H	2,019,000	10,992,988	1.9
H World Group Ltd. - Class H	2,820,400	10,405,089	1.8
Sands China Ltd. - Class H	1,381,200	3,921,703	0.7
		<u>26,592,728</u>	<u>4.6</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
ANTA Sports Products Ltd. - Class H	862,000	8,403,688	1.4
Li Ning Co., Ltd. - Class H	1,021,000	2,526,067	0.4
Samsonite International SA - Class H	1,725,600	6,018,942	1.0
		<u>16,948,697</u>	<u>2.8</u>
		<u>85,470,189</u>	<u>14.4</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
UNTERHALTUNG					
NetEase, Inc. - Class H			387,300	\$ 8,413,159	1.4%
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Kanzhun Ltd. (ADR)			498,443	7,800,633	1.3
Tencent Holdings Ltd. - Class H			796,200	27,891,391	4.7
				<u>35,692,024</u>	<u>6.0</u>
				<u>44,105,183</u>	<u>7.4</u>
INDUSTRIEGÜTER					
BAU- UND INGENIEURWESEN					
Larsen & Toubro Ltd.			294,930	12,377,592	2.1
ELEKTRISCHE AUSTRÜSTUNG					
Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. - Class A (Stock Connect)			209,400	4,736,094	0.8
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA (Sponsored ADR)(a)			152,120	7,563,406	1.3
				<u>12,299,500</u>	<u>2.1</u>
MASCHINEN					
Estun Automation Co., Ltd. - Class A (Stock Connect)			2,013,600	4,864,112	0.8
				<u>29,541,204</u>	<u>5.0</u>
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
Equatorial Energia SA			2,179,500	14,985,679	2.5
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN					
NTPC Ltd.			2,255,235	9,123,948	1.5
				<u>24,109,627</u>	<u>4.0</u>
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A			31,592	7,411,141	1.3
VERTRIEB UND EINZELHANDEL VON NICHT-ZYKLISCHEN KONSUMGÜTERN					
BBB Foods, Inc. - Class A			293,868	6,168,289	1.0
TABAK					
ITC Ltd.			1,648,056	8,077,578	1.4
				<u>21,657,008</u>	<u>3.7</u>
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN					
Max Healthcare Institute Ltd.			1,145,150	10,885,951	1.8
Universal Vision Biotechnology Co., Ltd.			689,904	6,580,117	1.1
				<u>17,466,068</u>	<u>2.9</u>
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
Macrotech Developers Ltd.			966,942	13,417,922	2.3
GRUNDSTOFFE					
METALL UND BERGBAU					
Freeport-McMoRan, Inc.			201,634	7,623,782	1.3
				<u>575,586,318</u>	<u>97.4</u>
AKTIENANLEIHEN					
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
FPT Corp., expiring 07/15/2024			2,190,050	9,688,126	1.7
				<u>585,274,444</u>	<u>99.1</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
INDUSTRIEGÜTER					
TRANSPORT AUF DEM LANDWEG					
Globaltrans Investment PLC (Sponsored GDR)			941,672	1	0.0
Gesamtanlagen					
(Kosten \$519,430,760)				\$ 585,274,445	99.1%
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	3.15 %	–		5,026	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	2.58 %	–		52,816	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	6.65 %	–		64,337	0.0
HSBC, Hong Kong(b)	2.69 %	–		57,341	0.0
HSBC, Paris(b)	2.86 %	–		57,951	0.0
Scotiabank, Toronto(b)	3.83 %	–		111	0.0
SEB, Stockholm(b)	0.71 %	–		1,191	0.0

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SEB, Stockholm(b)	2.75 %	–	\$ 90	0.0%
SEB, Stockholm(b)	4.15 %	–	63,487	0.0
SMBC, London(b)	4.68 %	–	3,947,241	0.7
Termineinlagen insgesamt			<u>4,249,591</u>	<u>0.7</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>1,330,349</u>	<u>0.2</u>
Nettovermögen			<u>\$ 590,854,385</u>	<u>100.0</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 226	USD 149	03/04/2024	\$ 2,302
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 5,114	USD 3,322	03/04/2024	(1,789)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 3,622	USD 908	03/04/2024	1,508
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 46	USD 12	03/04/2024	(2)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 1	USD 1	03/04/2024	4
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 34	USD 25	03/04/2024	(20)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 44	AUD 68	03/04/2024	38
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,471	AUD 5,271	03/04/2024	(44,618)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 35	PLN 141	03/04/2024	356
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 884	PLN 3,527	03/04/2024	(537)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1	SGD 1	03/04/2024	0*
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 25	SGD 34	03/04/2024	(143)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 68	USD 44	04/02/2024	(41)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 0**	USD 0**	04/02/2024	(0)*
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,322	AUD 5,109	04/02/2024	1,775
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 871	PLN 3,473	04/02/2024	(1,522)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 25	SGD 34	04/02/2024	19
				<u>\$ (42,670)</u>
			Wertsteigerung \$	6,002
			Wertminderung \$	(48,672)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

* Betrag kleiner als 0.50.

** Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar

PLN – Polish Zloty

SGD – Singapore Dollar

USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

GDR – Global Depositary Receipt

JSC – Joint Stock Company

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
LG Innotek Co., Ltd.	16,660	\$ 2,527,275	0.9%
Nan Ya Printed Circuit Board Corp.	364,000	2,435,534	0.8
Tripod Technology Corp.	460,000	3,026,938	1.0
Unimicron Technology Corp.	644,000	3,657,065	1.2
		<u>11,646,812</u>	<u>3.9</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
FPT Corp.	1,616,217	7,146,761	2.4
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
King Yuan Electronics Co., Ltd.	1,878,000	5,275,832	1.8
Nanya Technology Corp.	1,461,000	3,110,625	1.0
SK Hynix, Inc.	95,760	11,232,887	3.8
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	1,020,000	22,265,458	7.5
United Microelectronics Corp.	2,374,000	3,668,831	1.2
		<u>45,553,633</u>	<u>15.3</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Quanta Computer, Inc.	99,000	726,617	0.2
Samsung Electronics Co., Ltd.	379,380	20,912,055	7.0
Shenzhen Transsion Holdings Co., Ltd. - Class A.	89,858	1,978,861	0.7
Wistron Corp.	200,000	730,793	0.2
		<u>24,348,326</u>	<u>8.1</u>
		<u>88,695,532</u>	<u>29.7</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bandhan Bank Ltd.	297,999	707,294	0.2
Bangkok Bank PCL (REG)	890,200	3,549,382	1.2
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	12,183,900	4,651,823	1.6
Bank of Ningbo Co., Ltd. - Class A (Stock Connect)	293,500	907,413	0.3
BDO Unibank, Inc.	544,740	1,482,615	0.5
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class H	1,341,000	5,232,461	1.8
City Union Bank Ltd.	1,018,745	1,663,583	0.6
Hana Financial Group, Inc.	139,380	5,924,383	2.0
KB Financial Group, Inc.	269,840	12,867,858	4.3
Metropolitan Bank & Trust Co.	2,702,770	2,980,908	1.0
State Bank of India.	267,455	2,431,460	0.8
		<u>42,399,180</u>	<u>14.3</u>
FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
L&T Finance Holdings Ltd.	1,743,359	3,518,624	1.2
VERSICHERUNGEN			
Hyundai Marine & Fire Insurance Co., Ltd.	68,950	1,631,064	0.6
PICC Property & Casualty Co., Ltd. - Class H	3,122,000	4,274,582	1.4
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class A	599,000	3,565,872	1.2
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	1,172,500	5,256,370	1.8
Samsung Fire & Marine Insurance Co., Ltd.	11,920	2,667,588	0.9
Samsung Life Insurance Co., Ltd.	19,950	1,451,753	0.5
		<u>18,847,229</u>	<u>6.4</u>
		<u>64,765,033</u>	<u>21.9</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
AUTOMOBILKOMPONENTEN			
Hankook Tire & Technology Co., Ltd.	48,410	1,970,428	0.7
Minth Group Ltd. - Class H.	1,302,000	2,215,038	0.7
		<u>4,185,466</u>	<u>1.4</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
BYD Co., Ltd. - Class H	168,500	4,160,042	1.4
Hyundai Motor Co.	11,710	2,202,880	0.7
Kia Corp.	13,720	1,282,773	0.4
Maruti Suzuki India Ltd.	76,725	10,493,257	3.5
		<u>18,138,952</u>	<u>6.0</u>
BREIT ANGELEGTER EINZELHANDEL			
Alibaba Group Holding Ltd. - Class H	1,489,500	13,868,644	4.6
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai - Class A (Stock Connect)	880,108	4,769,124	1.6
Midea Group Co., Ltd. - Class A (Stock Connect)	262,400	2,280,488	0.8
		<u>7,049,612</u>	<u>2.4</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Topsports International Holdings Ltd. - Class H	1,491,000	\$ 1,013,107	0.3%
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Bosideng International Holdings Ltd. - Class H	6,704,000	3,382,183	1.1
Samsonite International SA - Class H	532,500	1,860,128	0.6
		<u>5,242,311</u>	<u>1.7</u>
		<u>49,498,092</u>	<u>16.4</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
Power Grid Corp. of India Ltd.	2,017,132	6,890,720	2.3
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
GAIL India Ltd.	4,103,248	9,046,161	3.0
Kunlun Energy Co., Ltd. - Class H	8,207,000	7,012,559	2.4
		<u>16,058,720</u>	<u>5.4</u>
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN			
China Datang Corp. Renewable Power Co., Ltd. - Class H	2,569,000	584,050	0.2
China Longyuan Power Group Corp., Ltd. - Class H	5,786,000	4,094,060	1.4
		<u>4,678,110</u>	<u>1.6</u>
		<u>27,627,550</u>	<u>9.3</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Gujarat Narmada Valley Fertilizers & Chemicals Ltd.	163,979	1,268,166	0.4
Kumho Petrochemical Co., Ltd.	11,290	1,253,973	0.4
Tianqi Lithium Corp. - Class A (Stock Connect)	91,300	679,454	0.2
		<u>3,201,593</u>	<u>1.0</u>
METALL UND BERGBAU			
Aluminum Corp. of China Ltd. - Class H	3,816,000	1,910,559	0.6
Hyundai Steel Co.	32,990	890,651	0.3
Western Mining Co., Ltd. - Class A	1,590,600	3,674,996	1.2
Zijin Mining Group Co., Ltd. - Class A	866,600	1,576,533	0.5
Zijin Mining Group Co., Ltd. - Class H	4,258,000	6,885,022	2.3
		<u>14,937,761</u>	<u>4.9</u>
		<u>18,139,354</u>	<u>5.9</u>
INDUSTRIEGÜTER			
ELEKTRISCHE AUSTRÜSTUNG			
Henan Pinggao Electric Co., Ltd. - Class A	882,200	1,712,641	0.6
NARI Technology Co., Ltd. - Class A	413,329	1,329,508	0.4
		<u>3,042,149</u>	<u>1.0</u>
MASCHINEN			
Weichai Power Co., Ltd. - Class H	2,085,000	4,101,028	1.4
Yutong Bus Co., Ltd. - Class A	1,517,000	3,930,172	1.3
Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co., Ltd. - Class A (Stock Connect)	3,094,400	3,435,169	1.2
		<u>11,466,369</u>	<u>3.9</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
BOC Aviation Ltd. - Class H	360,800	2,658,939	0.9
		<u>17,167,457</u>	<u>5.8</u>
IMMOBILIEN			
REITs – INDUSTRIE			
CapitaLand Ascendas REIT	1,401,100	2,853,119	1.0
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
Ayala Land, Inc.	9,012,300	5,611,145	1.9
Megaworld Corp.	6,323,800	217,112	0.1
Vinhomes JSC	1,675,500	2,949,967	1.0
		<u>8,778,224</u>	<u>3.0</u>
		<u>11,631,343</u>	<u>4.0</u>
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Bharat Petroleum Corp., Ltd.	214,128	1,569,620	0.5
PetroChina Co., Ltd. - Class H	10,546,000	8,310,725	2.8
Thai Oil PCL	1,001,700	1,564,065	0.5
		<u>11,444,410</u>	<u>3.8</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
International Games System Co., Ltd.	99,000	2,668,438	0.9

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Tencent Holdings Ltd. - Class H			137,300	\$ 4,861,046	1.6%
				<u>7,529,484</u>	<u>2.5</u>
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN					
Jointown Pharmaceutical Group Co., Ltd. - Class A			3,057,140	3,453,197	1.2
				<u>299,951,452</u>	<u>100.5</u>
AKTIENANLEIHEN					
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
FPT Corp., expiring 07/15/2024			94,682	418,845	0.1
				<u>300,370,297</u>	<u>100.6</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$278,206,791)				\$ 300,370,297	100.6%
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(a)	2.90 %	–		2,781	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	2.58 %	–		83	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	3.15 %	–		5,491	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	6.65 %	–		8,569	0.0
HSBC, Hong Kong(a)	2.69 %	–		513,339	0.2
HSBC, London(a)	4.15 %	–		32	0.0
JPMorgan Chase, New York(a)	4.68 %	–		2,899,656	1.0
Scotiabank, Toronto(a)	3.83 %	–		6	0.0
				<u>3,429,957</u>	<u>1.2</u>
Termineinlagen insgesamt					
				<u>(5,212,544)</u>	<u>(1.8)</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					
				\$ 298,587,710	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 1,265	USD 833	03/04/2024	\$ 10,461
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 30,065	USD 19,532	03/04/2024	(10,517)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 4,970	USD 3,663	03/04/2024	1,636
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 382	USD 413	03/04/2024	290
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 3,923	USD 4,962	03/04/2024	9,222
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 25	USD 31	03/04/2024	(207)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 6,130	USD 3,735	03/04/2024	2,412
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 1	USD 0*	03/04/2024	3
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 64	USD 48	03/04/2024	(37)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 890	AUD 1,371	03/04/2024	1,481
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 19,732	AUD 29,959	03/04/2024	(258,422)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,704	CAD 4,970	03/04/2024	(42,056)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 13	EUR 12	03/04/2024	64
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 401	EUR 370	03/04/2024	(1,466)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 237	GBP 188	03/04/2024	774
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,776	GBP 3,760	03/04/2024	(29,872)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 63	NZD 104	03/04/2024	421
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,698	NZD 6,027	03/04/2024	(28,940)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2	SGD 3	03/04/2024	1
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 47	SGD 62	03/04/2024	(263)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 351	ZAR 6,776	03/04/2024	1,946
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 10,532	ZAR 198,237	03/04/2024	(196,221)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 37,280	USD 1,956	03/04/2024	11,909
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 167,733	USD 8,742	03/04/2024	(2,743)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 396	USD 257	04/02/2024	(241)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 55	USD 40	04/02/2024	1
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1	USD 1	04/02/2024	3
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 16	USD 20	04/02/2024	46
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 43	USD 26	04/02/2024	15
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 0*	USD 0*	04/02/2024	(0)**
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 19,532	AUD 30,037	04/02/2024	10,436
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,556	CAD 4,822	04/02/2024	(1,017)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 402	EUR 371	04/02/2024	(272)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,962	GBP 3,922	04/02/2024	(9,426)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,661	NZD 6,010	04/02/2024	(1,668)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 48	SGD 64	04/02/2024	37

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	8,687	ZAR	167,073	04/02/2024	\$ 2,069
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	3,561	USD	185	04/02/2024	(533)
						\$ (530,674)
					Wertsteigerung	\$ 53,227
					Wertminderung	\$ (583,901)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

** Betrag kleiner als 0.50.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
 CAD – Canadian Dollar
 EUR – Euro
 GBP – Great British Pound
 NZD – New Zealand Dollar
 SGD – Singapore Dollar
 USD – United States Dollar
 ZAR – South African Rand

Glossar:

JSC – Joint Stock Company
 REG – Registered Shares
 REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INDUSTRIEGÜTER			
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Park24 Co., Ltd.	113,600	¥ 201,980,800	2.3%
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Kumagai Gumi Co., Ltd.	30,200	119,441,000	1.4
TRANSPORT AUF DEM LANDWEG			
East Japan Railway Co.	14,200	125,883,000	1.4
INDUSTRIEKONZERNE			
Hitachi Ltd.	18,900	239,368,500	2.7
MASCHINEN			
Fuji Corp./Aichi	41,900	107,934,400	1.2
Glory Ltd.	21,000	61,309,500	0.7
IHI Corp.(a)	26,700	88,003,200	1.0
Makino Milling Machine Co., Ltd.	23,200	135,488,000	1.6
Nabtesco Corp.	33,800	83,959,200	1.0
Toyota Industries Corp.	7,800	116,142,000	1.3
		<u>592,836,300</u>	<u>6.8</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
dip Corp.(a)	37,400	97,950,600	1.1
IR Japan Holdings Ltd.(a)	58,000	76,502,000	0.9
UT Group Co., Ltd.	66,200	232,362,000	2.7
		<u>406,814,600</u>	<u>4.7</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Mitsubishi Corp.	80,000	256,400,000	2.9
		<u>1,942,724,200</u>	<u>22.2</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
AUTOMOBILKOMPONENTEN			
Sumitomo Electric Industries Ltd.	20,700	45,964,350	0.5
TS Tech Co., Ltd.	67,900	131,522,300	1.5
		<u>177,486,650</u>	<u>2.0</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Honda Motor Co., Ltd.	166,100	295,990,200	3.4
Suzuki Motor Corp.	13,400	88,131,800	1.0
Toyota Motor Corp.	44,100	159,686,100	1.8
		<u>543,808,100</u>	<u>6.2</u>
BREIT ANGELEGTER EINZELHANDEL			
ASKUL Corp.	100,600	211,662,400	2.4
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Food & Life Cos. Ltd.	50,400	149,511,600	1.7
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Sony Group Corp.	21,000	271,845,000	3.1
SPEZIALISIRTER EINZELHANDEL			
Shimamura Co., Ltd.	13,000	103,623,000	1.2
		<u>1,457,936,750</u>	<u>16.6</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSTRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Oki Electric Industry Co., Ltd.	125,800	134,731,800	1.5
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
BIPROGY, Inc.	55,400	256,723,600	2.9
NEC Networks & System Integration Corp.	82,400	201,797,600	2.3
		<u>458,521,200</u>	<u>5.2</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Optoron Co., Ltd.	25,100	50,978,100	0.6
SCREEN Holdings Co., Ltd.	13,000	243,555,000	2.8
Tokyo Electron Ltd.	6,750	248,872,500	2.8
		<u>543,405,600</u>	<u>6.2</u>
		<u>1,136,658,600</u>	<u>12.9</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	142,600	219,889,200	2.5
Resona Holdings, Inc.	334,300	272,788,800	3.1
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	50,700	423,040,800	4.8
		<u>915,718,800</u>	<u>10.4</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
FINANZDIENSTLEISTUNGEN					
ORIX Corp.(a)			44,000	¥ 138,028,000	1.6%
				<u>1,053,746,800</u>	<u>12.0</u>
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Air Water, Inc.			60,900	131,574,450	1.5
Kuraray Co., Ltd.			26,000	39,338,000	0.5
Tosoh Corp.(a)			73,300	149,458,700	1.7
Zeon Corp.			113,400	144,018,000	1.7
				<u>464,389,150</u>	<u>5.4</u>
CONTAINER UND VERPACKUNGEN					
Rengo Co., Ltd.			152,300	152,132,470	1.7
METALL UND BERGBAU					
Osaka Titanium Technologies Co., Ltd.(a)			33,200	88,411,600	1.0
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.			14,300	55,827,200	0.6
Toho Titanium Co., Ltd.(a)			46,100	75,788,400	0.9
				<u>220,027,200</u>	<u>2.5</u>
PAPIER- UND HOLZPRODUKTE					
Daio Paper Corp.			58,600	65,046,000	0.8
				<u>901,594,820</u>	<u>10.4</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
Nippon Telegraph & Telephone Corp.			1,556,400	283,731,720	3.2
UNTERHALTUNG					
Konami Group Corp.			33,100	333,648,000	3.8
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Kakaku.com, Inc.			91,800	157,666,500	1.8
MEDIEN					
Kadokawa Corp.			37,600	107,385,600	1.2
				<u>882,431,820</u>	<u>10.0</u>
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Asahi Group Holdings Ltd.			19,936	102,331,488	1.2
Kirin Holdings Co., Ltd.			42,900	89,425,050	1.0
				<u>191,756,538</u>	<u>2.2</u>
VERTRIEB UND EINZELHANDEL VON NICHT-ZYKLISCHEN KONSUMGÜTERN					
Sundrug Co., Ltd.			29,800	139,255,400	1.6
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Nichirei Corp.(a)			39,800	149,528,600	1.7
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE					
Pola Orbis Holdings, Inc.			83,600	125,065,600	1.4
				<u>605,606,138</u>	<u>6.9</u>
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG					
Daito Trust Construction Co., Ltd.			4,500	79,942,500	0.9
Mitsui Fudosan Co., Ltd.			51,600	209,547,600	2.4
				<u>289,490,100</u>	<u>3.3</u>
GESUNDHEITSWESEN					
PHARMAZEUTIKA					
Nippon Shinyaku Co., Ltd.			23,500	112,095,000	1.3
Santen Pharmaceutical Co., Ltd.			66,600	99,000,900	1.1
				<u>211,095,900</u>	<u>2.4</u>
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
ENEOS Holdings, Inc.			321,600	207,850,080	2.4
Gesamtanlagen					
(Kosten ¥7,338,791,863)				¥ 8,689,135,208	99.1%
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(b)	2.90 %	–		25,366	0.0
ANZ, London(b)	3.15 %	–		56,575	0.0
BBH, New York(b)	2.86 %	–		134	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	2.58 %	–		689	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	6.65 %	–		218,942	0.0
Citibank, New York(b)	4.68 %	–		3,012,205	0.0

	Zinssatz	Datum	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
SMBC, London(b)	(0.36)%	–	¥ 35,885,928	0.4%
Termineinlagen insgesamt			<u>39,199,839</u>	<u>0.4</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>42,142,152</u>	<u>0.5</u>
Nettovermögen			<u>¥ 8,770,477,199</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 4,225	JPY 413,686	03/04/2024	¥ 1,935,287
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 10	JPY 921	03/04/2024	(7,563)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CZK 588	JPY 3,782	03/04/2024	22,901
Brown Brothers Harriman & Co.+	CZK 11	JPY 73	03/04/2024	(406)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,032	JPY 331,683	03/04/2024	2,431,722
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 92	JPY 14,734	03/04/2024	(185,560)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 400,220	AUD 4,127	03/04/2024	1,949,384
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 10,632	AUD 108	03/04/2024	(121,498)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 203	CZK 32	03/04/2024	1,280
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 3,635	CZK 567	03/04/2024	(7,298)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 315,099	EUR 1,973	03/04/2024	4,500,872
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 24,702	EUR 152	03/04/2024	(130,863)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 37,524	NZD 416	03/04/2024	466,312
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 2,051	NZD 22	03/04/2024	(17,563)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 37,939	SGD 345	03/04/2024	508,886
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 572	SGD 5	03/04/2024	(2,478)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 725,341	USD 4,926	03/04/2024	13,247,732
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 27,514	USD 183	03/04/2024	(63,315)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 1,415	ZAR 182	03/04/2024	3,679
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 40,859	ZAR 5,202	03/04/2024	(193,954)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 438	JPY 40,271	03/04/2024	246,662
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 346	JPY 38,737	03/04/2024	195,856
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 4	JPY 476	03/04/2024	(955)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,020	JPY 756,786	03/04/2024	4,201,593
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 90	JPY 13,335	03/04/2024	(120,401)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 5,384	JPY 42,296	03/04/2024	212,331
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2	JPY 248	04/02/2024	1,894
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 406,515	AUD 4,167	04/02/2024	(1,989,830)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 3,782	CZK 591	04/02/2024	(23,488)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 330,215	EUR 2,030	04/02/2024	(2,442,037)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 39,806	NZD 435	04/02/2024	(253,209)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 39,850	SGD 357	04/02/2024	(209,101)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 750,698	USD 5,002	04/02/2024	(4,341,289)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 41,372	ZAR 5,304	04/02/2024	(213,140)
				<u>¥ 19,602,443</u>
			Wertsteigerung	¥ 29,926,391
			Wertminderung	¥ (10,323,948)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
AUTOMOBILKOMponentEN			
Huayu Automotive Systems Co., Ltd. - Class A	215,100	\$ 521,453	0.8%
KRAFTFAHRZEUGE			
BYD Co., Ltd. - Class H	48,000	1,185,056	1.9
BREIT ANGELEGTER EINZELHANDEL			
Alibaba Group Holding Ltd. - Class H	562,060	5,233,307	8.3
PDD Holdings, Inc. (ADR)	9,760	1,215,510	1.9
		<u>6,448,817</u>	<u>10.2</u>
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
New Oriental Education & Technology Group, Inc. - Class H	138,700	1,315,343	2.1
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Meituan - Class H	53,970	550,074	0.9
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai - Class A (Stock Connect)	230,800	1,250,658	2.0
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Topsports International Holdings Ltd. - Class H	951,000	646,187	1.0
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Bosideng International Holdings Ltd. - Class H	2,094,000	1,056,428	1.7
Samsonite International SA - Class H	321,900	1,124,461	1.8
Stella International Holdings Ltd. - Class H	919,000	1,258,277	2.0
		<u>3,439,166</u>	<u>5.5</u>
		<u>15,356,754</u>	<u>24.4</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank of Beijing Co., Ltd. - Class A	1,436,200	1,032,348	1.6
Bank of Changsha Co., Ltd. - Class A	593,900	641,996	1.0
China Construction Bank Corp. - Class H	3,559,100	2,218,329	3.5
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class H	302,000	1,178,377	1.9
Chongqing Rural Commercial Bank Co., Ltd. - Class H	3,268,000	1,318,971	2.1
		<u>6,390,021</u>	<u>10.1</u>
VERSICHERUNGEN			
China Life Insurance Co., Ltd. - Class H	954,000	1,175,822	1.8
China Pacific Insurance Group Co., Ltd. - Class H	351,600	670,912	1.1
PICC Property & Casualty Co., Ltd. - Class H	770,000	1,054,269	1.7
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	402,000	1,802,184	2.8
		<u>4,703,187</u>	<u>7.4</u>
		<u>11,093,208</u>	<u>17.5</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
NetEase, Inc. - Class H	70,600	1,588,827	2.5
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Tencent Holdings Ltd. - Class H	161,800	5,728,458	9.0
		<u>7,317,285</u>	<u>11.5</u>
INDUSTRIEGÜTER			
BAU- UND INGENIEURWESEN			
China Railway Group Ltd. - Class H	1,028,000	501,559	0.8
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
NARI Technology Co., Ltd. - Class A	423,370	1,361,806	2.1
Sungrow Power Supply Co., Ltd. - Class A (Stock Connect)	38,500	465,917	0.7
		<u>1,827,723</u>	<u>2.8</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
Guoco Group Ltd. - Class H	64,000	717,696	1.1
MASCHINEN			
Techtronic Industries Co., Ltd. - Class H	59,500	644,055	1.0
Weichai Power Co., Ltd. - Class H	688,000	1,353,241	2.1
XCMG Construction Machinery Co., Ltd. - Class A (Stock Connect)	597,200	491,424	0.8
Yutong Bus Co., Ltd. - Class A	407,900	1,056,768	1.7
		<u>3,545,488</u>	<u>5.6</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
BOC Aviation Ltd. - Class H	86,400	636,730	1.0
		<u>7,229,196</u>	<u>11.3</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
China Petroleum & Chemical Corp. - Class H			3,358,000	\$ 1,857,097	2.9%
PetroChina Co., Ltd. - Class H			3,666,000	2,888,974	4.6
				<u>4,746,071</u>	<u>7.5</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN					
BOE Technology Group Co., Ltd. - Class A (Stock Connect)			2,095,200	1,160,059	1.8
Tripod Technology Corp.			125,000	822,537	1.3
				<u>1,982,596</u>	<u>3.1</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG					
Will Semiconductor Co., Ltd. Shanghai - Class A			55,100	734,014	1.2
SOFTWARE					
Sinosoft Co., Ltd. - Class A			159,800	657,703	1.0
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE					
Shenzhen Transsion Holdings Co., Ltd. - Class A			28,797	634,170	1.0
				<u>4,008,483</u>	<u>6.3</u>
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF					
Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co., Ltd.					
- Class A (Stock Connect)			138,600	688,730	1.1
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd.					
- Class A (Stock Connect)			12,200	489,564	0.8
				<u>1,178,294</u>	<u>1.9</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN					
Jointown Pharmaceutical Group Co., Ltd. - Class A			783,568	885,080	1.4
PHARMAZEUTIKA					
China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co., Ltd.					
- Class A (Stock Connect)			74,900	571,437	0.9
Dong-E-E-Jiao Co., Ltd. - Class A (Stock Connect)			76,300	615,046	1.0
Tonghua Dongbao Pharmaceutical Co., Ltd. - Class A			465,500	671,146	1.1
				<u>1,857,629</u>	<u>3.0</u>
				<u>3,921,003</u>	<u>6.3</u>
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd. - Class A			96,900	722,071	1.1
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A			4,200	987,872	1.6
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class H			158,000	1,014,049	1.6
				<u>2,723,992</u>	<u>4.3</u>
VERTRIEB UND EINZELHANDEL VON NICHT-ZYKLISCHEN KONSUMGÜTERN					
Taiwan FamilyMart Co., Ltd./Taiwan			28,000	165,646	0.3
				<u>2,889,638</u>	<u>4.6</u>
GRUNDSTOFFE					
METALL UND BERGBAU					
Baoshan Iron & Steel Co., Ltd. - Class A			768,900	711,668	1.1
Shandong Nanshan Aluminum Co., Ltd. - Class A			1,371,300	589,896	0.9
Western Mining Co., Ltd. - Class A			229,700	530,709	0.8
Zijin Mining Group Co., Ltd. - Class H			646,000	1,044,557	1.6
				<u>2,876,830</u>	<u>4.4</u>
VERSORGUNG					
GASVERSORGUNGSBETRIEBE					
China Resources Gas Group Ltd. - Class H			218,300	660,797	1.0
Kunlun Energy Co., Ltd. - Class H			1,778,000	1,519,231	2.4
				<u>2,180,028</u>	<u>3.4</u>
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN					
China Longyuan Power Group Corp., Ltd. - Class H			918,000	649,559	1.0
				<u>2,829,587</u>	<u>4.4</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$68,380,754)				\$ 62,268,055	98.2%
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(a)	2.90 %	–		539	0.0
BBH, New York(a)	2.58 %	–		1	0.0
BBH, New York(a)	3.83 %	–		1	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	3.15 %	–		4,173	0.0
HSBC, Hong Kong(a)	2.69 %	–		6,515	0.0
HSBC, London(a)	4.15 %	–		16	0.0

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettovermögen %
HSBC, Paris(a)	2.86 %	–	\$ 33,859	0.1%
SMBC, London(a)	(0.36)%	–	12,062	0.0
SMBC, London(a)	4.68 %	–	1,809,787	2.9
Standard Chartered Bank, Johannesburg(a)	6.65 %	–	15,875	0.0
Termineinlagen insgesamt			<u>1,882,828</u>	<u>3.0</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>(756,457)</u>	<u>(1.2)</u>
Nettovermögen			<u>\$ 63,394,426</u>	<u>100.0</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 917	USD 603	03/04/2024	\$ 6,681
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 9,521	USD 6,185	03/04/2024	(3,369)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 832	USD 615	03/04/2024	1,268
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 222	USD 240	03/04/2024	184
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 463	USD 586	03/04/2024	1,135
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 1,460	USD 889	03/04/2024	643
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 1,243	USD 312	03/04/2024	536
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 14	USD 3	03/04/2024	(4)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 2	USD 2	03/04/2024	12
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 72	USD 54	03/04/2024	(42)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 84	AUD 129	03/04/2024	72
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,788	AUD 10,309	03/04/2024	(87,053)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 621	CAD 832	03/04/2024	(7,087)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 10	EUR 9	03/04/2024	29
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 231	EUR 213	03/04/2024	(843)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 8	GBP 6	03/04/2024	0*
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 580	GBP 457	03/04/2024	(3,476)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 896	NZD 1,460	03/04/2024	(7,072)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 29	PLN 117	03/04/2024	189
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 286	PLN 1,140	03/04/2024	(185)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0**	SGD 0**	03/04/2024	0*
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 55	SGD 74	03/04/2024	(305)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 338	ZAR 6,521	03/04/2024	1,809
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 10,860	ZAR 204,442	03/04/2024	(201,187)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 17,538	USD 927	03/04/2024	12,119
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 193,425	USD 10,081	03/04/2024	(3,662)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 129	USD 84	04/02/2024	(78)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 8	USD 6	04/02/2024	0*
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1	USD 1	04/02/2024	1
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 2	USD 2	04/02/2024	5
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 11	USD 6	04/02/2024	4
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 0**	USD 0**	04/02/2024	(0)*
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,028	AUD 9,270	04/02/2024	3,221
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 492	CAD 667	04/02/2024	(141)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 232	EUR 215	04/02/2024	(157)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 572	GBP 452	04/02/2024	(1,087)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 855	NZD 1,404	04/02/2024	(390)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 312	PLN 1,243	04/02/2024	(545)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 54	SGD 72	04/02/2024	41
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 9,976	ZAR 191,860	04/02/2024	2,376
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 3,672	USD 190	04/02/2024	(550)
				<u>\$ (286,908)</u>
			Wertsteigerung	\$ 30,325
			Wertminderung	\$ (317,233)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

* Betrag kleiner als 0.50.

** Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar

CAD – Canadian Dollar

EUR – Euro
GBP – Great British Pound
NZD – New Zealand Dollar
PLN – Polish Zloty
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
JSC – Joint Stock Company

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
KANADA					
Canadian Government Bond	3.75%	02/01/2025	CAD 12,026	\$ 8,787,656	2.0%
KOLUMBIEN					
Colombian TES, Series B	5.75%	11/03/2027	COP 14,603,600	3,346,959	0.8
JAPAN					
Japan Government Twenty Year Bond, Series 70	2.40%	06/20/2024	JPY 4,825,700	32,432,605	7.3
Japan Government Twenty Year Bond, Series 82	2.10%	09/20/2025	1,794,450	12,335,511	2.8
Japan Government Twenty Year Bond, Series 88	2.30%	06/20/2026	2,624,500	18,355,330	4.2
				63,123,446	14.3
MEXIKO					
Mexican Bonos, Series M	5.00%	03/06/2025	MXN 54,415	3,038,120	0.7
VEREINIGTES KÖNIGREICH					
United Kingdom Gilt	4.13%	01/29/2027	GBP 2,816	3,540,312	0.8
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	7.63%	02/15/2025	USD 26,475	27,165,320	6.1
U.S. Treasury Notes	4.00%	01/15/2027	22,550	22,274,876	5.0
U.S. Treasury Notes	4.50%	07/15/2026	18,317	18,293,704	4.1
U.S. Treasury Notes	4.63%	03/15/2026	46,642	46,627,025	10.6
U.S. Treasury Notes	4.63%	11/15/2026	47,744	47,907,819	10.9
U.S. Treasury Notes	5.00%	10/31/2025	14,620	14,672,040	3.3
				176,940,784	40.0
				258,777,277	58.6
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV, Series E	2.38%	06/01/2027	EUR 1,500	1,561,945	0.4
AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025	USD 486	484,822	0.1
AIB Group PLC	7.58%	10/14/2026	973	998,001	0.2
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series G	4.13%	05/10/2026	EUR 1,300	1,407,617	0.3
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.94%	01/26/2026	USD 1,444	1,434,001	0.3
Barclays PLC, Series E	2.89%	01/31/2027	EUR 1,008	1,068,572	0.2
Barclays PLC, Series E	3.38%	04/02/2025	409	441,753	0.1
BPCE SA	0.63%	04/28/2025	1,700	1,772,038	0.4
Citigroup, Inc.	2.01%	01/25/2026	USD 1,229	1,187,381	0.3
Citigroup, Inc.(a)	6.88%	03/17/2026	549	553,316	0.1
Credit Agricole SA, Series E	4.00%	10/12/2026	EUR 1,800	1,949,476	0.4
Danske Bank A/S	0.98%	09/10/2025	USD 1,009	981,959	0.2
Danske Bank A/S	3.77%	03/28/2025	745	743,701	0.2
DNB Bank ASA, Series E	4.00%	08/17/2027	GBP 1,455	1,779,801	0.4
HSBC Holdings PLC	1.65%	04/18/2026	USD 1,831	1,747,802	0.4
ING Groep NV, Series G	1.25%	02/16/2027	EUR 1,700	1,742,848	0.4
Intesa Sanpaolo SpA, Series E	4.50%	10/02/2025	1,464	1,596,797	0.4
JPMorgan Chase & Co.	0.99%	04/28/2026	GBP 1,191	1,430,203	0.3
KBC Group NV, Series E	4.50%	06/06/2026	EUR 1,400	1,521,407	0.3
Morgan Stanley, Series G	1.88%	04/27/2027	1,683	1,727,244	0.4
NatWest Markets PLC, Series E	6.63%	06/22/2026	GBP 1,047	1,354,273	0.3
Nordea Bank Abp, Series E	6.00%	06/02/2026	1,220	1,548,416	0.4
Santander UK Group Holdings PLC, Series E	2.92%	05/08/2026	1,177	1,430,462	0.3
Standard Chartered PLC	2.82%	01/30/2026	USD 1,576	1,529,209	0.4
Standard Chartered PLC	6.17%	01/09/2027	257	258,938	0.1
Swedbank AB, Series E	3.75%	11/14/2025	EUR 1,764	1,906,245	0.4
UBS Group AG, Series E	1.00%	06/24/2027	1,718	1,734,784	0.4
				35,893,011	8.1
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The)(a)	5.86%	05/13/2026	USD 1,763	1,756,180	0.4
Nomura Holdings, Inc.	5.71%	01/09/2026	1,521	1,524,234	0.3
				3,280,414	0.7
FINANZEN					
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	1,214	1,199,908	0.3
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	747	743,374	0.2
				1,943,282	0.5
VERSICHERUNGEN					
Berkshire Hathaway, Inc.	0.00%	03/12/2025	EUR 2,171	2,260,781	0.5
Metropolitan Life Global Funding I, Series E	1.75%	05/25/2025	1,945	2,049,130	0.5
				4,309,911	1.0
				45,426,618	10.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INDUSTRIE					
INVESTITIONSGÜTER					
Parker-Hannifin Corp.	1.13%	03/01/2025	EUR 1,421	\$ 1,492,984	0.3%
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Comcast Corp.	0.00%	09/14/2026	1,774	1,756,667	0.4
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	0.25%	03/04/2026	626	634,146	0.1
AT&T, Inc.	3.55%	11/18/2025	745	802,918	0.2
CK Hutchison Group Telecom Finance SA.	0.75%	04/17/2026	1,566	1,586,046	0.4
Verizon Communications, Inc.	4.07%	06/18/2024	GBP 1,288	1,619,349	0.4
				4,642,459	1.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Ford Motor Credit Co. LLC.	5.80%	03/05/2027	USD 1,335	1,333,127	0.3
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	1,409	1,361,100	0.3
Hyundai Capital America.	5.95%	09/21/2026	1,600	1,617,209	0.4
Toyota Credit Canada, Inc.	5.29%	07/13/2026	CAD 1,044	780,569	0.2
Toyota Motor Finance Netherlands BV, Series E.	3.38%	01/13/2026	EUR 1,310	1,411,338	0.3
Volkswagen Financial Services NV.	2.13%	06/27/2024	GBP 1,300	1,623,216	0.4
				8,126,559	1.9
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
McDonald's Corp., Series G.	3.63%	11/28/2027	EUR 556	602,767	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
VF Corp., Series E.	4.13%	03/07/2026	542	577,664	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Abbott Ireland Financing DAC, Series EUR.	1.50%	09/27/2026	1,878	1,938,370	0.4
American Medical Systems Europe BV.	0.75%	03/08/2025	1,249	1,309,879	0.3
Bayer US Finance LLC.	6.13%	11/21/2026	USD 328	329,970	0.1
Becton Dickinson & Co.	0.03%	08/13/2025	EUR 551	564,405	0.1
DH Europe Finance II SARL.	0.20%	03/18/2026	1,783	1,803,342	0.4
Haleon Netherlands Capital BV, Series E.	1.25%	03/29/2026	353	363,601	0.1
				6,309,567	1.4
ENERGIE					
BP Capital Markets PLC, Series E.	2.21%	09/25/2026	1,655	1,740,879	0.4
TECHNOLOGIE					
Honeywell International, Inc., Series 4Y.	3.50%	05/17/2027	1,580	1,710,953	0.4
				26,960,499	6.1
VERSORGBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Enel Finance International NV.	6.80%	10/14/2025	USD 1,428	1,456,267	0.3
Orsted AS, Series E.	3.63%	03/01/2026	EUR 1,184	1,273,614	0.3
				2,729,881	0.6
ERDGAS					
National Grid North America, Inc., Series E.	0.41%	01/20/2026	1,301	1,319,007	0.3
				4,048,888	0.9
				76,436,005	17.3
GEDECKTE ANLEIHEN					
Banco de Sabadell SA, Series DMTN.	3.50%	08/28/2026	1,200	1,298,268	0.3
Bank of Montreal.	1.00%	04/05/2026	1,942	1,995,871	0.4
Bank of Nova Scotia (The).	0.45%	03/16/2026	320	325,335	0.1
Commonwealth Bank of Australia.	3.77%	08/31/2027	1,346	1,473,111	0.3
Commonwealth Bank of Australia, Series E.	0.50%	07/27/2026	704	709,981	0.2
Credit Agricole Home Loan SFH SA.	2.75%	01/12/2028	1,900	2,022,052	0.5
Danske Mortgage Bank PLC.	0.01%	11/24/2026	1,556	1,542,553	0.3
Korea Housing Finance Corp.	3.71%	04/11/2027	1,133	1,229,297	0.3
Lloyds Bank PLC, Series E.	0.13%	06/18/2026	1,641	1,646,053	0.4
Lloyds Bank PLC, Series E.	3.25%	02/02/2026	453	487,536	0.1
National Australia Bank Ltd., Series E.	0.88%	02/19/2027	1,361	1,366,914	0.3
National Australia Bank Ltd., Series G.	0.63%	03/16/2027	899	894,791	0.2
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj, Series E.	3.50%	08/31/2026	1,184	1,286,694	0.3
Royal Bank of Canada, Series E.	0.13%	04/26/2027	2,292	2,242,135	0.5
Santander UK PLC.	1.13%	03/12/2027	2,365	2,393,878	0.5
Shinhan Bank Co., Ltd.	3.32%	01/29/2027	1,885	2,028,247	0.5
Skandinaviska Enskilda Banken AB, Series 580.	1.00%	12/17/2025	SEK 14,000	1,291,260	0.3
Stadshypotek AB, Series E.	0.38%	03/13/2026	EUR 367	373,647	0.1
Sumitomo Mitsui Banking Corp., Series E.	3.60%	02/16/2026	455	490,117	0.1
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., Series E.	3.63%	04/06/2026	1,264	1,363,887	0.3
Toronto-Dominion Bank (The), Series E.	3.88%	03/13/2026	1,989	2,166,472	0.5
Westpac Banking Corp.	1.08%	04/05/2027	2,097	2,113,343	0.5
				30,741,442	7.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
FRANKREICH					
Dexia SA, Series E	2.13%	02/12/2025	GBP 6,200	\$ 7,606,390	1.7%
SNCF Reseau, Series E	1.13%	05/19/2027	EUR 2,600	2,636,704	0.6
Societe Nationale SNCF SACA	3.13%	11/02/2027	800	860,334	0.2
UNEDIC ASSEO, Series E	1.25%	03/28/2027	1,800	1,841,418	0.4
UNEDIC ASSEO, Series E	1.25%	10/21/2027	800	812,429	0.2
				<u>13,757,275</u>	<u>3.1</u>
JAPAN					
Development Bank of Japan, Inc., Series G	2.13%	09/01/2026	2,186	2,296,087	0.5
Development Bank of Japan, Inc., Series G	3.50%	09/13/2027	546	596,787	0.1
				<u>2,892,874</u>	<u>0.6</u>
NIEDERLANDE					
BNG Bank NV	3.25%	07/15/2025	AUD 3,765	2,408,608	0.6
				<u>19,058,757</u>	<u>4.3</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	09/01/2029	USD 0*	272	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	10/01/2029	1	957	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.00%	12/01/2030	1	675	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	09/01/2031	5	4,969	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	11/01/2031	3	2,646	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	12/01/2031	5	4,929	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	01/01/2032	1	991	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2002	7.00%	02/01/2032	1	975	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA . .	2.50%	03/01/2043	2,628	2,223,668	0.5
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA . .	3.00%	03/15/2043	2,532	2,220,727	0.5
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA . .	4.50%	03/01/2043	3,477	3,321,038	0.8
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA . .	5.00%	03/01/2042	3,399	3,319,541	0.7
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2024, TBA	2.00%	03/01/2051	2,834	2,227,926	0.5
				<u>13,329,314</u>	<u>3.0</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN					
KANADA					
Province of British Columbia Canada	2.50%	02/26/2027	AUD 1,461	889,699	0.2
Province of British Columbia Canada	4.25%	11/27/2024	3,010	1,951,530	0.4
Province of Ontario Canada	4.25%	08/22/2024	3,560	2,309,104	0.5
Province of Ontario Canada, Series DIP	3.10%	08/26/2025	4,545	2,892,122	0.7
Province of Quebec Canada	4.20%	03/10/2025	5,448	3,527,247	0.8
Province of Quebec Canada, Series E	1.13%	10/28/2025	EUR 1,217	1,268,706	0.3
				<u>12,838,408</u>	<u>2.9</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
DEUTSCHLAND					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4.10%	02/20/2026	AUD 3,811	2,469,694	0.6
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, Series E	1.38%	12/15/2025	GBP 4,269	5,082,482	1.1
				<u>7,552,176</u>	<u>1.7</u>
SÜDKOREA					
Korea International Bond	0.00%	10/15/2026	EUR 1,737	1,715,090	0.4
				<u>9,267,266</u>	<u>2.1</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class A1(a)	6.74%	07/20/2034	USD 1,646	1,648,679	0.4
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class A1(a)	6.75%	10/20/2034	1,144	1,144,057	0.3
Ballyrock CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class A1(a)	6.71%	07/20/2034	1,106	1,108,328	0.3
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class A1A(a)	7.01%	07/23/2032	1,471	1,474,447	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class A(a)	6.68%	07/16/2035	1,434	1,434,084	0.3
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class A(a)	6.76%	10/20/2034	1,018	1,018,729	0.2
				<u>7,828,324</u>	<u>1.8</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2021-R01, Class 1M1(a)	6.07%	10/25/2041	2	2,493	0.0
Series 2021-R01, Class 1M2(a)	6.87%	10/25/2041	79	78,917	0.0
Series 2021-R03, Class 1M1(a)	6.17%	12/25/2041	306	306,202	0.1
Eagle RE Ltd., Series 2021-2, Class M1B(a)	7.37%	04/25/2034	245	245,613	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2021-DNA5, Class M2(a)	6.97%	01/25/2034	192	193,170	0.0
Series 2021-DNA6, Class M1(a)	6.12%	10/25/2041	26	25,984	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2021-DNA6, Class M2(a)	6.82%	10/25/2041	USD 812	\$ 810,197	0.2%
Series 2021-HQA4, Class M1(a)	6.27%	12/25/2041	631	627,724	0.1
Series 2022-DNA3, Class M1A(a)	7.32%	04/25/2042	490	496,168	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C04, Class 1M2(a)	10.34%	11/25/2024	521	535,041	0.1
Series 2016-C02, Class 1M2(a)	11.44%	09/25/2028	208	217,567	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-2R, Class A(a)	9.19%	05/30/2025	347	347,324	0.1
Triangle Re Ltd., Series 2021-3, Class M1A(a)	7.22%	02/25/2034	59	59,518	0.0
				<u>3,945,918</u>	<u>0.9</u>
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE					
KANADA					
Canadian Government Real Return Bond	4.25%	12/01/2026	CAD 2,096	1,652,188	0.4
SCHWEDEN					
Sweden Inflation Linked Bond, Series 3104	3.50%	12/01/2028	SEK 3,280	563,143	0.1
Sweden Inflation Linked Bond, Series 3112	0.13%	06/01/2026	1,775	217,781	0.1
Sweden Inflation Linked Bond, Series 3113	0.13%	12/01/2027	11,935	1,429,475	0.3
				<u>2,210,399</u>	<u>0.5</u>
				<u>3,862,587</u>	<u>0.9</u>
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
SÜDKOREA					
Export-Import Bank of Korea	0.83%	04/27/2025	EUR 1,265	1,318,430	0.3
Korea Development Bank (The)	0.00%	07/10/2024	504	536,835	0.1
Korea National Oil Corp.	4.75%	04/03/2026	USD 1,381	1,365,602	0.3
				<u>3,220,867</u>	<u>0.7</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
City of San Antonio TX, Series 2023	5.64%	02/01/2026	1,230	1,238,617	0.3
				<u>440,544,782</u>	<u>99.8</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
VERSICHERUNGEN					
New York Life Global Funding(a)	5.83%	06/09/2026	2,083	2,065,646	0.5
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 43 Ltd., Series 2021-43A, Class A(a)	6.71%	07/17/2035	1,672	1,672,524	0.4
				<u>3,738,170</u>	<u>0.9</u>
Gesamtanlagen				<u>\$ 444,282,952</u>	<u>100.7%</u>
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(b)	2.90 %	–		48,452	0.0
BBH, New York(b)	6.65 %	–		1	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	2.58 %	–		48,853	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	3.15 %	–		101,559	0.0
Citibank, New York(b)	4.68 %	–		4,032,987	0.9
DNB, Oslo(b)	3.15 %	–		130	0.0
HSBC, London(b)	4.15 %	–		44,112	0.0
HSBC, Paris(b)	2.86 %	–		223,173	0.1
Scotiabank, Toronto(b)	3.83 %	–		44,081	0.0
SEB, Stockholm(b)	0.71 %	–		2,849	0.0
Termineinlagen insgesamt.				<u>4,546,197</u>	<u>1.0</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten.				<u>(7,626,362)</u>	<u>(1.7)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 441,202,787</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Canadian 5 Yr Bond Futures	06/19/2024	267	\$ 21,854,732	\$ 21,886,859	\$ 32,126
Euro-BOBL Futures	03/07/2024	90	11,327,324	11,304,952	(22,373)
Euro-Schatz Futures	03/07/2024	34	3,887,303	3,863,968	(23,334)
Korea 3 Yr Bond Futures	03/19/2024	261	20,572,665	20,482,502	(90,162)

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Short					
Australian 3 Yr Bond Futures	03/15/2024	67	4,608,025	4,636,959	\$ (28,934)
U.S. 10 Yr Ultra Futures	06/18/2024	51	5,815,594	5,822,766	(7,172)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	06/28/2024	132	14,104,406	14,111,625	(7,219)
					\$ (147,068)
				Wertsteigerung	\$ 32,126
				Wertminderung	\$ (179,194)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung(-minderung)
Bank of America NA	AUD	29,466	USD	19,167	03/06/2024	\$ 12,279
Bank of America NA	USD	3,720	GBP	2,932	03/06/2024	(18,560)
Bank of America NA	PEN	4,454	USD	1,189	03/15/2024	11,294
Bank of America NA	PEN	9,308	USD	2,452	03/15/2024	(8,390)
Bank of America NA	USD	2,066	CLP	1,914,527	03/15/2024	(85,657)
Bank of America NA	USD	2,564	PEN	9,888	03/15/2024	50,006
Bank of America NA	USD	1,021	PEN	3,825	03/15/2024	(10,155)
Bank of America NA	KRW	3,313,965	USD	2,494	04/18/2024	5,943
Bank of America NA	USD	2,490	TWD	77,892	05/24/2024	(15,388)
BNP Paribas	PLN	9,861	USD	2,475	03/06/2024	5,588
BNP Paribas	USD	11,163	EUR	10,281	03/06/2024	(50,566)
BNP Paribas	USD	2,462	MXN	42,039	03/06/2024	3,853
BNP Paribas	CAD	16,242	USD	12,019	03/07/2024	50,931
BNP Paribas	COP	13,385,236	USD	3,387	03/15/2024	(16,985)
BNP Paribas	USD	2,002	COP	7,886,016	03/15/2024	3,675
BNP Paribas	CZK	57,732	USD	2,460	04/19/2024	(1,348)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	368	USD	243	03/04/2024	3,446
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	10,918	USD	7,093	03/04/2024	(3,819)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	3,722	USD	2,744	03/04/2024	1,128
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	39,470	USD	42,689	03/04/2024	30,171
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	270	USD	290	03/04/2024	(1,039)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	2,799	USD	3,540	03/04/2024	6,579
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	70	USD	89	03/04/2024	(150)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD	472	USD	287	03/04/2024	171
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD	3	USD	2	03/04/2024	(10)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	6	USD	4	03/04/2024	32
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	577	USD	428	03/04/2024	(334)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	98	AUD	151	03/04/2024	85
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	7,334	AUD	11,134	03/04/2024	(97,116)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,775	CAD	3,722	03/04/2024	(32,606)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,007	EUR	935	03/04/2024	4,081
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	42,095	EUR	38,804	03/04/2024	(155,636)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3,645	GBP	2,869	03/04/2024	(22,872)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	0**	NZD	1	03/04/2024	0***
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	291	NZD	474	03/04/2024	(2,257)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3	SGD	4	03/04/2024	1
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	432	SGD	578	03/04/2024	(2,494)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,882	AUD	2,877	03/06/2024	(11,683)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	269	MXN	4,615	03/06/2024	1,392
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	491	SEK	5,056	03/06/2024	(3,643)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	150	USD	98	04/02/2024	(91)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	43	USD	32	04/02/2024	1
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	113	USD	123	04/02/2024	303
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	13	USD	16	04/02/2024	38
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD	3	USD	2	04/02/2024	1
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	0**	USD	0**	04/02/2024	-
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	4	USD	3	04/02/2024	(2)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	7,093	AUD	10,907	04/02/2024	3,789
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,661	CAD	3,609	04/02/2024	(761)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	42,451	EUR	39,202	04/02/2024	(29,125)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3,540	GBP	2,798	04/02/2024	(6,724)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	283	NZD	465	04/02/2024	(129)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	428	SGD	576	04/02/2024	329
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	250	HUF	89,960	04/19/2024	(3,137)
Citibank NA	COP	10,446,903	USD	2,637	03/15/2024	(19,928)
Citibank NA	PEN	19,145	USD	4,995	03/15/2024	(65,010)
Citibank NA	USD	543	CLP	519,600	03/15/2024	(5,747)
Citibank NA	USD	5,043	COP	20,007,505	03/15/2024	44,981
Citibank NA	KRW	2,479,078	USD	1,897	04/18/2024	35,100
Citibank NA	KRW	3,247,081	USD	2,432	04/18/2024	(6,336)

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Citibank NA.....	USD	2,571	KRW	3,410,362	04/18/2024	\$ (10,327)
Citibank NA.....	USD	2,179	HUF	782,645	04/19/2024	(32,039)
Citibank NA.....	USD	2,642	IDR	41,178,966	04/25/2024	(24,785)
HSBC Bank USA.....	SEK	40,510	USD	3,868	03/06/2024	(40,344)
HSBC Bank USA.....	USD	2,397	PLN	9,664	03/06/2024	22,896
HSBC Bank USA.....	CNH	17,584	USD	2,445	03/07/2024	4,792
HSBC Bank USA.....	USD	2,446	CNH	17,600	03/07/2024	(3,590)
HSBC Bank USA.....	USD	5,473	JPY	824,199	03/07/2024	27,368
HSBC Bank USA.....	USD	1,088	NZD	1,759	03/07/2024	(16,543)
HSBC Bank USA.....	USD	1,533	INR	127,695	03/14/2024	6,161
HSBC Bank USA.....	USD	2,529	KRW	3,361,542	04/18/2024	(5,165)
HSBC Bank USA.....	TWD	77,229	USD	2,486	05/24/2024	31,503
JPMorgan Chase Bank NA.....	JPY	10,315,177	USD	68,930	03/07/2024	93,947
JPMorgan Chase Bank NA.....	SGD	3,359	USD	2,502	03/07/2024	5,574
JPMorgan Chase Bank NA.....	USD	901	CAD	1,218	03/07/2024	(3,698)
Morgan Stanley & Co., International PLC.....	EUR	92,117	USD	99,081	03/06/2024	(486,592)
Morgan Stanley & Co., International PLC.....	GBP	24,187	USD	30,377	03/06/2024	(155,009)
Morgan Stanley & Co., International PLC.....	MXN	99,823	USD	5,829	03/06/2024	(25,338)
Morgan Stanley & Co., International PLC.....	USD	1,028	INR	85,670	03/14/2024	4,565
Morgan Stanley & Co., International PLC.....	USD	469	PEN	1,782	03/15/2024	1,490
						\$ (1,007,635)
					Wertsteigerung	\$ 473,493
					Wertminderung	\$ (1,481,128)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)	
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen		
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group).....	CNY	132,130	09/28/2026	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.211%	\$ 122,688
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group).....	CNY	91,330	10/30/2026	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.248%	98,420
Insgesamt						\$ 221,108

* Kapitalbetrag geringer als 500.

** Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

*** Betrag kleiner als 0.50.

(a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 29. Februar 2024.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar

CAD – Canadian Dollar

CLP – Chilean Peso

CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)

CNY – Chinese Yuan Renminbi

COP – Colombian Peso

CZK – Czech Koruna

EUR – Euro

GBP – Great British Pound

HUF – Hungarian Forint

IDR – Indonesian Rupiah

INR – Indian Rupee

JPY – Japanese Yen

KRW – South Korean Won

MXN – Mexican Peso

NZD – New Zealand Dollar
PEN – Peruvian Sol
PLN – Polish Zloty
SEK – Swedish Krona
SGD – Singapore Dollar
TWD – New Taiwan Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

BOBL – Bundesobligation
CBT – Chicago Board of Trade
CLO – Collateralized Loan Obligations
LCH – London Clearing House

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Advanced Drainage Systems, Inc.	5.00%	09/30/2027	USD 2,804	\$ 2,710,468	0.0%
Arsenal AIC Parent LLC	8.00%	10/01/2030	11,917	12,482,173	0.1
ASP Unifrax Holdings, Inc.	5.25%	09/30/2028	29,026	18,403,936	0.1
ASP Unifrax Holdings, Inc.	7.50%	09/30/2029	14,148	7,743,989	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	2,020	2,036,705	0.0
Constellium SE	3.13%	07/15/2029	EUR 10,042	10,036,382	0.1
Constellium SE	3.75%	04/15/2029	USD 8,657	7,741,969	0.1
CVR Partners LP/CVR Nitrogen Finance Corp.	6.13%	06/15/2028	16,045	15,194,041	0.1
Element Solutions, Inc.	3.88%	09/01/2028	4,893	4,437,410	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031	13,340	11,937,144	0.1
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	3,648	3,502,552	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	5.88%	04/15/2030	139	136,203	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	6.13%	04/15/2032	42,618	42,106,214	0.3
Hecla Mining Co.	7.25%	02/15/2028	25,670	25,617,314	0.2
INEOS Finance PLC	6.38%	04/15/2029	EUR 14,780	15,974,224	0.1
INEOS Finance PLC	7.50%	04/15/2029	USD 6,355	6,331,937	0.0
INEOS Quattro Finance 2 PLC	8.50%	03/15/2029	EUR 17,984	20,368,344	0.1
INEOS Quattro Finance 2 PLC	9.63%	03/15/2029	USD 1,496	1,575,655	0.0
Ingevity Corp.	3.88%	11/01/2028	3,728	3,289,221	0.0
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP(a)	9.00%	01/15/2026	12,133	10,810,419	0.1
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./ Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	31,016	28,875,544	0.2
Methanex Corp.	5.13%	10/15/2027	730	701,989	0.0
Methanex Corp.	5.25%	12/15/2029	1,078	1,025,159	0.0
Olympus Water US Holding Corp.	7.13%	10/01/2027	9,353	9,342,746	0.1
Olympus Water US Holding Corp.	9.75%	11/15/2028	32,666	34,736,019	0.2
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	4.38%	11/01/2026	EUR 5,856	6,257,287	0.0
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	5.38%	11/01/2026	USD 20,394	19,813,540	0.1
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	9.50%	07/15/2028	EUR 5,893	6,923,319	0.1
Vibrantz Technologies, Inc.	9.00%	02/15/2030	USD 46,334	42,644,816	0.3
WR Grace Holdings LLC	4.88%	06/15/2027	21,166	20,145,699	0.1
WR Grace Holdings LLC	5.63%	08/15/2029	7,344	6,443,511	0.0
				<u>399,345,929</u>	<u>2.6</u>
INVESTITIONSGÜTER					
ARD Finance SA(a)	5.00%	06/30/2027	EUR 50,431	21,453,275	0.2
ARD Finance SA(a)	6.50%	06/30/2027	USD 14,019	6,124,566	0.0
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	4.00%	09/01/2029	1,000	812,361	0.0
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	6.00%	06/15/2027	2,931	2,872,380	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	2.13%	08/15/2026	EUR 700	680,299	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.13%	08/15/2026	USD 12,037	11,127,602	0.1
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	08/15/2027	3,000	2,160,000	0.0
Ball Corp.	2.88%	08/15/2030	2,000	1,692,903	0.0
Ball Corp.	6.00%	06/15/2029	15,602	15,686,058	0.1
Bombardier, Inc.	6.00%	02/15/2028	37	35,912	0.0
Bombardier, Inc.	7.50%	02/01/2029	431	437,184	0.0
Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027	357	357,353	0.0
Bombardier, Inc.	8.75%	11/15/2030	22,122	23,182,507	0.2
Calderys Financing LLC	11.25%	06/01/2028	30,200	32,334,081	0.2
Chart Industries, Inc.	7.50%	01/01/2030	8,185	8,444,683	0.1
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	2,611	2,509,274	0.0
Clean Harbors, Inc.	6.38%	02/01/2031	2,813	2,797,684	0.0
Covanta Holding Corp.	4.88%	12/01/2029	1,500	1,314,790	0.0
Crown Americas LLC	5.25%	04/01/2030	7,735	7,450,320	0.1
Crown European Holdings SA	4.75%	03/15/2029	EUR 129	141,150	0.0
Crown European Holdings SA	5.00%	05/15/2028	892	987,009	0.0
Eco Material Technologies, Inc.	7.88%	01/31/2027	USD 34,488	34,538,539	0.2
EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer, Inc.	6.63%	12/15/2030	8,099	8,125,116	0.1
EnerSys	4.38%	12/15/2027	18,085	17,020,340	0.1
EnerSys	6.63%	01/15/2032	9,501	9,534,293	0.1
Enviri Corp.	5.75%	07/31/2027	16,968	15,930,173	0.1
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026	20,200	20,192,257	0.1
GFL Environmental, Inc.	3.50%	09/01/2028	1,000	906,213	0.0
GFL Environmental, Inc.	6.75%	01/15/2031	8,097	8,284,245	0.1
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	30,814	29,830,352	0.2
Husky Injection Molding Systems Ltd./Titan Co-Borrower LLC ..	9.00%	02/15/2029	6,666	6,817,984	0.1
IMA Industria Macchine Automatiche SpA.	3.75%	01/15/2028	EUR 700	721,952	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
LSB Industries, Inc.	6.25%	10/15/2028	USD 21,913	\$ 20,770,190	0.1%
Madison IAQ LLC	5.88%	06/30/2029	32,314	28,873,179	0.2
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	7,075	6,625,251	0.1
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	20,393	21,413	0.0
Paprec Holding SA	7.25%	11/17/2029	EUR 4,100	4,697,971	0.0
Rolls-Royce PLC, Series E	1.63%	05/09/2028	1,077	1,060,701	0.0
Rolls-Royce PLC, Series E	3.38%	06/18/2026	GBP 873	1,052,733	0.0
Spirit AeroSystems, Inc.	9.38%	11/30/2029	USD 920	995,020	0.0
Spirit AeroSystems, Inc.	9.75%	11/15/2030	79	84,642	0.0
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	EUR 1,200	1,255,215	0.0
TK Elevator US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	USD 16,052	15,415,731	0.1
Trinity Industries, Inc.	7.75%	07/15/2028	15,887	16,447,372	0.1
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025	8,167	8,167,000	0.1
Triumph Group, Inc.	9.00%	03/15/2028	34,171	35,698,767	0.2
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	EUR 2,000	2,086,313	0.0
WESCO Distribution, Inc.	6.38%	03/15/2029	USD 8,029	8,039,147	0.1
WESCO Distribution, Inc.	6.63%	03/15/2032	8,126	8,132,301	0.1
WESCO Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	31,560	31,644,655	0.2
WESCO Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	9,377	9,589,488	0.1
				495,159,944	3.5
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	30,458	28,351,577	0.2
Altice Financing SA	3.00%	01/15/2028	EUR 700	665,950	0.0
Altice Financing SA	5.75%	08/15/2029	USD 42,404	36,455,194	0.3
AMC Networks, Inc.	4.25%	02/15/2029	7,963	5,153,036	0.0
AMC Networks, Inc.	4.75%	08/01/2025	36,332	34,644,804	0.2
Arches Buyer, Inc.	4.25%	06/01/2028	1,728	1,476,476	0.0
Arches Buyer, Inc.	6.13%	12/01/2028	8,568	7,321,790	0.1
Banjay Entertainment SASU	7.00%	05/01/2029	EUR 8,362	9,466,938	0.1
Banjay Entertainment SASU	8.13%	05/01/2029	USD 12,775	13,211,421	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.25%	01/15/2034	22,642	16,933,181	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	21,000	17,419,601	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033	5,160	3,970,899	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	02/01/2032	22,374	18,062,312	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.00%	02/01/2028	1,000	923,640	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	6.38%	09/01/2029	10,989	10,326,159	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	7.38%	03/01/2031	4,292	4,156,689	0.0
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	35,824	33,504,338	0.2
CSC Holdings LLC	3.38%	02/15/2031	1,728	1,219,151	0.0
CSC Holdings LLC	4.50%	11/15/2031	5,000	3,707,814	0.0
CSC Holdings LLC	4.63%	12/01/2030	7,112	3,960,825	0.0
CSC Holdings LLC	5.38%	02/01/2028	22,461	19,583,148	0.1
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	16,508	9,704,037	0.1
CSC Holdings LLC	6.50%	02/01/2029	5,713	4,976,094	0.0
CSC Holdings LLC	7.50%	04/01/2028	10,613	7,542,531	0.0
CSC Holdings LLC	11.25%	05/15/2028	4,448	4,589,757	0.0
CSC Holdings LLC	11.75%	01/31/2029	6,703	7,016,803	0.1
DISH DBS Corp.	5.25%	12/01/2026	43,029	34,365,334	0.2
DISH DBS Corp.	5.75%	12/01/2028	30,009	20,781,081	0.1
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	4,019	3,797,696	0.0
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026	10,657	6,702,453	0.1
Gray Television, Inc.	5.38%	11/15/2031	27,739	17,961,487	0.1
Gray Television, Inc.	5.88%	07/15/2026	3,728	3,538,494	0.0
Gray Television, Inc.	7.00%	05/15/2027	2,500	2,258,205	0.0
iHeartCommunications, Inc.	4.75%	01/15/2028	9,137	6,571,536	0.1
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	15,176	11,249,061	0.1
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026	2,630	2,199,179	0.0
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	2,301	2,189,545	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	5.13%	07/15/2029	27,724	23,294,196	0.2
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	26,395	24,941,707	0.2
McGraw-Hill Education, Inc.	5.75%	08/01/2028	38,388	35,931,229	0.3
National CineMedia, Inc.	5.75%	08/15/2026	6,800	0	0.0
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.	4.63%	03/15/2030	8,826	7,867,562	0.1
Paramount Global	6.25%	02/28/2057	897	740,032	0.0
Paramount Global	6.38%	03/30/2062	1,500	1,301,218	0.0
Radiate Holdeo LLC/Radiate Finance, Inc.	4.50%	09/15/2026	24,252	19,099,295	0.1
Scripps Escrow II, Inc.	3.88%	01/15/2029	1,895	1,481,315	0.0
Sinclair Television Group, Inc.	4.13%	12/01/2030	5,620	4,047,787	0.0
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	16,327	11,804,639	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	09/01/2031	277	229,340	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	4.00%	07/15/2028	59,772	53,888,612	0.4
Sirius XM Radio, Inc.	5.00%	08/01/2027	5,400	5,154,898	0.0
Summer BC Bidco B LLC	5.50%	10/31/2026	6,800	6,586,573	0.1
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	EUR 18,418	19,670,947	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
TEGNA, Inc.	4.63%	03/15/2028	USD 6,013	\$ 5,431,755	0.0%
TEGNA, Inc.	4.75%	03/15/2026	4,806	4,648,624	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	17,872	15,732,710	0.1
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	5,371	4,703,844	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	29,088	28,199,396	0.2
Univision Communications, Inc.	7.38%	06/30/2030	18,576	17,940,981	0.1
Urban One, Inc.	7.38%	02/01/2028	49,053	42,177,957	0.3
Virgin Media Finance PLC	3.75%	07/15/2030	EUR 700	663,401	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	USD 6,000	5,242,152	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	05/15/2029	1,952	1,833,778	0.0
Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC	5.00%	07/15/2028	2,300	2,121,392	0.0
VZ Secured Financing BV	3.50%	01/15/2032	EUR 6,945	6,681,840	0.1
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	USD 7,737	6,617,366	0.1
Ziggo Bond Co. BV	6.00%	01/15/2027	820	800,682	0.0
Ziggo BV	2.88%	01/15/2030	EUR 2,374	2,289,370	0.0
				777,082,834	5.1
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France Holding SA	10.50%	05/15/2027	USD 16,348	10,549,429	0.1
Altice France SA/France	5.13%	07/15/2029	19,282	14,597,192	0.1
Altice France SA/France	5.50%	01/15/2028	4,443	3,622,482	0.0
Altice France SA/France	5.50%	10/15/2029	15,431	11,687,990	0.1
Altice France SA/France	5.88%	02/01/2027	EUR 1,200	1,167,664	0.0
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027	USD 8,421	7,723,868	0.1
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	9,166	8,997,416	0.1
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	16,974	14,614,382	0.1
Digicel Intermediate Holdings Ltd./ Digicel International Finance Ltd./Difl US	12.00%	05/25/2027	4,360	4,272,032	0.0
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	16,153	9,142,139	0.1
Eutelsat SA.	1.50%	10/13/2028	EUR 300	209,258	0.0
Frontier Communications Holdings LLC	8.63%	03/15/2031	USD 1,019	1,032,101	0.0
Frontier Communications Holdings LLC	8.75%	05/15/2030	223	227,419	0.0
Iliad Holding SASU.	6.50%	10/15/2026	9,478	9,387,542	0.1
Level 3 Financing, Inc.	4.25%	07/01/2028	9,052	4,309,373	0.0
Level 3 Financing, Inc.	4.63%	09/15/2027	17,665	10,258,100	0.1
Lorca Telecom Bondco SA	4.00%	09/18/2027	EUR 4,000	4,243,556	0.0
Nexstar Media, Inc.	5.63%	07/15/2027	USD 12,783	12,115,320	0.1
Telecom Italia Capital SA	6.00%	09/30/2034	2,000	1,855,987	0.0
Telecom Italia Capital SA	6.38%	11/15/2033	591	566,568	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	32,697	32,523,651	0.2
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	13,001	13,285,552	0.1
Telecom Italia Finance SA, Series E	7.75%	01/24/2033	EUR 16	20,241	0.0
Telecom Italia SpA/Milano	5.30%	05/30/2024	USD 1,000	995,823	0.0
Telecom Italia SpA/Milano	7.88%	07/31/2028	EUR 381	453,420	0.0
Telecom Italia SpA/Milano, Series E	5.25%	03/17/2055	100	100,371	0.0
United Group BV	3.63%	02/15/2028	5,387	5,476,718	0.0
United Group BV	4.00%	11/15/2027	14,021	14,458,146	0.1
United Group BV	4.63%	08/15/2028	3,991	4,121,827	0.0
United Group BV	6.75%	02/15/2031	4,221	4,632,160	0.0
United States Cellular Corp.	6.70%	12/15/2033	USD 1,014	997,777	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.75%	07/15/2031	42,248	36,524,660	0.3
Vodafone Group PLC.	3.25%	06/04/2081	1,005	933,944	0.0
Vodafone Group PLC.	4.13%	06/04/2081	17,526	15,036,374	0.1
Vodafone Group PLC.	4.88%	10/03/2078	GBP 831	1,023,057	0.0
Vodafone Group PLC.	5.13%	06/04/2081	USD 39	28,986	0.0
				261,192,525	1.8
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Allison Transmission, Inc.	3.75%	01/30/2031	1,000	865,105	0.0
Allison Transmission, Inc.	5.88%	06/01/2029	7,094	6,996,781	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	5.00%	10/01/2029	3,000	2,600,132	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	03/15/2026	1,286	1,271,196	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	1,890	1,864,356	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	16,111	15,558,987	0.1
Aston Martin Capital Holdings Ltd.	10.50%	11/30/2025	33,451	33,845,154	0.2
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	3,621	3,615,060	0.0
Dana, Inc.	4.50%	02/15/2032	19,828	16,635,602	0.1
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	232	225,071	0.0
Dana, Inc.	5.63%	06/15/2028	3,358	3,253,197	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The).	5.25%	07/15/2031	17,393	15,693,220	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co. (The).	5.63%	04/30/2033	6,675	5,968,903	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a)	4.75%	09/15/2026	12,039	11,675,823	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	6.00%	05/15/2027	15,335	15,119,032	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	6.38%	05/15/2029	15,335	15,123,261	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	8.75%	05/15/2028	EUR 9,672	11,326,576	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC.	5.50%	07/15/2029	USD 10,597	10,220,557	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Jaguar Land Rover Automotive PLC.....	5.88%	01/15/2028	USD 14,183	\$ 13,964,430	0.1%
Jaguar Land Rover Automotive PLC.....	7.75%	10/15/2025	24,649	24,804,708	0.2
Mclaren Finance PLC	7.50%	08/01/2026	31,275	27,320,393	0.2
PM General Purchaser LLC.....	9.50%	10/01/2028	25,274	25,593,409	0.2
Tenneco, Inc.	8.00%	11/17/2028	39,998	36,460,583	0.3
Titan International, Inc.	7.00%	04/30/2028	24,723	24,462,295	0.2
ZF Europe Finance BV	2.00%	02/23/2026	EUR 300	308,379	0.0
ZF Europe Finance BV	3.00%	10/23/2029	100	98,577	0.0
ZF Europe Finance BV, Series E.....	6.13%	03/13/2029	300	339,943	0.0
ZF Finance GmbH, Series E	2.00%	05/06/2027	200	199,678	0.0
ZF Finance GmbH, Series E	3.00%	09/21/2025	1,000	1,059,184	0.0
ZF Finance GmbH, Series E	3.75%	09/21/2028	5,000	5,173,072	0.0
ZF North America Capital, Inc.....	4.75%	04/29/2025	USD 33,093	32,585,666	0.2
ZF North America Capital, Inc.....	6.88%	04/14/2028	3,434	3,503,964	0.0
ZF North America Capital, Inc.....	7.13%	04/14/2030	6,526	6,784,977	0.1
				<u>374,517,271</u>	<u>2.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	4.00%	08/01/2028	16,360	15,090,775	0.1
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	29,310	28,954,390	0.2
Carnival Corp.	7.00%	08/15/2029	6,890	7,131,150	0.1
Carnival Corp.	7.63%	03/01/2026	EUR 5,800	6,386,052	0.0
Carnival Corp.	10.50%	06/01/2030	USD 5,000	5,437,500	0.0
Carnival PLC	1.00%	10/28/2029	EUR 100	84,321	0.0
Cedar Fair LP.....	5.25%	07/15/2029	USD 2,135	2,015,116	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.....	5.38%	04/15/2027	8,970	8,875,045	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.....	5.50%	05/01/2025	39,998	39,869,589	0.3
Lindblad Expeditions LLC	6.75%	02/15/2027	9,468	9,496,917	0.1
Merlin Entertainment Group US Holdings, Inc.	7.38%	02/15/2031	15,074	15,079,639	0.1
Motion Bondco DAC.....	4.50%	11/15/2027	EUR 13,300	13,615,069	0.1
NCL Corp., Ltd.	5.88%	03/15/2026	USD 13,503	13,184,991	0.1
NCL Corp., Ltd.	8.13%	01/15/2029	9,763	10,286,321	0.1
NCL Corp., Ltd.	8.38%	02/01/2028	5,866	6,161,698	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	3.70%	03/15/2028	283	259,885	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	4.25%	07/01/2026	92	88,851	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.38%	07/15/2027	16,520	16,221,622	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	08/31/2026	18,015	17,816,404	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	13,254	13,045,286	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	7.25%	01/15/2030	5,857	6,088,902	0.0
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	5.25%	08/15/2029	8,323	7,762,151	0.1
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025	19,206	19,291,306	0.1
Six Flags Entertainment Corp.....	5.50%	04/15/2027	2,000	1,964,113	0.0
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	7,759	7,781,558	0.1
Viking Cruises Ltd.	5.88%	09/15/2027	12,945	12,675,166	0.1
Viking Cruises Ltd.	7.00%	02/15/2029	17,000	17,017,530	0.1
Viking Cruises Ltd.	9.13%	07/15/2031	12,372	13,411,661	0.1
VOC Escrow Ltd.....	5.00%	02/15/2028	3,858	3,693,108	0.0
				<u>318,786,116</u>	<u>2.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	4,258	4,251,010	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	26,127	23,218,770	0.2
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	19,888	19,324,622	0.1
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	06/15/2032	20,332	20,355,013	0.1
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	03/01/2034	6,279	6,264,347	0.0
Caesars Entertainment, Inc.	6.50%	02/15/2032	9,962	10,037,928	0.1
Churchill Downs, Inc.	5.50%	04/01/2027	2,000	1,963,378	0.0
Cirsa Finance International SARL.....	6.50%	03/15/2029	EUR 13,923	15,234,042	0.1
Everi Holdings, Inc.	5.00%	07/15/2029	USD 3,865	3,831,113	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.....	3.63%	02/15/2032	17,183	14,679,102	0.1
Hilton Domestic Operating Co., Inc.....	5.38%	05/01/2025	3,320	3,316,817	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.....	5.75%	05/01/2028	5,733	5,718,691	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	5.00%	06/01/2029	32,204	29,850,510	0.2
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	5,705	5,605,288	0.0
KB Home	4.80%	11/15/2029	5,544	5,229,029	0.0
Light & Wonder International, Inc.....	7.00%	05/15/2028	7,525	7,565,634	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc.....	4.50%	06/15/2029	21,542	19,538,661	0.1
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	32,340	29,028,728	0.2
MGM Resorts International	4.75%	10/15/2028	21,622	20,292,177	0.1
Miller Homes Group Finco PLC	7.00%	05/15/2029	GBP 17,251	20,214,280	0.1
Miller Homes Group Finco PLC(b).....	9.15%	05/15/2028	EUR 10,088	10,848,403	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	04/01/2029	USD 14,461	\$ 13,587,657	0.1%
Standard Industries, Inc./NJ.	5.00%	02/15/2027	1,000	962,718	0.0
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/ Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp.	5.88%	05/15/2025	22,618	22,481,740	0.2
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.13%	08/01/2030	147	138,825	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	14,261	14,066,176	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	9,480	9,454,802	0.1
Travel & Leisure Co.	4.50%	12/01/2029	19,601	17,977,877	0.1
Travel & Leisure Co.	4.63%	03/01/2030	15,276	13,790,548	0.1
Travel & Leisure Co.	6.00%	04/01/2027	4,516	4,493,289	0.0
Travel & Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	29,164	29,463,721	0.2
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	18,930	18,484,540	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	19,690	18,589,601	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.13%	02/15/2031	4,769	4,923,870	0.0
				444,782,907	2.7
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	4.00%	10/15/2030	15,764	13,850,111	0.1
IRB Holding Corp.	7.00%	06/15/2025	10,678	10,688,856	0.1
Papa John's International, Inc.	3.88%	09/15/2029	5,437	4,818,540	0.0
				29,357,507	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Arko Corp.	5.13%	11/15/2029	18,547	16,074,627	0.1
Asbury Automotive Group, Inc.	4.63%	11/15/2029	16,480	15,019,563	0.1
Asbury Automotive Group, Inc.	5.00%	02/15/2032	7,383	6,569,808	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.75%	07/01/2036	15,369	15,136,550	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.88%	11/01/2035	1,039	1,039,122	0.0
Bath & Body Works, Inc.	6.95%	03/01/2033	13,864	13,498,619	0.1
Bath & Body Works, Inc.	7.60%	07/15/2037	4,421	4,311,720	0.0
Bath & Body Works, Inc.	9.38%	07/01/2025	1,656	1,731,020	0.0
BCPE Ulysses Intermediate, Inc.(a)	7.75%	04/01/2027	19,207	18,427,596	0.1
Beacon Roofing Supply, Inc.	6.50%	08/01/2030	4,271	4,294,995	0.0
Carvana Co.	5.50%	04/15/2027	2,126	1,666,899	0.0
Carvana Co.(a)	12.00%	12/01/2028	17,460	16,786,769	0.1
FirstCash, Inc.	4.63%	09/01/2028	1,000	925,359	0.0
FirstCash, Inc.	5.63%	01/01/2030	19,645	18,611,257	0.1
FirstCash, Inc.	6.88%	03/01/2032	7,399	7,331,932	0.1
Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd.	8.38%	01/15/2029	13,150	12,592,376	0.1
Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd.	8.75%	01/15/2032	11,880	11,297,006	0.1
Group 1 Automotive, Inc.	4.00%	08/15/2028	1,884	1,721,308	0.0
Kontoor Brands, Inc.	4.13%	11/15/2029	23,553	21,201,918	0.2
LCM Investments Holdings II LLC.	4.88%	05/01/2029	7,775	6,987,615	0.1
LCM Investments Holdings II LLC.	8.25%	08/01/2031	11,319	11,588,505	0.1
Levi Strauss & Co.	3.50%	03/01/2031	3,818	3,309,780	0.0
Michaels Cos., Inc. (The)	7.88%	05/01/2029	23,755	15,349,654	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	5.63%	05/01/2027	1,441	1,428,017	0.0
NMG Holding Co., Inc./Neiman Marcus Group LLC.	7.13%	04/01/2026	16,040	15,733,441	0.1
Nordstrom, Inc.	4.38%	04/01/2030	1,078	952,241	0.0
Nordstrom, Inc.	5.00%	01/15/2044	271	193,558	0.0
Penske Automotive Group, Inc.	3.75%	06/15/2029	151	133,629	0.0
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	12,016	11,254,741	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	7.75%	02/15/2029	40,041	39,560,223	0.3
Sonic Automotive, Inc.	4.63%	11/15/2029	10,543	9,316,844	0.1
Sonic Automotive, Inc.	4.88%	11/15/2031	12,399	10,658,414	0.1
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	23,041	22,671,344	0.2
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	17,003	16,324,234	0.1
Staples, Inc.	10.75%	04/15/2027	43,095	38,531,529	0.3
Under Armour, Inc.	3.25%	06/15/2026	1,122	1,057,789	0.0
White Cap Buyer LLC.	6.88%	10/15/2028	12,618	12,332,825	0.1
William Carter Co. (The)	5.63%	03/15/2027	130	127,988	0.0
				405,750,815	3.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC.	4.63%	08/01/2029	1,000	832,525	0.0
AdaptHealth LLC.	5.13%	03/01/2030	24,648	20,616,658	0.1
AdaptHealth LLC.	6.13%	08/01/2028	5,430	4,994,430	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	3.50%	03/15/2029	7,000	6,233,531	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	4.63%	01/15/2027	12,062	11,626,337	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	4.88%	02/15/2030	7,984	7,493,228	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	5.88%	02/15/2028	1,000	985,397	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	6.50%	02/15/2028	6,180	6,219,205	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	7.50%	03/15/2026	USD 5,667	\$ 5,762,858	0.0%
Amer Sports Co.	6.75%	02/16/2031	12,408	12,353,015	0.1
Bausch & Lomb Corp.	8.38%	10/01/2028	35,841	37,502,071	0.3
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027	15,514	8,808,717	0.1
Bausch Health Cos., Inc.	5.75%	08/15/2027	3,475	2,124,655	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.25%	02/15/2029	9,519	4,373,309	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	7.25%	05/30/2029	9,800	4,355,460	0.0
CAB SELAS	3.38%	02/01/2028	EUR 6,591	6,464,693	0.0
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	500	522,576	0.0
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	7.50%	05/15/2030	4,800	5,472,819	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	5.63%	03/15/2027	USD 7,408	6,776,470	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.00%	01/15/2029	7,082	6,099,651	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.13%	04/01/2030	17,452	10,706,867	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.88%	04/01/2028	736	471,383	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.88%	04/15/2029	33,534	21,575,494	0.2
DaVita, Inc.	3.75%	02/15/2031	1,160	951,654	0.0
DaVita, Inc.	4.63%	06/01/2030	43,866	38,578,702	0.3
Elanco Animal Health, Inc.	6.65%	08/28/2028	17,163	17,384,272	0.1
Embeckta Corp.	5.00%	02/15/2030	25,700	20,473,153	0.1
Fortrea Holdings, Inc.	7.50%	07/01/2030	8,594	8,788,499	0.1
Global Medical Response, Inc.	6.50%	10/01/2025	16,815	14,668,823	0.1
Grifols SA	3.88%	10/15/2028	EUR 23,072	21,200,081	0.2
Grifols SA	4.75%	10/15/2028	USD 13,449	11,144,389	0.1
Gruenthal GmbH	4.13%	05/15/2028	EUR 5,664	6,005,309	0.0
Iceland Bondco PLC(b)	9.40%	12/15/2027	6,822	7,434,196	0.1
IQVIA, Inc.	6.50%	05/15/2030	USD 9,184	9,316,021	0.1
Jazz Securities DAC	4.38%	01/15/2029	1,000	917,955	0.0
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	7.00%	12/31/2027	45,174	43,749,993	0.3
Lamb Weston Holdings, Inc.	4.13%	01/31/2030	3,000	2,714,013	0.0
Legacy LifePoint Health LLC	4.38%	02/15/2027	1,000	931,256	0.0
LifePoint Health, Inc.	5.38%	01/15/2029	3,000	2,390,496	0.0
Medline Borrower LP	3.88%	04/01/2029	25,280	22,661,153	0.2
Medline Borrower LP	5.25%	10/01/2029	40,404	37,362,241	0.3
ModivCare Escrow Issuer, Inc.	5.00%	10/01/2029	3,499	2,579,502	0.0
Neogen Food Safety Corp.	8.63%	07/20/2030	13,172	14,013,159	0.1
Newell Brands, Inc.	6.38%	09/15/2027	4,464	4,336,441	0.0
Newell Brands, Inc.	6.38%	04/01/2036	78	68,440	0.0
Newell Brands, Inc.	6.50%	04/01/2046	1,218	973,294	0.0
Newell Brands, Inc.	6.63%	09/15/2029	15,984	15,300,622	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	2.88%	04/30/2028	EUR 1,200	1,201,729	0.0
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	4.13%	04/30/2028	USD 10,341	9,453,889	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	5.13%	04/30/2031	34,341	29,397,664	0.2
Owens & Minor, Inc.	4.50%	03/31/2029	905	808,809	0.0
Performance Food Group, Inc.	4.25%	08/01/2029	147	133,461	0.0
Perrigo Finance Unlimited Co.	4.38%	03/15/2026	1,048	1,011,277	0.0
Perrigo Finance Unlimited Co.	4.65%	06/15/2030	1,561	1,401,756	0.0
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	26,783	25,575,280	0.2
Post Holdings, Inc.	6.25%	02/15/2032	2,747	2,760,777	0.0
Primo Water Holdings, Inc.	4.38%	04/30/2029	2,589	2,350,329	0.0
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc./ LifePoint Health, Inc.	9.75%	12/01/2026	47,895	47,924,521	0.3
Spectrum Brands, Inc.	3.88%	03/15/2031	14,195	13,483,403	0.1
Tenet Healthcare Corp.	4.25%	06/01/2029	1,109	1,019,564	0.0
Tenet Healthcare Corp.	4.63%	06/15/2028	142	134,837	0.0
Tenet Healthcare Corp.	6.13%	10/01/2028	3,049	3,013,865	0.0
Tenet Healthcare Corp.	6.13%	06/15/2030	11,559	11,456,993	0.1
Tenet Healthcare Corp.	6.25%	02/01/2027	5,000	4,987,582	0.0
Triton Water Holdings, Inc.	6.25%	04/01/2029	16,820	14,745,342	0.1
US Acute Care Solutions LLC	6.38%	03/01/2026	19,802	17,924,549	0.1
US Foods, Inc.	4.63%	06/01/2030	10,566	9,686,935	0.1
US Foods, Inc.	4.75%	02/15/2029	141	132,324	0.0
US Foods, Inc.	6.88%	09/15/2028	127	129,322	0.0
				<u>695,049,221</u>	<u>4.7</u>
ENERGIE					
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp.	5.38%	06/15/2029	130	123,720	0.0
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp.	5.75%	03/01/2027	130	127,169	0.0
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp.	5.75%	01/15/2028	160	156,839	0.0
Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026	9,146	8,977,789	0.1
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	13,168	13,287,827	0.1
Buckeye Partners LP	3.95%	12/01/2026	135	127,660	0.0
Buckeye Partners LP	4.13%	03/01/2025	1,065	1,047,036	0.0
Buckeye Partners LP	5.85%	11/15/2043	1,282	1,056,745	0.0
Callon Petroleum Co.	8.00%	08/01/2028	18,598	19,420,764	0.1

AB FCP I
Global High Yield Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	USD 11,351	\$ 11,424,118	0.1%
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	37,747	37,684,327	0.3
CITGO Petroleum Corp.	8.38%	01/15/2029	1,117	1,172,455	0.0
Civitas Resources, Inc.	5.00%	10/15/2026	2,989	2,901,728	0.0
Civitas Resources, Inc.	8.38%	07/01/2028	17,949	18,783,037	0.1
Civitas Resources, Inc.	8.63%	11/01/2030	7,426	7,952,580	0.1
Civitas Resources, Inc.	8.75%	07/01/2031	17,420	18,542,926	0.1
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	13,362	12,891,466	0.1
CNX Resources Corp.	7.25%	03/01/2032	8,400	8,376,720	0.1
CNX Resources Corp.	7.38%	01/15/2031	160	161,417	0.0
Comstock Resources, Inc.	5.88%	01/15/2030	3,578	3,128,684	0.0
Comstock Resources, Inc.	6.75%	03/01/2029	14,500	13,374,974	0.1
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC	5.50%	06/15/2031	24,829	23,142,811	0.2
Crescent Energy Finance LLC	7.25%	05/01/2026	12,658	12,611,863	0.1
Crescent Energy Finance LLC	9.25%	02/15/2028	8,423	8,818,482	0.1
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8.50%	05/01/2028	25,563	25,527,167	0.2
EQM Midstream Partners LP.	4.75%	01/15/2031	2,680	2,494,049	0.0
EQM Midstream Partners LP.	5.50%	07/15/2028	135	132,359	0.0
EQM Midstream Partners LP.	6.38%	04/01/2029	5,211	5,227,040	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.25%	05/15/2026	2,873	2,846,871	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	15,114	15,117,153	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	6,733	6,780,846	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	8,328	8,208,831	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	8,217	8,224,408	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	8.25%	01/15/2032	11,846	12,151,627	0.1
Gulfport Energy Corp.	8.00%	05/17/2026	11,796	12,006,597	0.1
Hess Midstream Operations LP.	5.63%	02/15/2026	10,815	10,684,538	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	4,810	4,682,849	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	8.38%	11/01/2033	20,299	21,802,716	0.2
Howard Midstream Energy Partners LLC	8.88%	07/15/2028	11,275	11,928,876	0.1
ITT Holdings LLC.	6.50%	08/01/2029	36,941	32,970,185	0.2
Kodiak Gas Services LLC	7.25%	02/15/2029	5,947	6,066,782	0.0
Moss Creek Resources Holdings, Inc.	7.50%	01/15/2026	44,211	44,003,597	0.3
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026	15,170	14,951,577	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.50%	01/15/2028	7,800	7,175,661	0.1
Nabors Industries, Inc.	7.38%	05/15/2027	20,649	20,567,575	0.1
New Fortress Energy, Inc.	6.50%	09/30/2026	30,764	29,655,544	0.2
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	22,545	22,431,036	0.2
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	8.13%	02/15/2029	20,447	20,645,380	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	8.38%	02/15/2032	20,447	20,779,540	0.1
NuStar Logistics LP.	5.63%	04/28/2027	130	128,478	0.0
NuStar Logistics LP.	5.75%	10/01/2025	130	129,138	0.0
NuStar Logistics LP.	6.00%	06/01/2026	130	128,807	0.0
NuStar Logistics LP.	6.38%	10/01/2030	5,271	5,288,166	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	6.00%	02/15/2028	1,500	1,460,279	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	7.88%	09/15/2030	695	710,199	0.0
Rockies Express Pipeline LLC	6.88%	04/15/2040	1,062	1,046,199	0.0
SM Energy Co.	6.63%	01/15/2027	2,000	1,992,408	0.0
SM Energy Co.	6.75%	09/15/2026	8,555	8,543,191	0.1
Southwestern Energy Co.	5.38%	02/01/2029	18,012	17,421,887	0.1
Southwestern Energy Co.	8.38%	09/15/2028	4,053	4,209,649	0.0
Summit Midstream Holdings LLC/ Summit Midstream Finance Corp.	9.00%	10/15/2026	19,957	19,837,363	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	4.50%	05/15/2029	144	133,017	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	4.50%	04/30/2030	130	118,493	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.88%	03/15/2028	26,261	25,983,033	0.2
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	7.00%	09/15/2028	127	130,023	0.0
Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp.	6.00%	12/31/2030	2,644	2,461,007	0.0
Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp.	6.00%	09/01/2031	1,151	1,058,736	0.0
Talos Production, Inc.	9.00%	02/01/2029	8,124	8,303,282	0.1
Talos Production, Inc.	9.38%	02/01/2031	9,683	9,994,849	0.1
Transocean Aquila Ltd.	8.00%	09/30/2028	18,419	18,760,405	0.1
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027	675	673,706	0.0
Transocean, Inc.	8.75%	02/15/2030	7,113	7,325,342	0.1
Venture Global Calcasieu Pass LLC	3.88%	08/15/2029	149	133,725	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC	3.88%	11/01/2033	3,818	3,203,530	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC	4.13%	08/15/2031	12,759	11,200,646	0.1
Venture Global Calcasieu Pass LLC	6.25%	01/15/2030	14,266	14,263,222	0.1
Venture Global LNG, Inc.	8.13%	06/01/2028	18,516	18,822,914	0.1
Venture Global LNG, Inc.	8.38%	06/01/2031	18,493	18,707,839	0.1
Venture Global LNG, Inc.	9.50%	02/01/2029	11,025	11,756,018	0.1
Venture Global LNG, Inc.	9.88%	02/01/2032	17,490	18,411,580	0.1
				824,693,072	5.8

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
SONSTIGE INDUSTRIERWERTE					
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	4.00%	01/15/2028	USD 652	\$ 608,211	0.0%
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	EUR 350	364,597	0.0
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2031	19,101	18,775,109	0.1
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028	USD 36,163	36,031,066	0.3
Fluor Corp.	4.25%	09/15/2028	60	56,631	0.0
Ritchie Bros Holdings, Inc.	6.75%	03/15/2028	8,396	8,592,259	0.1
Ritchie Bros Holdings, Inc.	7.75%	03/15/2031	7,766	8,159,538	0.1
				<u>72,587,411</u>	<u>0.6</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The)	4.13%	08/01/2029	3,000	2,720,578	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ...	6.00%	06/01/2029	13,593	11,259,478	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ...	6.63%	07/15/2026	5,739	5,721,155	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ...	9.75%	07/15/2027	20,978	20,901,622	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.63%	06/01/2028	15,913	14,118,710	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.88%	06/01/2028	GBP 8,760	9,701,717	0.1
ANGI Group LLC	3.88%	08/15/2028	USD 16,913	14,540,043	0.1
APX Group, Inc.	5.75%	07/15/2029	20,401	19,388,499	0.1
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	21,510	21,546,230	0.2
Aramark Services, Inc.	5.00%	02/01/2028	3,507	3,364,749	0.0
Arena Luxembourg Finance SARL	1.88%	02/01/2028	EUR 700	679,822	0.0
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	USD 16,622	16,092,991	0.1
Engineering - Ingegneria Informatica - SpA	11.13%	05/15/2028	EUR 10,960	12,751,583	0.1
Garda World Security Corp.	4.63%	02/15/2027	USD 6,884	6,579,325	0.1
Garda World Security Corp.	7.75%	02/15/2028	2,598	2,644,258	0.0
Korn Ferry	4.63%	12/15/2027	17,280	16,330,167	0.1
Millennium Escrow Corp.	6.63%	08/01/2026	24,792	14,792,579	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.50%	09/01/2028	25,663	22,392,149	0.2
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	43,036	34,319,718	0.2
Neptune Bidco US, Inc.	9.29%	04/15/2029	51,848	48,780,680	0.3
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	3.38%	08/31/2027	11,077	10,147,488	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	3,000	2,977,915	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	53,758	53,037,730	0.4
Q-Park Holding I BV	2.00%	03/01/2027	EUR 500	504,564	0.0
Verscend Escrow Corp.	9.75%	08/15/2026	USD 56,709	56,830,141	0.4
Wand NewCo 3, Inc.	7.63%	01/30/2032	11,656	11,990,051	0.1
ZipRecruiter, Inc.	5.00%	01/15/2030	38,627	34,024,576	0.2
				<u>468,138,518</u>	<u>3.2</u>
TECHNOLOGIE					
Ahead DB Holdings LLC	6.63%	05/01/2028	21,260	18,935,183	0.1
AthenaHealth Group, Inc.	6.50%	02/15/2030	26,894	24,101,146	0.2
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	18,204	18,221,857	0.1
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	19,378	17,440,200	0.1
Entegris, Inc.	5.95%	06/15/2030	15,018	14,727,093	0.1
Gen Digital, Inc.	6.75%	09/30/2027	21,915	22,047,481	0.2
Gen Digital, Inc.	7.13%	09/30/2030	11,132	11,371,849	0.1
GoTo Group, Inc.	5.50%	05/01/2028	24,568	17,376,249	0.2
NCR Voyix Corp.	5.00%	10/01/2028	3,000	2,784,165	0.0
Playtika Holding Corp.	4.25%	03/15/2029	17,383	14,840,490	0.1
Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027	15,864	15,240,807	0.1
Presidio Holdings, Inc.	8.25%	02/01/2028	37,003	36,472,565	0.3
Rackspace Technology Global, Inc.	3.50%	02/15/2028	30,657	12,347,219	0.1
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	2,038	1,939,930	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	25,862	23,605,132	0.2
Seagate HDD Cayman	4.88%	06/01/2027	11,014	10,677,324	0.1
Seagate HDD Cayman	8.25%	12/15/2029	4,834	5,171,301	0.0
Seagate HDD Cayman	8.50%	07/15/2031	5,274	5,695,212	0.0
Seagate HDD Cayman	9.63%	12/01/2032	894	1,010,688	0.0
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	53,806	49,345,662	0.3
Virtusa Corp.	7.13%	12/15/2028	17,654	15,664,232	0.1
Western Digital Corp.	4.75%	02/15/2026	14,808	14,484,940	0.1
				<u>353,500,725</u>	<u>2.5</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Air Canada	3.88%	08/15/2026	6,507	6,160,911	0.0
Allegiant Travel Co.	7.25%	08/15/2027	9,863	9,622,284	0.1
American Airlines, Inc.	7.25%	02/15/2028	1,063	1,071,935	0.0
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	28,265	28,010,203	0.2
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	20,390	19,939,757	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	24,712	23,271,290	0.2
United Airlines, Inc.	4.38%	04/15/2026	165	158,859	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
United Airlines, Inc.	4.63%	04/15/2029	USD 5,072	\$ 4,677,668	0.0%
				<u>92,912,907</u>	<u>0.6</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	5.25%	10/15/2026	EUR 19,265	20,729,950	0.1
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	6.13%	10/15/2026	USD 16,653	16,395,147	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	11,079	10,087,733	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	32,463	30,926,531	0.2
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	8.00%	02/15/2031	2,725	2,632,742	0.0
BCP V Modular Services Finance II PLC	4.75%	11/30/2028	EUR 3,816	3,900,732	0.0
BCP V Modular Services Finance PLC	6.75%	11/30/2029	31,430	30,456,846	0.2
Hertz Corp. (The)	4.63%	12/01/2026	USD 28,968	25,652,568	0.2
Hertz Corp. (The)	5.00%	12/01/2029	23,687	18,163,036	0.1
Loxam SAS	2.88%	04/15/2026	EUR 8,700	9,124,278	0.1
Loxam SAS	3.75%	07/15/2026	2,400	2,559,215	0.0
Loxam SAS	6.38%	05/31/2029	1,570	1,756,151	0.0
Mundys SpA.	1.88%	02/12/2028	1,046	1,031,812	0.0
Mundys SpA, Series E.	1.88%	07/13/2027	1,010	1,015,198	0.0
PROG Holdings, Inc.	6.00%	11/15/2029	USD 13,911	12,791,062	0.1
				<u>187,223,001</u>	<u>1.2</u>
				<u>6,200,080,703</u>	<u>42.3</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Ally Financial, Inc., Series C(c).	4.70%	05/15/2028	16,427	12,939,547	0.1
Banco de Sabadell SA(c)	5.00%	05/19/2027	EUR 200	189,193	0.0
Bread Financial Holdings, Inc.	7.00%	01/15/2026	USD 1,774	1,783,287	0.0
Bread Financial Holdings, Inc.	9.75%	03/15/2029	18,856	19,292,851	0.1
UniCredit SpA	5.46%	06/30/2035	2,874	2,655,467	0.0
UniCredit SpA, Series E(c)	3.88%	06/03/2027	EUR 732	690,106	0.0
				<u>37,550,451</u>	<u>0.2</u>
MAKLER					
AG Issuer LLC.	6.25%	03/01/2028	USD 10,073	9,769,433	0.1
AG TTMT Escrow Issuer LLC	8.63%	09/30/2027	13,955	14,368,922	0.1
Aretec Group, Inc.	10.00%	08/15/2030	19,872	21,641,093	0.2
Hightower Holding LLC	6.75%	04/15/2029	27,389	25,733,214	0.2
NFP Corp.	6.88%	08/15/2028	8,827	8,982,146	0.1
NFP Corp.	7.50%	10/01/2030	17,638	18,561,424	0.1
Osaic Holdings, Inc.	10.75%	08/01/2027	27,269	28,291,056	0.2
				<u>127,347,288</u>	<u>1.0</u>
FINANZEN					
Castlelake Aviation Finance DAC	5.00%	04/15/2027	10,157	9,650,129	0.1
CNG Holdings, Inc.	14.50%	06/30/2026	15,722	13,049,260	0.1
Compass Group Diversified Holdings LLC.	5.25%	04/15/2029	23,935	22,498,822	0.2
Curo Group Holdings Corp.	7.50%	08/01/2028	30,374	8,392,646	0.1
Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025	32,666	32,538,813	0.2
Enova International, Inc.	11.25%	12/15/2028	14,408	15,162,858	0.1
GGAM Finance Ltd.	7.75%	05/15/2026	13,445	13,682,976	0.1
GGAM Finance Ltd.	8.00%	02/15/2027	9,326	9,588,892	0.1
GGAM Finance Ltd.	8.00%	06/15/2028	20,290	21,003,995	0.1
goeasy Ltd.	7.63%	07/01/2029	8,428	8,424,096	0.1
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	5.00%	08/15/2028	31,717	28,553,938	0.2
Navient Corp.	4.88%	03/15/2028	11,987	10,943,373	0.1
Navient Corp.	5.00%	03/15/2027	9,095	8,632,267	0.1
Navient Corp.	5.63%	08/01/2033	265	216,064	0.0
Navient Corp.	5.88%	10/25/2024	1,000	997,889	0.0
Navient Corp.	6.75%	06/25/2025	9,594	9,664,228	0.1
Navient Corp.	6.75%	06/15/2026	8,393	8,429,173	0.1
Navient Corp.	9.38%	07/25/2030	1,005	1,050,475	0.0
Navient Corp.	11.50%	03/15/2031	17	18,598	0.0
SLM Corp.	3.13%	11/02/2026	4,727	4,354,815	0.0
Synchrony Financial	7.25%	02/02/2033	17,336	16,899,841	0.1
				<u>243,753,148</u>	<u>1.9</u>
VERSICHERUNGEN					
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	4.25%	02/15/2029	150	133,059	0.0
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	6.00%	08/01/2029	2,239	2,016,912	0.0
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	8.25%	02/01/2029	15,922	15,733,904	0.1
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	10.13%	08/01/2026	19,929	20,730,741	0.1
AmWINS Group, Inc.	6.38%	02/15/2029	5,893	5,895,688	0.0
Ardonagh Finco Ltd.	6.88%	02/15/2031	EUR 6,216	6,655,564	0.1
Ardonagh Finco Ltd.	7.75%	02/15/2031	USD 4,417	4,399,432	0.0
Ardonagh Group Finance Ltd.	8.88%	02/15/2032	6,943	6,823,646	0.1
Ardonagh Midco 2 PLC(a)	11.50%	01/15/2027	37,930	39,020,087	0.3
AssuredPartners, Inc.	5.63%	01/15/2029	17,645	16,245,833	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Howden UK Refinance PLC/Howden UK Refinance 2 PLC/ Howden US Refinance LLC	7.25%	02/15/2031	USD 7,937	\$ 7,954,408	0.1%
Howden UK Refinance PLC/Howden UK Refinance 2 PLC/ Howden US Refinance LLC	8.13%	02/15/2032	2,756	2,786,978	0.0
HUB International Ltd.	7.25%	06/15/2030	23,088	23,577,126	0.2
HUB International Ltd.	7.38%	01/31/2032	8,599	8,634,654	0.1
Intesa Sanpaolo Vita SpA.	2.38%	12/22/2030	EUR 913	819,683	0.0
				<u>161,427,715</u>	<u>1.2</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
Armor Holdco, Inc.	8.50%	11/15/2029	USD 31,547	29,651,446	0.2
Coinbase Global, Inc.	3.63%	10/01/2031	22,357	17,482,681	0.1
				<u>47,134,127</u>	<u>0.3</u>
REITs					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	4.50%	04/01/2027	26,418	23,263,318	0.2
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	8,837	8,526,772	0.1
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	10.50%	01/15/2028	20,733	21,196,326	0.2
Heimstaden Bostad AB, Series E(c)	3.63%	10/13/2026	EUR 355	228,407	0.0
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2027	USD 1,293	1,240,311	0.0
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029	23,788	22,123,911	0.2
Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	10,641	10,064,420	0.1
Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	2,653	2,555,606	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.25%	07/15/2030	130	121,666	0.0
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd., Series E	3.25%	11/12/2025	EUR 1,100	1,110,259	0.0
Service Properties Trust	3.95%	01/15/2028	USD 613	517,932	0.0
Service Properties Trust	4.38%	02/15/2030	75	57,373	0.0
Service Properties Trust	4.75%	10/01/2026	548	506,887	0.0
Service Properties Trust	4.95%	02/15/2027	1,130	1,038,043	0.0
Service Properties Trust	8.63%	11/15/2031	16,418	17,363,234	0.1
Vivion Investments SARL, Series E(a)	7.90%	08/31/2028	EUR 11,440	10,212,911	0.1
Vivion Investments SARL, Series E(a)	7.90%	02/28/2029	270	234,339	0.0
				<u>120,361,715</u>	<u>1.0</u>
				<u>737,574,444</u>	<u>5.6</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Calpine Corp.	4.50%	02/15/2028	USD 4,853	4,579,004	0.0
Calpine Corp.	4.63%	02/01/2029	1,000	919,770	0.0
Calpine Corp.	5.00%	02/01/2031	2,000	1,793,488	0.0
Calpine Corp.	5.13%	03/15/2028	17,753	16,843,216	0.1
Calpine Corp.	5.25%	06/01/2026	661	652,336	0.0
NRG Energy, Inc.	3.38%	02/15/2029	153	133,693	0.0
NRG Energy, Inc.	3.63%	02/15/2031	150	126,175	0.0
NRG Energy, Inc.	3.88%	02/15/2032	2,548	2,139,571	0.0
NRG Energy, Inc.	6.63%	01/15/2027	334	333,754	0.0
Vistra Corp.(c)	7.00%	12/15/2026	14,856	14,369,087	0.1
Vistra Corp.(c)	8.00%	10/15/2026	17,732	17,732,862	0.1
Vistra Operations Co. LLC	4.38%	05/01/2029	1,771	1,617,531	0.0
Vistra Operations Co. LLC	5.00%	07/31/2027	130	124,665	0.0
Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	130	126,794	0.0
				<u>61,491,946</u>	<u>0.3</u>
ERDGAS					
AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finance Corp.	5.75%	05/20/2027	3,071	2,903,454	0.0
AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finance Corp.	5.88%	08/20/2026	2,288	2,217,586	0.0
				<u>5,121,040</u>	<u>0.0</u>
				<u>66,612,986</u>	<u>0.3</u>
				<u>7,004,268,133</u>	<u>48.2</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
AngloGold Ashanti Holdings PLC	3.38%	11/01/2028	7,504	6,719,832	0.0
ArcelorMittal SA	6.75%	03/01/2041	14,025	14,438,514	0.1
Celanese US Holdings LLC	6.05%	03/15/2025	1,901	1,905,404	0.0
Celanese US Holdings LLC	6.35%	11/15/2028	6,222	6,404,570	0.0
Celanese US Holdings LLC	6.55%	11/15/2030	15,079	15,648,094	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	8,883	7,858,162	0.1
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034	11,669	11,306,409	0.1
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,106	13,135,533	0.1
Glencore Funding LLC	5.70%	05/08/2033	13,626	13,755,656	0.1
Glencore Funding LLC	6.50%	10/06/2033	18,924	20,189,176	0.1
Olin Corp.	5.00%	02/01/2030	2,728	2,558,861	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	USD 19,555	\$ 19,157,476	0.1%
Sealed Air Corp.	1.57%	10/15/2026	1,070	962,860	0.0
				<u>134,040,547</u>	<u>0.8</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Wabtec Transportation Netherlands BV.	1.25%	12/03/2027	EUR 100	98,244	0.0
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
DIRECTV Financing LLC.	8.88%	02/01/2030	USD 7,239	7,289,852	0.1
DIRECTV Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor, Inc.	5.88%	08/15/2027	38,431	36,299,918	0.3
Time Warner Cable LLC	6.55%	05/01/2037	720	675,914	0.0
Time Warner Cable LLC	6.75%	06/15/2039	30	28,258	0.0
Time Warner Cable LLC	7.30%	07/01/2038	65	64,766	0.0
				<u>44,358,708</u>	<u>0.4</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Sprint Capital Corp.	8.75%	03/15/2032	455	549,828	0.0
Sprint LLC	7.13%	06/15/2024	1,000	1,003,011	0.0
Sprint LLC	7.63%	02/15/2025	3,000	3,038,080	0.0
Sprint LLC	7.63%	03/01/2026	8,328	8,606,101	0.1
Vodafone Group PLC.	5.13%	06/19/2059	150	132,275	0.0
				<u>13,329,295</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Ford Motor Co.	3.25%	02/12/2032	48,548	39,852,605	0.3
Ford Motor Co.	6.10%	08/19/2032	20,530	20,473,520	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC.	7.35%	03/06/2030	258	273,193	0.0
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	2,398	2,406,781	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.65%	01/17/2029	11,876	11,967,919	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	5.75%	02/08/2031	11,638	11,604,569	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	6.40%	01/09/2033	39,978	41,515,387	0.3
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.05%	02/14/2027	7,763	7,273,638	0.1
Hyundai Capital America.	2.00%	06/15/2028	8,597	7,527,849	0.1
Hyundai Capital America.	5.30%	01/08/2029	7,329	7,314,067	0.1
Hyundai Capital America.	6.20%	09/21/2030	7,751	8,096,773	0.1
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	12,304	10,995,364	0.1
Nissan Motor Acceptance Co. LLC.	1.85%	09/16/2026	1,433	1,290,282	0.0
Nissan Motor Acceptance Co. LLC.	2.45%	09/15/2028	12,440	10,625,426	0.1
Nissan Motor Acceptance Co. LLC.	2.75%	03/09/2028	18,160	15,975,308	0.1
Nissan Motor Co., Ltd.	4.81%	09/17/2030	1,105	1,017,678	0.0
RCI Banque SA, Series E	1.13%	01/15/2027	EUR 1,006	1,009,227	0.0
RCI Banque SA, Series E	1.63%	05/26/2026	37	38,040	0.0
RCI Banque SA, Series E	4.50%	04/06/2027	903	988,713	0.0
RCI Banque SA, Series E	4.88%	09/21/2028	53	59,339	0.0
RCI Banque SA, Series E	4.88%	10/02/2029	17	19,044	0.0
Schaeffler AG, Series E	2.75%	10/12/2025	400	422,974	0.0
Schaeffler AG, Series E	3.38%	10/12/2028	1,000	1,038,361	0.0
Schaeffler AG, Series E	4.75%	08/14/2029	100	109,515	0.0
Valeo SE, Series E	1.00%	08/03/2028	800	746,737	0.0
Valeo SE, Series E	5.38%	05/28/2027	900	1,003,693	0.0
				<u>203,646,002</u>	<u>1.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Mattel, Inc.	5.88%	12/15/2027	USD 3,598	3,592,764	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	8.25%	01/15/2029	939	995,340	0.0
				<u>4,588,104</u>	<u>0.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
International Game Technology PLC	5.25%	01/15/2029	512	495,214	0.0
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	9,125	9,139,415	0.1
International Game Technology PLC	6.50%	02/15/2025	5,260	5,276,109	0.0
Las Vegas Sands Corp.	3.50%	08/18/2026	1,600	1,504,352	0.0
Las Vegas Sands Corp.	3.90%	08/08/2029	1,129	1,021,662	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	31,490	31,380,113	0.2
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	2,898	3,218,954	0.0
PulteGroup, Inc.	6.00%	02/15/2035	615	631,555	0.0
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	24,025	25,402,816	0.2
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	16,167	18,698,211	0.1
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/16/2029	3,000	2,707,021	0.0
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	8.45%	07/27/2030	14,800	15,765,053	0.1
Sands China Ltd.	3.25%	08/08/2031	1,319	1,092,989	0.0
Sands China Ltd.	4.63%	06/18/2030	4,444	4,042,313	0.0
Sands China Ltd.	5.40%	08/08/2028	2,596	2,523,312	0.0
				<u>122,899,089</u>	<u>0.7</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Kohl's Corp.	4.63%	05/01/2031	1,350	1,067,583	0.0
Macy's Retail Holdings LLC.	5.88%	04/01/2029	5,457	5,257,207	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	03/15/2030	USD 9,399	\$ 8,811,609	0.1%
Macy's Retail Holdings LLC	6.13%	03/15/2032	4,378	4,074,344	0.0
PVH Corp.	3.13%	12/15/2027	EUR 665	699,942	0.0
Tapestry, Inc.	7.70%	11/27/2030	USD 18,999	20,183,167	0.1
Tapestry, Inc.	7.85%	11/27/2033	5,571	6,027,589	0.0
Walgreens Boots Alliance, Inc.	2.13%	11/20/2026	EUR 942	956,995	0.0
				<u>47,078,436</u>	<u>0.2</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Altria Group, Inc.	6.88%	11/01/2033	USD 16,428	17,691,594	0.1
BAT Capital Corp.	6.00%	02/20/2034	8,983	8,895,724	0.1
BAT Capital Corp.	6.42%	08/02/2033	24,845	25,500,596	0.2
Bayer AG	1.13%	01/06/2030	EUR 1,100	988,970	0.0
Bayer AG	7.00%	09/25/2083	500	543,102	0.0
Bayer AG, Series E	4.63%	05/26/2033	204	221,901	0.0
Bayer Capital Corp. BV	2.13%	12/15/2029	200	191,618	0.0
Bayer US Finance LLC	6.38%	11/21/2030	USD 25,324	25,570,595	0.2
Charles River Laboratories International, Inc.	3.75%	03/15/2029	1,000	905,284	0.0
Charles River Laboratories International, Inc.	4.25%	05/01/2028	373	349,909	0.0
HCA, Inc.	5.45%	04/01/2031	9,307	9,263,525	0.1
IQVIA, Inc.	6.25%	02/01/2029	14,765	15,190,815	0.1
JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co./JBS Luxembourg SARL	6.75%	03/15/2034	21,494	22,067,019	0.2
Pilgrim's Pride Corp.	6.88%	05/15/2034	25,575	26,927,523	0.2
				<u>154,308,175</u>	<u>1.2</u>
ENERGIE					
Antero Resources Corp.	7.63%	02/01/2029	1,453	1,496,952	0.0
Apache Corp.	4.25%	01/15/2030	10,000	9,188,549	0.1
Canadian Natural Resources Ltd.	6.50%	02/15/2037	743	773,692	0.0
Columbia Pipelines Operating Co. LLC	5.93%	08/15/2030	3,657	3,724,823	0.0
Columbia Pipelines Operating Co. LLC	6.04%	11/15/2033	5,169	5,309,426	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	13,759	13,489,373	0.1
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	8,521	9,641,816	0.1
EnLink Midstream LLC	5.63%	01/15/2028	14,782	14,559,097	0.1
EnLink Midstream Partners LP	4.15%	06/01/2025	663	650,096	0.0
EnLink Midstream Partners LP	4.85%	07/15/2026	219	214,021	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.05%	04/01/2045	13,062	11,082,313	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.45%	06/01/2047	9,385	8,256,054	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.60%	04/01/2044	10,151	9,192,413	0.1
Enterprise Products Operating LLC	5.38%	02/15/2078	277	256,309	0.0
EQT Corp.	3.90%	10/01/2027	10,000	9,473,016	0.1
EQT Corp.	5.75%	02/01/2034	8,229	8,094,066	0.1
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	2,953	3,317,430	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G	7.75%	01/15/2032	4,518	5,087,867	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G	7.80%	08/01/2031	18,933	21,173,554	0.1
Northern Natural Gas Co.	4.30%	01/15/2049	88	71,820	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.50%	12/01/2025	5,236	5,229,111	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.88%	09/01/2025	4,883	4,897,651	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.88%	07/15/2030	8,851	10,231,407	0.1
ONEOK, Inc.	6.05%	09/01/2033	11,276	11,618,598	0.1
Var Energi ASA	5.00%	05/18/2027	4,700	4,587,065	0.0
Var Energi ASA	7.50%	01/15/2028	5,574	5,885,629	0.0
Western Midstream Operating LP	3.10%	02/01/2025	12,908	12,576,159	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	3,698	3,613,694	0.0
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	5,469	4,912,850	0.0
				<u>198,604,851</u>	<u>1.3</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
LKQ Corp.	5.75%	06/15/2028	17,210	17,383,482	0.1
LKQ Corp.	6.25%	06/15/2033	15,258	15,683,880	0.1
				<u>33,067,362</u>	<u>0.2</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
GTCR W-2 Merger Sub LLC	7.50%	01/15/2031	18,164	18,942,182	0.1
GTCR W-2 Merger Sub LLC/GTCR W Dutch Finance Sub BV	8.50%	01/15/2031	GBP 5,026	6,841,384	0.1
				<u>25,783,566</u>	<u>0.2</u>
TECHNOLOGIE					
Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025	USD 9,315	9,356,011	0.1
Western Digital Corp.	2.85%	02/01/2029	1,961	1,652,502	0.0
Western Digital Corp.	3.10%	02/01/2032	2,432	1,895,899	0.0
				<u>12,904,412</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	17,879	17,467,769	0.1
International Consolidated Airlines Group SA	2.75%	03/25/2025	EUR 500	532,303	0.0
International Consolidated Airlines Group SA	3.75%	03/25/2029	200	210,230	0.0
Mileage Plus Holdings LLC/ Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	USD 35,205	35,272,879	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Wizz Air Finance Co. BV, Series E	1.00%	01/19/2026	EUR 1,130	\$ 1,143,480	0.0%
				54,626,661	0.3
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045	USD 14,021	13,924,668	0.1
				1,063,258,120	7.2
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Abanca Corp. Bancaria SA, Series E	5.25%	09/14/2028	EUR 300	336,162	0.0
AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025	USD 27,342	27,275,722	0.2
AIB Group PLC	6.61%	09/13/2029	4,716	4,892,837	0.0
Ally Financial, Inc.	6.85%	01/03/2030	9,815	10,031,281	0.1
Ally Financial, Inc.	6.99%	06/13/2029	701	720,074	0.0
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	41,851	45,780,588	0.4
Banco BPM SpA, Series E	4.88%	01/18/2027	EUR 570	630,645	0.0
Banco BPM SpA, Series E	6.00%	01/21/2028	842	951,373	0.0
Banco de Sabadell SA, Series E	5.13%	11/10/2028	900	1,015,146	0.0
Banco Santander SA	6.92%	08/08/2033	USD 29,000	30,154,163	0.2
Banco Santander SA(c)	9.63%	05/21/2033	21,600	23,113,173	0.2
Bank of America Corp., Series B	8.05%	06/15/2027	32,004	33,986,522	0.2
Bank of America Corp., Series X(c)	6.25%	09/05/2024	4,224	4,216,080	0.0
Bank of Ireland Group PLC, Series E	0.38%	05/10/2027	EUR 778	779,257	0.0
Barclays PLC(c)	6.13%	12/15/2025	USD 35,377	33,688,346	0.2
Barclays PLC	7.12%	06/27/2034	13,464	14,026,377	0.1
Barclays PLC(c)	7.13%	06/15/2025	GBP 6,422	7,935,067	0.1
Barclays PLC(c)	8.88%	09/15/2027	7,438	9,377,251	0.1
BNP Paribas SA(c)	4.63%	02/25/2031	USD 2,507	2,004,586	0.0
BNP Paribas SA(c)	8.50%	08/14/2028	8,064	8,323,691	0.1
BPCE SA	6.51%	01/18/2035	20,045	19,896,828	0.1
CaixaBank SA(c)	5.88%	10/09/2027	EUR 200	210,471	0.0
CaixaBank SA	6.84%	09/13/2034	USD 19,641	20,633,150	0.1
Capital One Financial Corp.	2.36%	07/29/2032	754	568,160	0.0
Capital One Financial Corp.	5.82%	02/01/2034	17,444	17,238,942	0.1
Capital One Financial Corp.	6.05%	02/01/2035	7,098	7,161,311	0.1
Capital One Financial Corp.	6.38%	06/08/2034	20,449	21,063,454	0.1
Capital One Financial Corp.	7.62%	10/30/2031	11,007	12,045,883	0.1
Citigroup, Inc.	5.83%	02/13/2035	22,259	21,773,449	0.2
Citigroup, Inc., Series AA(c)	7.63%	11/15/2028	9,392	9,675,521	0.1
Citigroup, Inc., Series V(c)	4.70%	01/30/2025	8,408	8,075,433	0.1
Citigroup, Inc., Series W(c)	4.00%	12/10/2025	7,221	6,829,211	0.1
Citigroup, Inc., Series X(c)	3.88%	02/18/2026	8,826	8,296,312	0.1
Citigroup, Inc., Series Y(c)	4.15%	11/15/2026	14,900	13,578,884	0.1
Citizens Financial Group, Inc., Series B(c) (d)	8.59%	04/06/2024	8,895	8,427,071	0.1
Commerzbank AG	3.00%	09/14/2027	EUR 1,100	1,151,559	0.0
Commerzbank AG, Series E	5.13%	01/18/2030	1,000	1,116,508	0.0
Cooperatieve Rabobank UA(c)	3.25%	12/29/2026	23,200	22,553,521	0.2
Cooperatieve Rabobank UA(c)	4.38%	06/29/2027	18,800	18,985,467	0.1
Credit Agricole SA(c)	8.13%	12/23/2025	USD 21,758	22,178,582	0.2
Credit Agricole SA, Series E(c)	7.25%	09/23/2028	EUR 6,000	6,760,404	0.0
Deutsche Bank AG	1.38%	02/17/2032	100	88,608	0.0
Deutsche Bank AG/New York NY	3.73%	01/14/2032	USD 204	167,566	0.0
Deutsche Bank AG/New York NY	6.82%	11/20/2029	9,155	9,468,221	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	7.15%	07/13/2027	22,622	23,237,896	0.2
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	5,173	5,689,277	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.62%	04/22/2032	2,913	2,421,138	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.65%	10/21/2032	2,457	2,026,241	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(b) (c)	8.44%	04/01/2024	14,626	14,613,509	0.1
HSBC Holdings PLC	4.76%	03/29/2033	15,807	14,501,813	0.1
HSBC Holdings PLC	5.55%	03/04/2030	12,570	12,566,742	0.1
HSBC Holdings PLC(c)	6.38%	03/30/2025	4,594	4,536,575	0.0
HSBC Holdings PLC	6.55%	06/20/2034	26,895	27,327,022	0.2
HSBC Holdings PLC, Series E(c)	4.75%	07/04/2029	EUR 9,250	9,209,349	0.1
ING Groep NV(c)	6.50%	04/16/2025	USD 13,851	13,594,822	0.1
ING Groep NV(c)	6.75%	04/16/2024	5,795	5,797,887	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	10,608	10,549,516	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	11,463	11,364,080	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	6.63%	06/20/2033	16,743	16,926,118	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	7.20%	11/28/2033	13,934	14,631,009	0.1
Intesa Sanpaolo SpA, Series E	8.51%	09/20/2032	GBP 591	806,012	0.0
JPMorgan Chase & Co.	2.96%	01/25/2033	USD 5,274	4,453,196	0.0
Lloyds Banking Group PLC(c)	7.50%	06/27/2024	2,514	2,506,609	0.0
Lloyds Banking Group PLC(c)	7.50%	09/27/2025	2,104	2,071,414	0.0
Morgan Stanley	5.42%	07/21/2034	4,475	4,453,232	0.0
NatWest Group PLC(c)	5.13%	05/12/2027	GBP 23,619	26,795,569	0.2
NatWest Group PLC	6.48%	06/01/2034	USD 5,475	5,476,205	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Nordea Bank Abp(c)	3.75%	03/01/2029	USD 33,653	\$ 27,092,201	0.2%
Regions Bank/Birmingham AL	6.45%	06/26/2037	28,048	28,515,221	0.2
Santander Holdings USA, Inc.	2.49%	01/06/2028	3,443	3,113,750	0.0
Santander Holdings USA, Inc.	6.17%	01/09/2030	13,008	12,965,324	0.1
Santander Holdings USA, Inc.	6.57%	06/12/2029	10,792	10,991,445	0.1
Santander Holdings USA, Inc.	7.66%	11/09/2031	2,631	2,810,477	0.0
Skandinaviska Enskilda Banken AB(c)	6.88%	06/30/2027	600	588,860	0.0
Societe Generale SA	5.52%	01/19/2028	53,898	53,333,623	0.4
Societe Generale SA	7.37%	01/10/2053	714	727,595	0.0
Standard Chartered PLC(b) (c)	7.09%	01/30/2027	16,000	15,368,503	0.1
Svenska Handelsbanken AB(c)	4.75%	03/01/2031	17,600	14,749,548	0.1
Swedbank AB(c)	4.00%	03/17/2029	5,000	3,984,054	0.0
Swedbank AB(c)	7.63%	03/17/2028	20,600	20,248,115	0.1
UBS Group AG	3.75%	03/26/2025	5,084	4,984,135	0.0
UBS Group AG(c)	7.00%	02/19/2025	32,133	32,153,062	0.2
UBS Group AG(c)	9.25%	11/13/2028	3,797	4,057,781	0.0
UBS Group AG(c)	9.25%	11/13/2033	3,616	3,991,490	0.0
UniCredit SpA, Series E	2.20%	07/22/2027	EUR 511	530,255	0.0
UniCredit SpA, Series E	4.30%	01/23/2031	200	215,348	0.0
Wells Fargo & Co.(c)	7.63%	09/15/2028	USD 2,008	2,119,259	0.0
Western Alliance Bancorp	3.00%	06/15/2031	1,219	1,067,704	0.0
				<u>996,345,838</u>	<u>6.9</u>
FINANZEN					
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	19,115	16,999,666	0.1
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	30,442	30,088,640	0.2
Aircastle Ltd.(c)	5.25%	06/15/2026	24,017	22,360,297	0.2
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	1,558	1,448,237	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	09/20/2026	9,554	8,693,362	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	5,788	5,341,379	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	7,715	7,497,274	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	5,387	5,277,715	0.0
Aviation Capital Group LLC	6.38%	07/15/2030	17,370	17,725,457	0.1
Aviation Capital Group LLC	6.75%	10/25/2028	18,859	19,546,545	0.1
ILFC E-Capital Trust I(d)	7.19%	12/21/2065	9,500	7,357,141	0.1
				<u>142,335,713</u>	<u>1.0</u>
VERSICHERUNGEN					
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	38,218	38,474,564	0.3
Aon Corp.	8.21%	01/01/2027	13,915	14,974,064	0.1
BNP Paribas Cardif SA(c)	4.03%	11/25/2025	EUR 700	748,769	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(b)	7.69%	02/12/2047	USD 10,000	8,637,589	0.1
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	EUR 1,111	1,195,382	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	4.13%	12/15/2051	USD 228	199,994	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	4.63%	12/02/2030	EUR 1,017	1,123,209	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	USD 33,248	34,127,059	0.2
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	7,000	7,504,127	0.1
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	16,185	22,030,276	0.2
Nationwide Financial Services, Inc.	6.75%	05/15/2037	3,000	2,983,855	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.(b)	7.94%	12/15/2024	5,000	5,016,525	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.	9.38%	08/15/2039	14,895	19,198,943	0.1
Transatlantic Holdings, Inc.	8.00%	11/30/2039	7,430	9,493,369	0.1
Unum Group	4.13%	06/15/2051	574	421,268	0.0
Unum Group	4.50%	12/15/2049	79	62,615	0.0
				<u>166,191,608</u>	<u>1.2</u>
REITs					
American Tower Corp.	1.00%	01/15/2032	EUR 818	709,423	0.0
Digital Intrepid Holding BV	0.63%	07/15/2031	251	209,624	0.0
EPR Properties	4.50%	06/01/2027	USD 142	134,195	0.0
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	4.00%	01/15/2031	33	29,095	0.0
Grand City Properties SA, Series E(c)	1.50%	03/11/2026	EUR 200	119,047	0.0
Hudson Pacific Properties LP	5.95%	02/15/2028	USD 868	780,547	0.0
Kilroy Realty LP	3.05%	02/15/2030	879	736,254	0.0
Sabra Health Care LP	3.20%	12/01/2031	339	275,343	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	4.63%	06/15/2025	4,985	4,899,916	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5.63%	05/01/2024	3,667	3,663,210	0.0
				<u>11,556,654</u>	<u>0.0</u>
				<u>1,316,429,813</u>	<u>9.1</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Alexander Funding Trust II	7.47%	07/31/2028	9,775	10,243,038	0.1
Berkshire Hathaway Energy Co.	5.95%	05/15/2037	381	394,470	0.0
Electricite de France SA(c)	9.13%	03/15/2033	5,683	6,322,841	0.0
Israel Electric Corp., Ltd., Series G	4.25%	08/14/2028	7,416	6,834,660	0.1
National Grid PLC, Series E	4.28%	01/16/2035	EUR 100	109,087	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Niagara Mohawk Power Corp.	5.29%	01/17/2034	USD 12,075	\$ 11,766,047	0.1%
NRG Energy, Inc.	4.45%	06/15/2029	4,307	4,006,034	0.0
NRG Energy, Inc.	7.00%	03/15/2033	11,163	11,628,582	0.1
Pacific Gas & Electric Co.	5.55%	05/15/2029	8,245	8,261,389	0.1
Palomino Funding Trust I	7.23%	05/17/2028	16,763	17,470,339	0.1
RWE AG, Series E.	4.13%	02/13/2035	EUR 558	619,815	0.0
				<u>77,656,302</u>	<u>0.6</u>
ERDGAS					
National Grid North America, Inc., Series E.	1.05%	01/20/2031	1,241	1,115,352	0.0
National Grid North America, Inc., Series E.	4.67%	09/12/2033	844	957,360	0.0
				<u>2,072,712</u>	<u>0.0</u>
SONSTIGE VERSORGENSBETRIEBE					
Thames Water Utilities Finance PLC, Series E.	4.00%	06/19/2025	GBP 790	960,853	0.0
				<u>80,689,867</u>	<u>0.6</u>
				<u>2,460,377,800</u>	<u>16.9</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	USD 4,514	3,250,080	0.0
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	30,726	23,198,130	0.2
Braskem Netherlands Finance BV.	4.50%	01/10/2028	21,467	18,929,815	0.1
Braskem Netherlands Finance BV.	4.50%	01/31/2030	6,569	5,371,471	0.0
Braskem Netherlands Finance BV.	7.25%	02/13/2033	3,164	2,850,398	0.0
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	14,043	13,454,177	0.1
CSN Inova Ventures.	6.75%	01/28/2028	21,886	21,175,580	0.1
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	9,013	7,255,465	0.1
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026	12,983	13,021,300	0.1
Eldorado Gold Corp.	6.25%	09/01/2029	20,939	19,619,615	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	6.88%	10/15/2027	33,725	32,128,121	0.2
First Quantum Minerals Ltd.	9.38%	03/01/2029	5,550	5,754,765	0.0
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	17,089	17,188,458	0.1
Inversiones CMPC SA.	6.13%	02/26/2034	2,845	2,876,174	0.0
JSW Steel Ltd.	3.95%	04/05/2027	4,086	3,789,152	0.0
JSW Steel Ltd.	5.05%	04/05/2032	795	699,352	0.0
JSW Steel Ltd.	5.95%	04/18/2024	9,640	9,615,707	0.1
Nexa Resources SA	6.50%	01/18/2028	13,920	13,888,680	0.1
Sasol Financing USA LLC.	5.88%	03/27/2024	9,655	9,640,517	0.1
Sasol Financing USA LLC.	8.75%	05/03/2029	14,050	14,081,900	0.1
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	6.50%	11/07/2033	12,446	12,788,265	0.1
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	18,259	16,048,017	0.1
Stillwater Mining Co.	4.50%	11/16/2029	9,575	7,439,105	0.1
Suzano Austria GmbH.	3.75%	01/15/2031	4,365	3,815,010	0.0
Suzano Austria GmbH.	5.00%	01/15/2030	7,580	7,202,668	0.1
Suzano Austria GmbH.	6.00%	01/15/2029	1,600	1,600,000	0.0
Suzano Austria GmbH, Series DM3N.	3.13%	01/15/2032	5,618	4,609,007	0.0
UPL Corp., Ltd.	4.50%	03/08/2028	5,028	4,369,382	0.0
UPL Corp., Ltd.	4.63%	06/16/2030	10,296	8,469,490	0.1
Vedanta Resources Finance II PLC.	13.88%	01/21/2027	4,857	4,619,377	0.0
Volcan Cia Minera SAA.	4.38%	02/11/2026	5,921	3,708,026	0.0
				<u>312,457,204</u>	<u>2.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Cemex SAB de CV(c)	5.13%	06/08/2026	22,711	21,632,227	0.1
Embraer Netherlands Finance BV.	5.40%	02/01/2027	26,390	26,279,162	0.2
IHS Holding Ltd.	6.25%	11/29/2028	3,321	2,717,510	0.0
				<u>50,628,899</u>	<u>0.3</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA.	4.88%	01/22/2030	20,343	17,627,209	0.1
Prosus NV	3.06%	07/13/2031	31,563	25,388,646	0.2
Telecomunicaciones Digitales SA.	4.50%	01/30/2030	463	414,385	0.0
Weibo Corp.	3.38%	07/08/2030	8,596	7,371,844	0.1
				<u>50,802,084</u>	<u>0.4</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Financing DAC.	6.88%	09/15/2027	23,371	22,030,842	0.2
Xiaomi Best Time International Ltd.	3.38%	04/29/2030	3,817	3,332,718	0.0
				<u>25,363,560</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
GENM Capital Labuan Ltd.	3.88%	04/19/2031	1,161	1,004,628	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Falabella SA.	3.75%	10/30/2027	8,574	7,746,609	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	USD 4,508	\$ 4,305,185	0.0%
BRF SA	5.75%	09/21/2050	2,952	2,302,560	0.0
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdco SL/ Beliv Holdco SL	5.25%	04/27/2029	6,201	5,828,940	0.0
MARB BondCo PLC	3.95%	01/29/2031	32,440	26,357,500	0.2
Natura & Co Luxembourg Holdings SARL	6.00%	04/19/2029	9,791	9,509,998	0.1
Natura Cosméticos SA	4.13%	05/03/2028	2,192	2,004,255	0.0
Rede D'or Finance SARL	4.50%	01/22/2030	9,791	8,750,706	0.1
Rede D'or Finance SARL	4.95%	01/17/2028	6,580	6,226,325	0.0
				<u>65,285,469</u>	<u>0.4</u>
ENERGIE					
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	8,824	8,537,482	0.1
Canacol Energy Ltd.	5.75%	11/24/2028	11,186	7,618,512	0.0
Cosan Luxembourg SA	5.50%	09/20/2029	13,818	13,153,769	0.1
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	14,134	11,675,108	0.1
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	17,871	17,384,909	0.1
Ecopetrol SA	8.63%	01/19/2029	20,972	22,209,348	0.2
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027	8,316	7,525,980	0.1
Gran Tierra Energy, Inc.	9.50%	10/15/2029	12,259	11,339,575	0.1
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	19,060	18,755,993	0.1
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	3,062	2,976,938	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	8.55%	09/18/2033	13,741	14,531,107	0.1
KazMunayGas National Co. JSC	4.75%	04/19/2027	5,129	4,955,845	0.0
KazMunayGas National Co. JSC	5.38%	04/24/2030	22,742	22,079,753	0.2
Kosmos Energy Ltd.	7.50%	03/01/2028	7,400	6,856,100	0.0
Medco Maple Tree Pte Ltd.	8.96%	04/27/2029	8,630	8,992,460	0.1
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	9,826	9,226,702	0.1
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	3,463	3,216,538	0.0
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	7,683	7,627,778	0.1
SEPLAT Energy PLC	7.75%	04/01/2026	3,568	3,348,345	0.0
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	11,029	9,591,783	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	21,214	17,347,961	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	2,962	2,779,393	0.0
				<u>231,731,379</u>	<u>1.7</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	7,895	7,372,983	0.1
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	304	274,868	0.0
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	36,561	34,959,263	0.2
Lenovo Group Ltd.	3.42%	11/02/2030	2,752	2,396,552	0.0
Lenovo Group Ltd.	5.83%	01/27/2028	11,621	11,732,678	0.1
Lenovo Group Ltd.	6.54%	07/27/2032	6,850	7,175,375	0.1
Xiaomi Best Time International Ltd.	2.88%	07/14/2031	13,574	11,188,777	0.1
				<u>67,727,513</u>	<u>0.5</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	6,948	6,345,589	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA	6.75%	03/30/2029	6,951	7,002,020	0.0
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	2,678	2,497,235	0.0
				<u>9,499,255</u>	<u>0.0</u>
				<u>835,965,172</u>	<u>5.7</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Absa Group Ltd.(c)	6.38%	05/27/2026	6,561	6,265,755	0.0
Banco de Credito del Peru SA	5.85%	01/11/2029	9,240	9,333,857	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas	5.88%	09/13/2034	3,720	3,422,865	0.0
Türkiye Vakıflar Bankası TAO	9.00%	10/12/2028	7,011	7,382,863	0.1
Yapi ve Kredi Bankası AS	9.25%	10/16/2028	5,800	6,163,544	0.0
				<u>32,568,884</u>	<u>0.2</u>
FINANZEN					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	4,249	4,046,110	0.0
Huarong Finance 2017 Co., Ltd., Series E	4.25%	11/07/2027	854	789,736	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd., Series E	3.25%	11/13/2024	2,492	2,432,067	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd., Series E	3.75%	05/29/2024	1,330	1,320,856	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.63%	06/03/2026	8,049	7,743,218	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.88%	11/22/2026	7,503	7,217,136	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	5.50%	01/16/2025	13,140	13,020,032	0.1
				<u>36,569,155</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SONSTIGE FINANZWERTE					
OEC Finance Ltd.(a)	4.38%	10/25/2029	USD 3,589	\$ 143,563	0.0%
OEC Finance Ltd.(a)	5.25%	12/27/2033	4,193	213,825	0.0
OEC Finance Ltd.(a)	7.13%	12/26/2046	41,881	2,552,104	0.0
				<u>2,909,492</u>	<u>0.0</u>
REITs					
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	18,816	17,072,698	0.1
Trust Fibra Uno	6.95%	01/30/2044	3,173	2,839,835	0.0
				<u>19,912,533</u>	<u>0.1</u>
				<u>91,960,064</u>	<u>0.6</u>
STAATSANLEIHEN					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	32,819	29,193,485	0.2
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	20,250	16,261,357	0.1
Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048	10,509	8,604,769	0.1
				<u>54,059,611</u>	<u>0.4</u>
ARGENTINIEN					
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	20,068	9,293,770	0.1
Argentine Republic Government International Bond	3.50%	07/09/2041	30,585	10,949,398	0.1
Argentine Republic Government International Bond	3.63%	07/09/2035	14,768	5,482,663	0.0
Argentine Republic Government International Bond	4.25%	01/09/2038	24,411	10,191,506	0.1
				<u>35,917,337</u>	<u>0.3</u>
KOLUMBIEN					
Colombia Government International Bond	4.13%	05/15/2051	12,840	7,872,589	0.1
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	11,709	9,174,353	0.1
Colombia Government International Bond	8.00%	11/14/2035	3,980	4,138,006	0.0
				<u>21,184,948</u>	<u>0.2</u>
ELFENBEINKÜSTE					
Ivory Coast Government International Bond	4.88%	01/30/2032	EUR 43,563	39,579,054	0.3
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	USD 8,905	8,632,284	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.88%	10/17/2040	EUR 32,060	28,716,559	0.2
				<u>76,927,897</u>	<u>0.6</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	USD 25,254	25,184,551	0.2
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	22,564	23,503,227	0.2
				<u>48,687,778</u>	<u>0.4</u>
ÄGYPTEN					
Egypt Government International Bond	5.88%	02/16/2031	1,655	1,332,391	0.0
Egypt Government International Bond	7.30%	09/30/2033	3,437	2,803,870	0.0
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	2,283	1,944,568	0.0
Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	7,580	5,876,092	0.0
Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049	10,320	8,135,359	0.1
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	22,855	18,276,858	0.1
				<u>38,369,138</u>	<u>0.2</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	10,976	9,441,884	0.1
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	9,977	6,819,479	0.0
El Salvador Government International Bond	7.63%	02/01/2041	7,141	5,206,075	0.0
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	1,843	1,383,402	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	6,788	5,914,045	0.0
				<u>28,764,885</u>	<u>0.1</u>
GABUN					
Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025	17,720	17,065,600	0.1
KENIA					
Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	16,016	15,350,856	0.1
LIBANON					
Lebanon Government International Bond(e)	6.65%	04/22/2024	4,315	248,113	0.0
Lebanon Government International Bond(e)	6.85%	03/23/2027	5,606	322,345	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(e)	1.00%	11/27/2026	10,759	618,643	0.0
				<u>1,189,101</u>	<u>0.0</u>
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	24,687	21,686,789	0.2
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	9,479	8,618,591	0.1
Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	10,008	8,838,315	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	14,105	11,325,610	0.1
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	17,700	15,556,353	0.1
				<u>66,025,658</u>	<u>0.6</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PANAMA					
Panama Government International Bond	7.50%	03/01/2031	USD 5,415	\$ 5,557,279	0.0%
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	7,398	6,963,368	0.0
				<u>12,520,647</u>	<u>0.0</u>
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR 7,541	7,370,939	0.1
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	USD 53,439	44,487,968	0.3
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	16,224	11,742,120	0.1
				<u>63,601,027</u>	<u>0.5</u>
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047	8,663	6,299,625	0.0
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	55,520	40,425,500	0.3
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	1,684	1,328,255	0.0
				<u>48,053,380</u>	<u>0.3</u>
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2035	17,273	4,526,562	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2025	45,102	13,778,661	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2027	10,000	2,895,900	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2029	13,037	3,683,474	0.0
				<u>24,884,597</u>	<u>0.1</u>
VENEZUELA					
Venezuela Government International Bond(f)	9.00%	05/07/2023	4,270	623,420	0.0
Venezuela Government International Bond(e)	9.25%	09/15/2027	31,885	5,707,415	0.0
				<u>6,330,835</u>	<u>0.0</u>
				<u>558,933,295</u>	<u>3.9</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Adani Green Energy Ltd.	4.38%	09/08/2024	8,794	8,679,062	0.1
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	10,186	9,893,662	0.1
Buffalo Energy Mexico Holdings/Buffalo Energy Infrastructure/ Buffalo Energy	7.88%	02/15/2039	2,244	2,373,389	0.0
Cometa Energia SA de CV	6.38%	04/24/2035	7,092	6,980,811	0.0
Continuum Energy Aura Pte Ltd.	9.50%	02/24/2027	6,407	6,666,484	0.0
Diamond II Ltd.	7.95%	07/28/2026	11,942	12,127,388	0.1
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	1,909	1,837,581	0.0
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	11,748	10,738,406	0.1
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	8,915	8,491,538	0.1
Kallpa Generacion SA	4.13%	08/16/2027	1,881	1,775,664	0.0
Minejesa Capital BV	4.63%	08/10/2030	5,904	5,590,007	0.0
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	11,757	11,762,361	0.1
Terraform Global Operating LP	6.13%	03/01/2026	2,777	2,749,477	0.0
				<u>89,665,830</u>	<u>0.6</u>
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Aegea Finance SARL	9.00%	01/20/2031	2,471	2,614,460	0.0
				<u>92,280,290</u>	<u>0.6</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
Raizen Fuels Finance SA	6.45%	03/05/2034	11,711	11,850,850	0.1
				<u>1,590,989,671</u>	<u>10.9</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	4.00%	11/15/2052	101,000	94,403,437	0.7
U.S. Treasury Bonds	4.75%	11/15/2053	14,295	15,183,864	0.1
U.S. Treasury Bonds(g)	6.75%	08/15/2026	212,755	223,027,067	1.5
U.S. Treasury Notes(g)	4.00%	06/30/2028	74,933	73,996,239	0.5
U.S. Treasury Notes(g)	4.38%	10/31/2024	40,684	40,455,550	0.3
U.S. Treasury Notes	4.38%	11/30/2028	103,954	104,343,627	0.7
U.S. Treasury Notes	4.63%	09/30/2028	150,000	151,945,320	1.0
U.S. Treasury Notes	4.88%	11/30/2025	199,000	199,435,313	1.4
U.S. Treasury Notes	5.00%	10/31/2025	63,000	63,226,409	0.4
				<u>966,016,826</u>	<u>6.6</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			2,186,465	177,453,529	1.2
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S			4,017,647	108,556,821	0.7
AB SICAV I - Emerging Market Local Currency Debt Portfolio - Class ZT			5,215,178	46,467,240	0.3
AB SICAV I - Sustainable Euro High Yield Portfolio - Class S			5,216,996	182,688,350	1.3
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			4,895,445	65,256,285	0.5
				<u>580,422,225</u>	<u>4.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-DNA1, Series 2015-DNA1, Class B(b)	14.64%	10/25/2027	USD 31,990	\$ 34,336,803	0.3%
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-DNA2, Series 2015-DNA2, Class B(b)	12.99%	12/25/2027	40,602	42,956,054	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-DNA3, Series 2015-DNA3, Class B(b)	14.79%	04/25/2028	15,199	16,766,180	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQ2, Series 2015-HQ2, Class B(b)	13.39%	05/25/2025	1,414	1,498,259	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQA1, Series 2015-HQA1, Class B(b)	14.24%	03/25/2028	19,236	20,234,848	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQA2, Series 2015-HQA2, Class B(b)	15.94%	05/25/2028	10,424	11,361,654	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA3, Series 2016-DNA3, Class B(b)	16.69%	12/25/2028	7,185	8,296,616	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA4, Series 2016-DNA4, Class B(b)	14.04%	03/25/2029	8,629	9,575,225	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-HQA1, Series 2016-HQA1, Class B(b)	18.19%	09/25/2028	16,357	19,205,492	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-HQA2, Series 2016-HQA2, Class B(b)	16.94%	11/25/2028	13,597	15,652,234	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-HQA4, Series 2016-HQA4, Class B(b)	14.19%	04/25/2029	2,284	2,463,109	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities Series 2016-C01, Class 1B(b)	17.19%	08/25/2028	39,078	44,894,631	0.3
Series 2016-C02, Class 1B(b)	17.69%	09/25/2028	21,417	25,030,163	0.2
Series 2016-C03, Class 1B(b)	17.19%	10/25/2028	7,754	9,017,583	0.1
Series 2016-C03, Class 2B(b)	18.19%	10/25/2028	18,461	21,626,230	0.2
Series 2016-C04, Class 1B(b)	15.69%	01/25/2029	46,086	52,459,525	0.4
Series 2016-C05, Class 2B(b)	16.19%	01/25/2029	35,997	40,933,942	0.3
Series 2016-C06, Class 1B(b)	14.69%	04/25/2029	21,156	23,840,293	0.2
Series 2016-C07, Class 2B(b)	14.94%	05/25/2029	27,679	31,087,401	0.2
				431,236,242	3.4
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS					
Series 4398, Class IO(h)	6.00%	10/15/2037	16,673	2,845,833	0.0
Series 4976, Class MI(h)	4.50%	05/25/2050	19,539	4,356,518	0.1
Series 4981, Class MI(h)	5.00%	06/25/2050	29,355	5,840,451	0.1
Series 4987, Class IC(h)	4.50%	06/25/2050	66,140	14,945,145	0.1
Series 4993, Class LI(h)	5.00%	07/25/2050	7,843	1,559,049	0.0
Series 5008, Class AI(h)	3.50%	09/25/2050	9,333	1,784,622	0.0
Series 5011, Class MI(h)	3.00%	09/25/2050	8,990	1,385,712	0.0
Series 5013, Class JI(h)	4.00%	09/25/2050	15,257	3,152,158	0.0
Series 5015, Class BI(h)	4.00%	09/25/2050	15,065	2,986,499	0.0
Series 5018, Class AI(h)	4.00%	10/25/2050	8,189	1,615,878	0.0
Series 5018, Class GI(h)	4.50%	10/25/2050	10,587	2,387,521	0.0
Series 5024, Class DI(h)	4.00%	10/25/2050	3,744	742,716	0.0
Series 5030, Class EI(h)	3.50%	10/25/2050	3,408	574,575	0.0
Series 5036, Class IT(h)	4.00%	03/25/2050	4,574	933,356	0.0
Series 5040, Class AI(h)	3.50%	11/25/2050	1,328	220,513	0.0
Series 5043, Class IO(h)	5.00%	11/25/2050	9,148	2,056,706	0.0
Series 5049, Class CI(h)	3.50%	12/25/2050	15,728	2,853,366	0.0
Series 5052, Class IK(h)	4.00%	12/25/2050	13,964	2,793,411	0.0
Federal National Mortgage Association REMICS					
Series 2010-109, Class IQ(h)	5.50%	08/25/2040	2,426	172,947	0.0
Series 2013-66, Class LI(h)	7.00%	07/25/2043	8,040	1,162,693	0.0
Series 2015-49, Class LI(h)	5.00%	07/25/2045	8,549	1,405,910	0.0
Series 2016-26, Class IO(h)	5.00%	05/25/2046	8,753	1,255,746	0.0
Series 2019-4, Class AI(h)	6.00%	08/25/2038	14,703	2,564,744	0.0
Series 2020-76, Class GI(h)	4.00%	11/25/2050	9,888	2,081,766	0.0
Series 2020-89, Class KI(h)	4.00%	12/25/2050	46,052	8,864,189	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2020-96, Class KI(h)	2.50%	01/25/2051	USD 5,093	\$ 765,644	0.0%
Series 2021-18, Class IT(h)	3.00%	04/25/2051	9,535	1,528,147	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2021-41, Class UI(h)	3.50%	03/20/2051	19,418	3,533,783	0.0
				<u>76,369,598</u>	<u>0.4</u>
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS					
Series 4125, Class SA(b) (i)	0.71%	11/15/2042	4,306	445,806	0.0
Series 4248, Class SL(b) (i)	0.61%	05/15/2041	12,240	854,267	0.0
Series 4701, Class NS(b) (i)	0.71%	08/15/2039	4,707	400,207	0.0
Series 4736, Class LS(b) (i)	0.76%	12/15/2047	18,512	2,102,371	0.0
Series 4736, Class SM(b) (i)	0.76%	12/15/2047	36,891	3,943,889	0.0
Series 4774, Class BS(b) (i)	0.76%	02/15/2048	17,099	2,080,408	0.0
Series 4954, Class SL(b) (i)	0.61%	02/25/2050	13,574	1,369,616	0.0
Series 4981, Class HS(b) (i)	0.66%	06/25/2050	42,789	3,654,760	0.0
Series 4981, Class JS(b) (i)	0.66%	06/25/2050	65,483	7,951,346	0.1
Federal National Mortgage Association REMICS					
Series 2005-91, Class SD(b) (i)	1.26%	10/25/2035	3,358	286,119	0.0
Series 2012-70, Class HS(b) (i)	0.56%	07/25/2042	2,556	299,358	0.0
Series 2013-15, Class SA(b) (i)	0.71%	03/25/2043	11,011	1,207,017	0.0
Series 2015-26, Class SH(b) (i)	1.01%	05/25/2045	3,675	454,903	0.0
Series 2016-64, Class SP(b) (i)	0.56%	09/25/2046	12,710	1,240,533	0.0
Series 2016-89, Class SH(b) (i)	0.56%	12/25/2046	9,347	944,681	0.0
Series 2017-97, Class SW(b) (i)	0.76%	12/25/2047	21,061	2,426,269	0.0
Series 2018-36, Class SG(b) (i)	0.76%	06/25/2048	9,113	1,224,782	0.0
Series 2018-43, Class SB(b) (i)	0.76%	06/25/2048	5,015	538,922	0.0
Series 2019-38, Class SM(b) (i)	0.61%	07/25/2049	3,729	351,490	0.0
Series 2019-65, Class SY(b) (i)	0.61%	11/25/2049	7,765	904,524	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2009-76, Class SB(b) (i)	0.66%	09/16/2039	4,202	293,658	0.0
Series 2015-3, Class DS(b) (i)	0.17%	11/20/2041	7,885	151,958	0.0
Series 2017-134, Class MS(b) (i)	0.77%	09/20/2047	5,174	613,033	0.0
Series 2017-161, Class CS(b) (i)	0.82%	10/20/2047	10,274	855,627	0.0
Series 2020-47, Class SG(b) (i)	0.57%	02/20/2049	8,776	894,699	0.0
				<u>35,490,243</u>	<u>0.1</u>
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust					
Series 2006-42, Class 1A6	6.00%	01/25/2047	2,436	1,261,445	0.0
Series 2006-24CB, Class A16	5.75%	08/25/2036	1,299	698,823	0.0
Series 2006-26CB, Class A6	6.25%	09/25/2036	650	327,942	0.0
Series 2006-26CB, Class A8	6.25%	09/25/2036	2,460	1,240,852	0.0
Series 2006-J5, Class 1A1	6.50%	09/25/2036	1,560	856,505	0.0
Series 2007-15CB, Class A19	5.75%	07/25/2037	1,289	738,689	0.0
Series 2007-16CB, Class 1A7	6.00%	08/25/2037	2,592	1,922,651	0.0
Bear Stearns ARM Trust, Series 2007-4, Class 22A1	4.08%	06/25/2047	4,712	4,124,375	0.0
ChaseFlex Trust, Series 2007-1, Class 1A3	6.50%	02/25/2037	4,250	1,499,509	0.0
CHL Mortgage Pass-Through Trust					
Series 2006-13, Class 1A19	6.25%	09/25/2036	555	239,261	0.0
Series 2007-3, Class A30	5.75%	04/25/2037	1,086	496,714	0.0
Series 2007-HY4, Class 1A1	4.43%	09/25/2047	1,517	1,298,792	0.0
Citigroup Mortgage Loan Trust,					
Series 2007-AR4, Class 1A1A	4.65%	03/25/2037	882	721,007	0.0
CitiMortgage Alternative Loan Trust,					
Series 2007-A3, Class 1A4	5.75%	03/25/2037	401	351,798	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust,					
Series 2006-AA3, Class A1	5.88%	06/25/2036	1,016	766,675	0.0
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust,					
Series 2007-6XS, Class 2A5S(b)	6.50%	02/25/2047	3,516	1,205,091	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
Series 2005-QA10, Class A31	5.15%	09/25/2035	3,153	2,094,256	0.0
Series 2005-QS14, Class 3A1	6.00%	09/25/2035	701	569,067	0.0
Residential Asset Securitization Trust					
Series 2006-A8, Class 3A4	6.00%	08/25/2036	2,251	1,022,281	0.0
Series 2007-A1, Class A8	6.00%	03/25/2037	3,804	1,217,296	0.0
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates					
WMALT Trust, Series 2006-3, Class 3CB4	6.00%	04/25/2036	373	303,717	0.0
				<u>22,956,746</u>	<u>0.0</u>
NICHT STAATLICH VARIABLE VERZINSLICH					
Alternative Loan Trust, Series 2007-7T2, Class A3(b)	6.00%	04/25/2037	5,967	2,084,159	0.0
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2007-13, Class A7(b)	6.00%	08/25/2037	2,037	804,909	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust,					
Series 2007-FA2, Class 1A6(b) (i)	0.11%	04/25/2037	1,529	110,248	0.0
Impac Secured Assets Corp., Series 2005-2, Class A2D(b)	6.30%	03/25/2036	989	775,339	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Lehman XS Trust					
Series 2007-10H, Class 2AIO(b) (i)	1.56%	07/25/2037	USD 2,105	\$ 175,451	0.0%
Series 2007-16N, Class 2A2(b).	7.14%	09/25/2047	1,483	1,269,200	0.0
PHH Alternative Mortgage Trust, Series 2007-2, Class 1A3(b)	6.10%	05/25/2037	682	586,730	0.0
RBSGC Mortgage Loan Trust, Series 2007-B, Class 1A4(b)	5.89%	01/25/2037	780	241,899	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust, Series 2006-QS18, Class 2A2(b) (i)	1.11%	12/25/2036	5,177	494,187	0.0
				<u>6,542,122</u>	<u>0.0</u>
				<u>572,594,951</u>	<u>3.9</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
CHILE					
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	01/08/2034	13,941	13,779,807	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile	6.44%	01/26/2036	7,699	7,840,950	0.1
				<u>21,620,757</u>	<u>0.2</u>
INDONESIEN					
Indonesia Asahan Aluminium PT/ Mineral Industri Indonesia Persero PT	4.75%	05/15/2025	1,131	1,115,584	0.0
Indonesia Asahan Aluminium PT/ Mineral Industri Indonesia Persero PT	5.45%	05/15/2030	1,209	1,183,321	0.0
				<u>2,298,905</u>	<u>0.0</u>
MEXIKO					
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	12,749	10,621,511	0.1
Comision Federal de Electricidad	3.88%	07/26/2033	9,050	7,387,062	0.1
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	19,266	18,134,122	0.1
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	55,220	42,872,808	0.3
Petroleos Mexicanos	6.50%	03/13/2027	6,026	5,620,149	0.0
Petroleos Mexicanos	6.70%	02/16/2032	38,554	31,101,512	0.2
				<u>115,737,164</u>	<u>0.8</u>
PANAMA					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA.	4.00%	08/11/2041	2,524	1,799,139	0.0
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA.	5.13%	08/11/2061	1,161	815,034	0.0
				<u>2,614,173</u>	<u>0.0</u>
SÜDAFRIKA					
Transnet SOC Ltd.	8.25%	02/06/2028	21,430	21,309,456	0.1
TRINIDAD UND TOBAGO					
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	217	211,532	0.0
TÜRKEI					
TC Ziraat Bankasi AS	8.00%	01/16/2029	7,367	7,459,088	0.1
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS	9.00%	01/28/2027	2,672	2,787,230	0.0
				<u>10,246,318</u>	<u>0.1</u>
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE					
DP World Crescent Ltd., Series E	3.88%	07/18/2029	899	840,763	0.0
DP World Ltd./United Arab Emirates	5.63%	09/25/2048	3,782	3,542,079	0.0
DP World Salaam(c).	6.00%	10/01/2025	21,915	21,829,970	0.1
				<u>26,212,812</u>	<u>0.1</u>
VENEZUELA					
Petroleos de Venezuela SA(e)	5.38%	04/12/2027	61,738	6,328,125	0.0
				<u>206,579,242</u>	<u>1.3</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Consolidated Energy Finance SA	5.00%	10/15/2028	EUR 6,188	5,660,590	0.0
Consolidated Energy Finance SA	6.50%	05/15/2026	USD 1,041	947,885	0.0
				<u>6,608,475</u>	<u>0.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Allwyn Entertainment Financing UK PLC	7.88%	04/30/2029	4,190	4,324,749	0.0
Allwyn International AS	3.88%	02/15/2027	EUR 7,626	7,984,613	0.1
Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029	USD 5,214	4,714,707	0.0
Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027	10,154	9,655,819	0.1
Melco Resorts Finance Ltd.	5.75%	07/21/2028	2,757	2,583,171	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	5,982	5,864,095	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024	8,461	8,426,564	0.1
MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	6,242	6,132,266	0.1
Studio City Co., Ltd.	7.00%	02/15/2027	3,664	3,653,228	0.0
Studio City Finance Ltd.	5.00%	01/15/2029	548	478,130	0.0
Studio City Finance Ltd.	6.00%	07/15/2025	9,535	9,391,975	0.1
Studio City Finance Ltd.	6.50%	01/15/2028	10,680	10,105,950	0.1
Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024	1,000	992,000	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Wynn Macau Ltd.	5.13%	12/15/2029	USD 3,667	\$ 3,304,884	0.0%
Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	16,527	16,031,851	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.50%	10/01/2027	12,252	11,608,770	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	10,091	9,453,552	0.1
				<u>114,706,324</u>	<u>0.9</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.	4.75%	05/09/2027	26,195	24,925,328	0.2
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.	5.13%	05/09/2029	20,440	19,360,359	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.	6.75%	03/01/2028	4,961	5,011,007	0.0
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.	7.88%	09/15/2029	5,217	5,553,989	0.0
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.	8.13%	09/15/2031	5,539	5,985,287	0.0
				<u>60,835,970</u>	<u>0.3</u>
ENERGIE					
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	7,639	7,476,951	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	13,968	13,375,663	0.1
				<u>20,852,614</u>	<u>0.2</u>
				<u>203,003,383</u>	<u>1.4</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E.	4.65%	02/10/2036	11,700	8,577,111	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(h)	1.01%	11/15/2050	4,365	119,299	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C8, Class XA(h)	1.47%	06/15/2050	7,514	265,495	0.0
Citigroup Commercial Mortgage Trust Series 2015-GC29, Class XA(h)	1.01%	04/10/2048	27,114	209,273	0.0
Series 2017-P8, Class XA(h)	0.87%	09/15/2050	45,146	1,041,808	0.0
Series 2018-C6, Class XA(h)	0.75%	11/10/2051	3,033	88,534	0.0
Commercial Mortgage Trust Series 2010-C1, Class F	4.00%	07/10/2046	3,049	2,627,581	0.0
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	4,120	1,957,005	0.0
Series 2012-CR3, Class F(b)	4.75%	10/15/2045	730	36,694	0.0
Series 2014-CR16, Class D.	4.92%	04/10/2047	20,000	15,593,398	0.1
Series 2014-CR20, Class XA(h)	0.92%	11/10/2047	43,511	75,222	0.0
Series 2016-DC2, Class XA(h)	0.91%	02/10/2049	31,813	411,860	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(h)	1.15%	09/10/2050	17,354	531,951	0.0
GS Mortgage Securities Trust, Series 2017-GS7, Class XA(h)	1.08%	08/10/2050	54,925	1,521,681	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust Series 2013-C14, Class D	4.11%	08/15/2046	3,001	1,921,986	0.0
Series 2014-C21, Class XA(h)	0.87%	08/15/2047	41,530	29,420	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust Series 2015-C22, Class XA(h)	1.00%	04/15/2048	62,524	356,238	0.0
Series 2016-C30, Class XA(h)	1.29%	09/15/2049	52,225	1,192,493	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2016-BNK2, Class XA(h)	0.95%	11/15/2049	72,157	1,390,325	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust Series 2017-C2, Class XA(h)	1.07%	08/15/2050	2,350	66,807	0.0
Series 2018-C10, Class XA(h)	0.85%	05/15/2051	78,647	2,346,395	0.0
Series 2018-C14, Class XA(h)	0.87%	12/15/2051	39,220	1,259,255	0.0
Series 2018-C15, Class XA(h)	0.88%	12/15/2051	63,686	2,128,447	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust Series 2016-C33, Class XA(h)	1.56%	03/15/2059	53,126	1,261,673	0.0
Series 2016-C35, Class XA(h)	1.88%	07/15/2048	4,577	148,777	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(h)	1.61%	10/15/2049	76,668	2,341,721	0.0
Series 2017-C38, Class XA(h)	0.93%	07/15/2050	23,258	536,094	0.0
Series 2018-C48, Class XA(h)	0.93%	01/15/2052	27,566	947,992	0.0
				<u>48,984,535</u>	<u>0.2</u>
NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class E(b)	10.67%	05/15/2036	5,780	5,210,460	0.1
				<u>54,194,995</u>	<u>0.3</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABLE VERZINSLICH					
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(b)	11.94%	04/15/2034	4,063	3,964,460	0.0
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class E(b)	11.73%	07/20/2034	2,500	2,412,012	0.0
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(b)	11.33%	04/20/2034	3,000	2,874,105	0.0
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class D(b)	12.58%	01/20/2034	1,750	1,750,248	0.0
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class D(b)	11.56%	10/20/2034	5,030	4,895,035	0.0
Cedar Funding IX CLO Ltd., Series 2018-9A, Class E(b)	10.93%	04/20/2031	550	516,108	0.0
Clover CLO LLC, Series 2021-3A, Class E(b)	12.05%	01/25/2035	7,600	7,626,304	0.1
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(b)	12.04%	04/15/2034	3,600	3,460,486	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class E(b)	12.78%	01/20/2032	2,250	2,251,654	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class E(b)	11.53%	07/16/2035	USD 2,750	\$ 2,690,064	0.0%
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 44 Ltd., Series 2021-44A, Class E(b)	11.58%	10/16/2034	750	741,160	0.0
Octagon Investment Partners 30 Ltd., Series 2017-1A, Class D(b)	11.78%	03/17/2030	1,000	931,882	0.0
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class D(b)	10.88%	01/17/2031	2,933	2,609,052	0.0
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(b)	11.58%	10/20/2034	3,700	3,666,249	0.0
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class ER	12.32%	02/25/2037	2,000	1,980,000	0.0
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class E(b)	12.06%	10/18/2034	2,050	1,929,304	0.0
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(b)	11.53%	07/15/2031	7,200	6,391,152	0.1
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(b)	11.94%	07/20/2034	2,000	1,872,660	0.0
				<u>52,561,935</u>	<u>0.2</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
RUMÄNIEN					
Romanian Government International Bond	5.88%	01/30/2029	14,202	14,092,645	0.1
SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
HDFC Bank Ltd.	8.10%	03/22/2025	INR 1,070,000	12,601,975	0.1
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	USD 2,327	2,102,299	0.0
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	6,000	5,998,125	0.1
				<u>8,100,424</u>	<u>0.1</u>
STAMMAKTIE					
Battalion Oil Corp.			393	2,354	0.0
Gulfport Energy Corp.			2,650	376,273	0.0
National CineMedia, Inc.			1,192,231	4,840,458	0.1
SandRidge Energy, Inc.			3,888	50,700	0.0
				<u>5,269,785</u>	<u>0.1</u>
BEZUGSRECHTE					
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Vistra Energy Corp., expiring 12/31/2049.			454,387	556,624	0.0
				<u>13,731,630,614</u>	<u>94.1</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Magnetation LLC/Mag Finance Corp.(f) (j)	11.00%	05/15/2018	USD 40,106	0	0.0
Sealed Air Corp./Sealed Air Corp. US.	6.13%	02/01/2028	5,295	5,283,865	0.0
				<u>5,283,865</u>	<u>0.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	7.25%	01/15/2031	6,026	6,245,864	0.0
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
DISH Network Corp.(k)	3.38%	08/15/2026	6,494	3,838,350	0.0
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Level 3 Financing, Inc.	3.75%	07/15/2029	13,050	5,364,599	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Exide Technologies(j)	11.00%	10/31/2024	38,726	0	0.0
Real Hero Merger Sub 2, Inc.	6.25%	02/01/2029	17,634	15,339,262	0.1
				<u>15,339,262</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
NCL Corp., Ltd.	5.88%	02/15/2027	130	128,448	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	9.25%	01/15/2029	17,085	18,378,051	0.1
Six Flags Entertainment Corp.	7.25%	05/15/2031	12,245	12,321,679	0.1
				<u>30,828,178</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/					
Hilton Grand Vacations Borrower Esc	4.88%	07/01/2031	18,956	16,728,705	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	10,577	10,148,140	0.1
				<u>26,876,845</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	3.88%	01/15/2028	1,000	931,446	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Foundation Building Materials, Inc.	6.00%	03/01/2029	5,396	4,748,961	0.0
SRS Distribution, Inc.	6.13%	07/01/2029	4,009	3,738,995	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Wolverine World Wide, Inc.	4.00%	08/15/2029	USD 1,000	\$ 801,519	0.0%
				<u>9,289,475</u>	<u>0.0</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
ModivCare, Inc.	5.88%	11/15/2025	3,735	3,647,147	0.0
Option Care Health, Inc.	4.38%	10/31/2029	21,312	19,457,923	0.1
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	3,097	3,039,278	0.0
				<u>26,144,348</u>	<u>0.1</u>
ENERGIE					
EQM Midstream Partners LP.	4.50%	01/15/2029	1,248	1,168,147	0.0
Hess Midstream Operations LP.	4.25%	02/15/2030	2,753	2,506,045	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	9,336	9,020,028	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.25%	04/15/2032	143	139,030	0.0
Rockies Express Pipeline LLC.	4.95%	07/15/2029	1,103	1,031,694	0.0
				<u>13,864,944</u>	<u>0.1</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The)	4.88%	07/15/2032	1,011	916,236	0.0
Block, Inc.	3.50%	06/01/2031	3,828	3,267,017	0.0
Garda World Security Corp.	9.50%	11/01/2027	16,407	16,467,107	0.1
Monitronics International, Inc.(f) (j)	9.13%	04/01/2020	21,822	0	0.0
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	5,687	5,520,348	0.0
				<u>26,170,708</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	30,075	21,689,528	0.2
				<u>191,867,412</u>	<u>1.0</u>
FINANZINSTITUTE					
MAKLER					
NFP Corp.	4.88%	08/15/2028	180	179,509	0.0
FINANZEN					
Curo Group Holdings Corp.	7.50%	08/01/2028	18,955	1,877,117	0.0
Curo SPV LLC(j)	18.00%	08/02/2027	1,803	1,493,573	0.0
goeasy Ltd.	9.25%	12/01/2028	16,536	17,552,791	0.1
				<u>20,923,481</u>	<u>0.1</u>
				<u>21,102,990</u>	<u>0.1</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
NRG Energy, Inc.	5.25%	06/15/2029	130	123,257	0.0
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Solaris Midstream Holdings LLC.	7.63%	04/01/2026	8,515	8,513,973	0.1
				<u>8,637,230</u>	<u>0.1</u>
				<u>221,607,632</u>	<u>1.2</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class E(b)	11.58%	04/15/2034	5,000	4,900,310	0.0
AGL CLO 13 Ltd., Series 2021-13A, Class E(b)	12.08%	10/20/2034	12,156	11,798,430	0.1
AGL CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class E(b)	12.43%	01/20/2035	2,900	2,839,114	0.0
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class E(b)	12.84%	01/20/2034	2,000	2,001,114	0.0
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(b)	11.78%	04/15/2033	1,752	1,686,228	0.0
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(b)	11.86%	07/18/2030	3,732	3,475,485	0.0
Dryden 57 CLO Ltd., Series 2018-57A, Class E(b)	10.77%	05/15/2031	6,004	5,405,173	0.1
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class E(b)	12.57%	04/22/2035	4,200	4,203,049	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class ER(b)	11.73%	10/20/2030	7,000	6,815,984	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd., Series 2018-29A, Class D(b)	8.67%	10/19/2031	3,000	2,996,259	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class ER(b)	11.83%	10/16/2033	8,200	7,928,416	0.1
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class E(b)	11.08%	04/15/2031	10,000	9,181,360	0.1
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class E(b)	13.25%	04/22/2034	6,150	6,133,758	0.1
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class E(b)	12.34%	02/25/2034	3,000	2,999,991	0.0
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class E(b)	12.04%	07/20/2034	8,350	8,195,091	0.1
Whehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class E(b)	12.07%	04/21/2035	11,890	11,828,731	0.1
				<u>92,388,493</u>	<u>0.8</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2014-GC23, Class D.	4.47%	07/10/2047	15,574	13,555,824	0.1
Grantor Trust CGCMT(j)	4.49%	09/15/2048	555	18,461,103	0.2
Grantor Trust CMBSIT(j)	0.00%	11/10/2046	842	12,053,610	0.1
Grantor Trust COMM(j)	0.00%	03/10/2047	469	4,284,063	0.0
Grantor Trust CSAIL(j)	4.00%	04/15/2050	1,006	8,935,477	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Grantor Trust JPMBB(j)	4.00%	11/15/2047	USD 1,109	\$ 4,929,770	0.0%
Grantor Trust WFRBS(j)	3.40%	10/15/2057	581	8,970,055	0.1
GS Mortgage Securities Trust(j)	3.49%	07/10/2046	541	5,914,356	0.0
GS Mortgage Securities Trust(j)	2.16%	07/10/2046	69	850,273	0.0
Series 2011-GC5, Class D	5.15%	08/10/2044	2,801	1,015,666	0.0
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-LC9, Class G	3.77%	12/15/2047	13,837	7,541,210	0.1
WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2014-C20, Class D	3.99%	05/15/2047	4,799	1,497,266	0.0
				<u>88,008,673</u>	<u>0.7</u>
STAMMAKTIE					
AG Tracker(j)			982,587	1	0.0
ATD New Holdings, Inc.			525,684	12,265,785	0.1
BIS Industries Holdings Ltd.(j)			10,224,003	10	0.0
CHC Group LLC(j)			262,557	53	0.0
Exide Technologies(j)			6,006	1,879,878	0.0
GOLO Mobile, Inc.(j)			485,119	0	0.0
K201640219 South Africa Ltd. - Class A(j)			193,371,375	193	0.0
K201640219 South Africa Ltd. - Class B(j)			30,622,211	31	0.0
Mt. Logan Re, Ltd. Special Investment, Series 1, June 2022 - Class U-2(j)			4,148	1,582,137	0.0
Mt. Logan Re, Ltd. Special Investment, Series 2, June 2022 - Class U-2(j)			6,306	2,405,166	0.0
New Cotai LLC/New Cotai Capital Corp.(j)			63	0	0.0
Paysafe Ltd.			134,791	1,940,990	0.0
Southeastern Grocers, Inc.(j)			2,258,161	57,018,565	0.4
				<u>77,092,809</u>	<u>0.5</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
INVESTITIONSGÜTER					
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	USD 25,375	26,644	0.0
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Digicel Group Holdings Ltd., Series 3ARG	0.00%	12/31/2030	14	7,007	0.0
Digicel Group Holdings Ltd., Series 3BRG	0.00%	12/31/2030	1,375	68,728	0.0
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	14,252	13,643,440	0.1
				<u>13,719,175</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Falabella SA.	3.38%	01/15/2032	15,444	11,862,150	0.0
K2016470219 South Africa Ltd.(f) (j)	3.00%	12/31/2022	16,758	0	0.0
K2016470260 South Africa Ltd.(f) (j)	25.00%	12/31/2022	11,747	0	0.0
				<u>11,862,150</u>	<u>0.0</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BBFI Liquidating Trust(j)	0.00%	12/30/2099	19,467	5,636,504	0.0
Tonon Luxembourg SA(e)	6.50%	10/31/2024	4,691	469	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(f) (j)	10.50%	01/28/2018	27,458	2,746	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(f) (j)	10.88%	01/13/2020	8,270	827	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(f) (j)	11.75%	02/09/2022	32,498	3,250	0.0
				<u>5,643,796</u>	<u>0.0</u>
				<u>31,251,765</u>	<u>0.1</u>
STAATSANLEIHEN					
ECUADOR					
Ecuador Government International Bond	3.50%	07/31/2035	70,999	33,857,806	0.3
				<u>65,109,571</u>	<u>0.4</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
State of California, Series 2010	7.60%	11/01/2040	5,645	6,923,342	0.1
State of Illinois, Series 2010	7.35%	07/01/2035	18,214	19,647,868	0.1
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021	5.75%	07/25/2041	15,000	13,316,133	0.1
				<u>39,887,343</u>	<u>0.3</u>
SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
K201640219 South Africa Ltd.(f) (j)	0.00%	06/25/2023	ZAR 684	0	0.0
INFLATIONSGEKÜPTE WERTPAPIERE					
KOLUMBIEN					
Fideicomiso PA Costera	6.25%	01/15/2034	COP 18,690,784	4,606,396	0.0
Fideicomiso PA Pacifico Tres	7.00%	01/15/2035	97,872,936	21,881,146	0.2
				<u>26,487,542</u>	<u>0.2</u>
				<u>26,487,542</u>	<u>0.2</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %	
VORZUGSAKTIE						
INDUSTRIEGÜTER						
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
Exide International Holdings LP(j)	0.00%		21,353	\$ 18,427,639	0.1%	
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
INVESTITIONSGÜTER						
Regal Rexnord Corp.	6.30%	02/15/2030	USD	3,790	3,856,327	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Pilgrim's Pride Corp.	3.50%	03/01/2032		565	472,176	0.0
Smithfield Foods, Inc.	5.20%	04/01/2029		812	778,372	0.0
					1,250,548	0.0
ENERGIE						
Continental Resources, Inc./OK	2.88%	04/01/2032		6,611	5,309,216	0.0
Northern Natural Gas Co.	3.40%	10/16/2051		1,468	1,009,700	0.0
					6,318,916	0.0
					11,425,791	0.0
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
Lloyds Banking Group PLC(c)	6.00%	06/07/2032	GBP	4,459	5,272,463	0.0
REITs						
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	4.00%	01/15/2030	USD	858	772,094	0.0
					6,044,557	0.0
					17,470,348	0.0
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE						
QUASI-STAAATSANLEIHEN						
UKRAINE						
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(j)	7.65%	07/19/2025		9,551	7,378,379	0.1
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030		35,107	9,265,088	0.1
					16,643,467	0.2
ABS-ANLEIHEN						
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS						
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I						
Series 2019-24, Class PT.	10.37%	08/15/2044		184	178,522	0.0
Series 2019-36, Class PT.	12.08%	10/17/2044		432	421,394	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I,						
Series 2018-20, Class PT.	(25.37)%	11/16/2043		8	7,933	0.0
					607,849	0.0
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN						
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH						
Residential Asset Securitization Trust,						
Series 2007-A5, Class 2A3	6.00%	05/25/2037		967	487,366	0.0
					664,218,732	4.4
Gesamtanlagen						
(Kosten \$15,754,752,096)					\$ 14,395,849,346	98.5%
Termineinlagen						
ANZ, Hong Kong(l)	2.90 %	–			49,163	0.0
ANZ, London(l)	3.15 %	–			681,920	0.0
BNP Paribas, Paris(l)	2.58 %	–			109,765	0.0
BNP Paribas, Paris(l)	6.65 %	–			2,559,724	0.0
Citibank, New York(l)	4.68 %	–			176,250,850	1.2
HSBC, Hong Kong(l)	2.69 %	–			1,969,980	0.0
HSBC, London(l)	4.15 %	–			6,404,468	0.0
HSBC, Paris(l)	2.86 %	–			25,310,709	0.2
Scotiabank, Toronto(l)	3.83 %	–			11,877,226	0.1
Standard Chartered Bank, Johannesburg(l)	6.65 %	–			5,085,299	0.0
Termineinlagen insgesamt					230,299,104	1.5
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					(6,620,034)	0.0
Nettovermögen					\$ 14,619,528,416	100.0

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
U.S. Long Bond (CBT) Futures	06/18/2024	2,291	\$ 271,698,281	\$ 273,201,750	\$ 1,503,469
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	06/28/2024	605	123,802,852	123,873,750	70,898
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	06/28/2024	7,707	822,260,860	823,926,469	1,665,609
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Futures	06/18/2024	2,348	267,236,063	268,075,563	(839,500)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	06/18/2024	2,730	301,451,719	301,494,375	(42,656)
					\$ 2,357,820
				Wertsteigerung	\$ 3,239,976
				Wertminderung	\$ (882,156)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	EUR 9,216	USD 9,980	03/14/2024	\$ 15,860
Bank of America NA	CAD 19,000	USD 14,221	03/15/2024	218,914
Barclays Bank PLC	INR 1,111,024	USD 13,288	03/14/2024	(106,891)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 4,766	USD 3,121	03/04/2024	23,192
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 671,078	USD 435,966	03/04/2024	(234,845)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 253	USD 287	03/04/2024	1,250
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 80,966	USD 87,571	03/04/2024	63,575
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,536	USD 2,735	03/04/2024	(5,470)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 26	USD 33	03/04/2024	62
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 126,149	USD 76,839	03/04/2024	33,801
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 1,057	USD 642	03/04/2024	(1,273)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,072	AUD 9,349	03/04/2024	5,252
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 438,947	AUD 666,495	03/04/2024	(5,725,742)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 294	CHF 253	03/04/2024	(8,222)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,806	EUR 4,466	03/04/2024	21,160
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 85,742	EUR 79,035	03/04/2024	(320,769)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 28	GBP 22	03/04/2024	45
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5	GBP 4	03/04/2024	(24)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 184	NZD 303	03/04/2024	448
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 77,866	NZD 126,902	03/04/2024	(601,508)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,953	ZAR 133,933	03/04/2024	30,203
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 175,890	ZAR 3,309,315	03/04/2024	(3,349,656)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 112,757	USD 5,959	03/04/2024	80,079
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 3,330,492	USD 173,590	03/04/2024	(54,303)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 4,447	USD 2,913	03/11/2024	21,626
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 3,152	USD 2,048	03/11/2024	(1,789)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 1,140	USD 846	03/11/2024	5,537
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 0*	USD 0*	03/11/2024	(0)**
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 1,308	USD 182	03/11/2024	260
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 1,750	USD 242	03/11/2024	(671)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 7	USD 8	03/11/2024	10
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 9	USD 9	03/11/2024	(23)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 854	USD 1,080	03/11/2024	1,835
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 264	USD 331	03/11/2024	(1,606)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 1,121	USD 835	03/11/2024	1,130
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 147	USD 109	03/11/2024	(51)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 132	AUD 203	03/11/2024	80
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 478,439	AUD 732,636	03/11/2024	(2,125,721)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 7	CAD 9	03/11/2024	1
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 35,462	CAD 47,769	03/11/2024	(260,689)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,267	CNH 9,133	03/11/2024	980
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 33,272	CNH 239,259	03/11/2024	(50,484)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,054	EUR 1,905	03/11/2024	4,801
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 150	GBP 119	03/11/2024	105
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 59,531	GBP 47,147	03/11/2024	(15,258)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 75	SGD 101	03/11/2024	223
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 75,478	SGD 101,270	03/11/2024	(192,857)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,657	ZAR 70,580	03/11/2024	20,708
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 371,448	ZAR 7,046,818	03/11/2024	(4,258,434)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 4,848	USD 256	03/11/2024	3,347
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 21,118	USD 1,097	03/11/2024	(3,183)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 47,964	USD 52,385	03/14/2024	524,538
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3,728	USD 4,020	03/14/2024	(10,637)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 653	EUR 597	03/14/2024	(7,382)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 2,356	USD 1,546	03/25/2024	13,259

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 3,152	USD 2,048	03/25/2024	\$ (1,864)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 336	USD 249	03/25/2024	1,080
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 658	USD 92	03/25/2024	138
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 565	USD 612	03/25/2024	755
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 694	USD 878	03/25/2024	1,644
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 34	USD 8	03/25/2024	46
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 511	USD 381	03/25/2024	639
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 113	USD 84	03/25/2024	(25)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 43	AUD 66	03/25/2024	24
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 356,369	AUD 543,361	03/25/2024	(2,945,273)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 7	CAD 9	03/25/2024	1
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 33,665	CAD 45,517	03/25/2024	(115,226)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 645	CNH 4,646	03/25/2024	391
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 34,973	CNH 251,215	03/25/2024	(56,675)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 80,462	EUR 74,369	03/25/2024	(13,637)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0*	GBP 0*	03/25/2024	-
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 57,521	GBP 45,554	03/25/2024	(11,296)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,166	PLN 12,653	03/25/2024	2,137
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 8	PLN 31	03/25/2024	(17)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2	SGD 3	03/25/2024	1
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 69,739	SGD 93,618	03/25/2024	(96,451)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,256	ZAR 62,967	03/25/2024	20,556
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 214,759	ZAR 4,053,298	03/25/2024	(3,811,757)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 21,118	USD 1,096	03/25/2024	(3,167)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 3,152	USD 2,049	04/02/2024	(1,892)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 6	USD 7	04/02/2024	32
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 110	USD 120	04/02/2024	297
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 934	USD 569	04/02/2024	339
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 435,927	AUD 670,382	04/02/2024	232,913
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 287	CHF 252	04/02/2024	(1,235)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 85,920	EUR 79,346	04/02/2024	(58,116)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 33	GBP 26	04/02/2024	(64)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 76,617	NZD 125,778	04/02/2024	(35,009)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 173,590	ZAR 3,338,607	04/02/2024	41,339
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 21,118	USD 1,095	04/02/2024	(3,162)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 17,875	USD 22,694	04/19/2024	123,058
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,489	GBP 1,976	04/19/2024	6,648
Citibank NA	EUR 386,563	USD 419,274	03/14/2024	1,309,274
Goldman Sachs Bank USA	EUR 8,002	USD 8,662	03/14/2024	9,371
HSBC Bank USA	COP 159,104,554	USD 39,770	03/15/2024	(690,966)
Morgan Stanley & Co., LLC	GBP 46,773	USD 59,346	04/19/2024	288,166
Morgan Stanley & Co., LLC	USD 1,102	GBP 869	04/19/2024	(5,353)
NatWest Markets PLC	EUR 379,076	USD 417,009	03/14/2024	7,139,898
NatWest Markets PLC	GBP 5,903	USD 7,512	04/19/2024	58,335
				\$ (14,859,310)
			Wertsteigerung	\$ 10,329,363
			Wertminderung	\$ (25,188,673)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHYS41V2-5Y	12/20/2028	USD 884,913	\$ 56,197,785	\$ 51,090,471
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	ITRAXX-XOVERS40V1-5Y	12/20/2028	EUR 318,730	\$ 27,182,126	14,996,291
Insgesamt				\$ 83,379,911	\$ 66,086,762

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Kaufkontrakte						
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 15	\$ (14,741)	\$ (14,741)	\$ -
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 760	(95,922)	(95,368)	(554)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 553	(69,762)	(56,385)	(13,377)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(269,733)	(20,940)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,344	\$ (421,999)	\$ (331,393)	\$ (90,606)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,658	(209,284)	(163,340)	(45,944)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 9,011	(1,137,228)	(840,959)	(296,269)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 54,910	(6,929,635)	(4,788,529)	(2,141,106)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,382	(174,404)	(128,497)	(45,907)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,382	(174,404)	(127,633)	(46,771)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,900	(239,747)	(186,008)	(53,739)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,794	(352,644)	(288,989)	(63,655)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(504,066)	(77,279)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 40,423	(5,101,363)	(5,532,807)	431,444
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,090	(516,118)	(842,000)	325,882
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,090	(516,118)	(842,000)	325,882
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,045	(258,060)	(488,874)	230,814
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,045	(258,060)	(407,495)	149,435
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,910	(872,018)	(877,763)	5,745
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 15	12,881	12,892	(11)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 11,516	(1,453,363)	(1,444,012)	(9,351)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 978	(123,419)	(93,124)	(30,295)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,672)	(210,545)	(80,127)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,911	(493,620)	(369,773)	(123,847)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,991	(1,008,518)	(760,567)	(247,951)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 11,516	(1,453,363)	(1,559,889)	106,526
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,910	(872,018)	(938,022)	66,004
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 23,033	(2,906,726)	(2,953,058)	46,332
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(623,955)	42,610
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 9,213	(1,162,690)	(1,184,823)	22,133
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(583,740)	2,395
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(288,648)	(2,025)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,910	(872,018)	(865,943)	(6,075)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,672)	(220,199)	(70,473)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,240	(282,650)	(208,103)	(74,547)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(437,817)	(143,528)
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 10,224	(1,290,296)	(2,489,479)	1,199,183
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 10,224	(1,290,296)	(2,308,567)	1,018,271
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(578,928)	(2,417)
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 599	(75,575)	(71,047)	(4,528)
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 11,516	(1,453,363)	(1,403,348)	(50,015)
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,321	(671,570)	(488,247)	(183,323)
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 9,381	(1,183,910)	(905,175)	(278,735)
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,757	(1,105,137)	(811,397)	(293,740)
Insgesamt				<u>\$ (39,096,573)</u>	<u>\$ (38,572,094)</u>	<u>\$ (524,479)</u>
					Wertsteigerung	\$ 3,972,656
					Wertminderung	\$ (4,497,135)
Swaps insgesamt						<u>\$ 65,562,283</u>

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

** Betrag kleiner als 0,50.

(a) Zahlungen in Sachwerten (PIK).

(b) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 29. Februar 2024.

(c) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.

(d) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 29. Februar 2024.

(e) Not leidend.

(f) Not leidendes fälliges Wertpapier.

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

(h) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.

(i) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.

(j) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.

(k) Wandelbares Wertpapier.

(l) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	– Australian Dollar
CAD	– Canadian Dollar
CHF	– Swiss Franc
CNH	– Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
COP	– Colombian Peso
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
INR	– Indian Rupee
NZD	– New Zealand Dollar
PLN	– Polish Zloty
SGD	– Singapore Dollar
USD	– United States Dollar
ZAR	– South African Rand

Glossar:

ABS	– Asset-Backed Securities
CAB	– Capital Appreciation Bond
CBT	– Chicago Board of Trade
CDX-CMBX.NA.	– North American Commercial Mortgage-Backed Index
CLO	– Collateralized Loan Obligations
CMBS	– Commercial Mortgage-Backed Securities
INTRCONX	– Intercontinental Exchange
IRB	– Industrial Revenue Bond
JSC	– Joint Stock Company
LP	– Limited Partnership
REIT	– Real Estate Investment Trust
REMICS	– Real Estate Mortgage Investment Conduits

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	4.38%	08/15/2043	USD 180,000	\$ 176,146,884	0.7%
U.S. Treasury Bonds(a)	6.13%	11/15/2027	344,064	363,740,583	1.5
U.S. Treasury Bonds(a)	6.13%	08/15/2029	537,115	582,937,081	2.4
U.S. Treasury Bonds	6.25%	05/15/2030	747,077	824,119,536	3.4
U.S. Treasury Bonds	6.75%	08/15/2026	13,643	14,301,596	0.1
U.S. Treasury Bonds	7.63%	02/15/2025	217,311	222,981,162	0.9
U.S. Treasury Notes	3.50%	01/31/2028	73,465	71,215,231	0.3
U.S. Treasury Notes	3.50%	02/15/2033	253,950	239,427,234	1.0
U.S. Treasury Notes	3.75%	12/31/2028	221,000	215,854,855	0.9
U.S. Treasury Notes	3.88%	08/15/2033	51,839	50,259,528	0.2
U.S. Treasury Notes	4.00%	02/29/2028	474,600	468,519,187	2.0
U.S. Treasury Notes(a)	4.13%	10/31/2027	196,283	194,595,787	0.8
U.S. Treasury Notes	4.13%	07/31/2028	652,294	647,401,497	2.7
U.S. Treasury Notes	4.38%	11/30/2028	210,000	210,787,500	0.9
U.S. Treasury Notes	4.50%	11/15/2033	83,700	85,243,219	0.3
U.S. Treasury Notes(a)	4.63%	06/30/2025	283,120	282,146,576	1.2
U.S. Treasury Notes	4.63%	09/30/2028	251,450	254,711,005	1.1
U.S. Treasury Notes	4.75%	07/31/2025	101,908	101,764,397	0.4
U.S. Treasury Notes	4.88%	11/30/2025	229,263	229,764,813	1.0
U.S. Treasury Notes	4.88%	10/31/2028	363,839	372,537,213	1.6
U.S. Treasury Notes	5.00%	10/31/2025	69,459	69,708,622	0.3
				<u>5,678,163,506</u>	<u>23.7</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Arsenal AIC Parent LLC	8.00%	10/01/2030	7,635	7,997,096	0.0
ASP Unifrax Holdings, Inc.	5.25%	09/30/2028	21,002	13,316,318	0.1
Axalta Coating Systems LLC	3.38%	02/15/2029	2,000	1,778,077	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	1,879	1,894,538	0.0
CVR Partners LP/CVR Nitrogen Finance Corp.	6.13%	06/15/2028	31,221	29,565,170	0.1
Element Solutions, Inc.	3.88%	09/01/2028	11,512	10,440,110	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031	9,000	8,053,546	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	7,573	7,271,059	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	5.88%	04/15/2030	1,000	979,879	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	6.13%	04/15/2032	49,506	48,911,498	0.2
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027	4,299	4,168,139	0.0
INEOS Finance PLC	7.50%	04/15/2029	44,002	43,842,309	0.2
INEOS Quattro Finance 2 PLC	9.63%	03/15/2029	18,715	19,711,486	0.1
Ingevity Corp.	3.88%	11/01/2028	4,000	3,529,207	0.0
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./ Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	27,796	25,877,761	0.1
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	5.38%	11/01/2026	32,671	31,741,109	0.1
WR Grace Holdings LLC	4.88%	06/15/2027	26,475	25,198,780	0.1
				<u>284,276,082</u>	<u>1.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	6.00%	06/15/2027	3,559	3,487,820	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.13%	08/15/2026	4,000	3,697,799	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	04/30/2025	27,033	26,661,296	0.1
Ball Corp.	2.88%	08/15/2030	1,000	846,451	0.0
Ball Corp.	6.00%	06/15/2029	19,332	19,436,154	0.1
Bombardier, Inc.	6.00%	02/15/2028	1,678	1,628,641	0.0
Bombardier, Inc.	7.50%	02/01/2029	4,855	4,924,662	0.0
Bombardier, Inc.	8.75%	11/15/2030	6,000	6,287,634	0.0
Chart Industries, Inc.	7.50%	01/01/2030	9,186	9,477,441	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	4,501	4,325,638	0.0
Clean Harbors, Inc.	6.38%	02/01/2031	4,620	4,594,846	0.0
Crown Americas LLC	5.25%	04/01/2030	2,237	2,154,669	0.0
Eco Material Technologies, Inc.	7.88%	01/31/2027	19,423	19,451,463	0.1
EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer, Inc.	6.63%	12/15/2030	12,755	12,796,130	0.1
EnerSys	6.63%	01/15/2032	11,317	11,356,657	0.1
GFL Environmental, Inc.	3.50%	09/01/2028	1,000	906,213	0.0
GFL Environmental, Inc.	4.00%	08/01/2028	2,000	1,831,840	0.0
GFL Environmental, Inc.	6.75%	01/15/2031	5,344	5,467,581	0.0
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	41,527	40,201,371	0.2
LSB Industries, Inc.	6.25%	10/15/2028	18,127	17,181,638	0.1
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	6,000	5,618,588	0.0
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	19,218	20,179	0.0
Rolls-Royce PLC	3.63%	10/14/2025	2,000	1,934,471	0.0
Rolls-Royce PLC	5.75%	10/15/2027	2,000	1,994,184	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Stericycle, Inc.	3.88%	01/15/2029	USD 2,000	\$ 1,808,112	0.0%
TK Elevator US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	23,985	23,034,282	0.1
WESCO Distribution, Inc.	6.38%	03/15/2029	11,398	11,412,404	0.1
WESCO Distribution, Inc.	6.63%	03/15/2032	11,252	11,260,725	0.1
WESCO Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	8,093	8,276,392	0.0
				<u>262,075,281</u>	<u>1.1</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	13,968	13,001,997	0.1
Altice Financing SA.	5.00%	01/15/2028	20,147	17,830,052	0.1
Altice Financing SA.	5.75%	08/15/2029	21,913	18,838,852	0.1
AMC Networks, Inc.	4.75%	08/01/2025	16,866	16,082,772	0.1
Banjay Entertainment SASU.	8.13%	05/01/2029	14,465	14,959,155	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	10,354	8,588,693	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033	63,959	49,219,904	0.2
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	02/01/2032	10,382	8,381,287	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	7.38%	03/01/2031	17,363	16,815,610	0.1
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	35,171	32,893,621	0.1
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	9.00%	09/15/2028	2,000	2,085,827	0.0
CSC Holdings LLC.	3.38%	02/15/2031	7,991	5,637,868	0.0
CSC Holdings LLC.	6.50%	02/01/2029	4,724	4,114,663	0.0
CSC Holdings LLC.	11.25%	05/15/2028	13,685	14,121,140	0.1
CSC Holdings LLC.	11.75%	01/31/2029	16,200	16,958,407	0.1
DISH DBS Corp.	5.25%	12/01/2026	32,078	25,619,261	0.1
DISH DBS Corp.	5.75%	12/01/2028	28,439	19,693,864	0.1
Gray Television, Inc.	5.38%	11/15/2031	33,666	21,799,323	0.1
LCPR Senior Secured Financing DAC.	5.13%	07/15/2029	32,037	26,918,055	0.1
LCPR Senior Secured Financing DAC.	6.75%	10/15/2027	25,707	24,291,588	0.1
McGraw-Hill Education, Inc.	5.75%	08/01/2028	44,071	41,250,526	0.2
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	4,101	2,965,078	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	09/01/2031	7,492	6,202,934	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	4.00%	07/15/2028	16,373	14,761,397	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	5.00%	08/01/2027	16,685	15,927,681	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	23,804	22,517,234	0.1
Summer BC Bidco B LLC.	5.50%	10/31/2026	700	678,030	0.0
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	12,302	10,773,914	0.1
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	27,939	27,085,496	0.1
Univision Communications, Inc.	7.38%	06/30/2030	16,494	15,930,154	0.1
Univision Communications, Inc.	8.00%	08/15/2028	8,891	8,936,646	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC.	4.50%	08/15/2030	2,646	2,311,789	0.0
VZ Secured Financing BV.	5.00%	01/15/2032	2,000	1,707,564	0.0
Ziggo Bond Co. BV.	5.13%	02/28/2030	794	679,099	0.0
Ziggo BV.	4.88%	01/15/2030	30,031	26,763,065	0.1
				<u>556,342,546</u>	<u>2.5</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France SA/France.	5.13%	07/15/2029	6,590	4,988,875	0.0
Altice France SA/France.	5.50%	01/15/2028	2,919	2,379,929	0.0
Altice France SA/France.	5.50%	10/15/2029	10,431	7,900,811	0.0
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC.	6.75%	10/01/2026	9,373	9,200,609	0.0
Iliad Holding SASU.	6.50%	10/15/2026	14,216	14,080,323	0.1
Telecom Italia Capital SA.	7.20%	07/18/2036	12,850	12,781,873	0.1
Telecom Italia Capital SA.	7.72%	06/04/2038	7,678	7,846,048	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC.	4.25%	01/31/2031	11,640	9,892,514	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC.	4.75%	07/15/2031	6,675	5,770,737	0.0
				<u>74,841,719</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	4,888	4,821,679	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	10,159	9,810,921	0.0
Dana, Inc.	4.25%	09/01/2030	5,591	4,826,579	0.0
Dana, Inc.	4.50%	02/15/2032	8,098	6,794,185	0.0
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	12,089	11,727,970	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co. (The).	5.00%	07/15/2029	2,698	2,483,849	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The).	5.25%	07/15/2031	10,523	9,494,610	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(b).	6.00%	05/15/2027	23,494	23,163,673	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(b).	6.38%	05/15/2029	12,577	12,403,747	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC.	4.50%	10/01/2027	1,000	940,009	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC.	5.50%	07/15/2029	22,261	21,470,211	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC.	5.88%	01/15/2028	20,920	20,597,609	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC.	7.75%	10/15/2025	34,461	34,678,690	0.2
Tenneco, Inc.	8.00%	11/17/2028	25,891	23,601,204	0.1
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	14,495	14,272,784	0.1
ZF North America Capital, Inc.	6.88%	04/14/2028	10,273	10,482,301	0.0
ZF North America Capital, Inc.	7.13%	04/14/2030	19,577	20,353,890	0.1
				<u>231,923,911</u>	<u>1.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	4.00%	08/01/2028	USD 15,272	\$ 14,087,183	0.1%
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	58,296	57,588,712	0.2
Cedar Fair LP	5.25%	07/15/2029	9,350	8,824,982	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.38%	04/15/2027	2,000	1,978,828	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.50%	05/01/2025	52,796	52,626,502	0.2
Merlin Entertainments Group US Holdings, Inc.	7.38%	02/15/2031	26,210	26,219,804	0.1
NCL Corp., Ltd.	8.13%	01/15/2029	15,422	16,248,657	0.1
NCL Corp., Ltd.	8.38%	02/01/2028	27,665	29,059,561	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.38%	07/15/2027	18,007	17,681,764	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	08/31/2026	15,060	14,893,979	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	15,887	15,636,824	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	6.25%	03/15/2032	17,039	17,085,005	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	7.25%	01/15/2030	6,586	6,846,766	0.0
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	5.25%	08/15/2029	21,109	19,686,561	0.1
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	8,044	8,067,387	0.0
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd.	5.63%	02/15/2029	9,267	8,986,123	0.0
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	62,894	60,205,890	0.3
				<u>375,724,528</u>	<u>1.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	3,391	3,385,433	0.0
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025	500	499,767	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	15,093	13,412,979	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	49,014	47,625,553	0.2
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	06/15/2032	5,000	5,005,659	0.0
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	03/01/2034	27,881	27,815,937	0.1
Caesars Entertainment, Inc.	6.50%	02/15/2032	8,890	8,957,757	0.0
Caesars Entertainment, Inc.	7.00%	02/15/2030	8,522	8,732,888	0.0
Churchill Downs, Inc.	4.75%	01/15/2028	9,717	9,189,742	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	3.63%	02/15/2032	2,000	1,708,561	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	5.00%	06/01/2029	40,655	37,683,905	0.2
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	6.63%	01/15/2032	25,918	25,919,834	0.1
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	5,196	5,105,184	0.0
KB Home	4.80%	11/15/2029	2,965	2,796,549	0.0
KB Home	6.88%	06/15/2027	4,102	4,230,574	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	4.50%	06/15/2029	18,380	16,670,717	0.1
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	22,478	20,176,492	0.1
Mattamy Group Corp.	5.25%	12/15/2027	2,000	1,925,920	0.0
MGM Resorts International.	4.75%	10/15/2028	6,606	6,199,710	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	9,959	9,822,947	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	17,629	17,582,142	0.1
Travel & Leisure Co.	4.50%	12/01/2029	33,341	30,580,093	0.1
Travel & Leisure Co.	4.63%	03/01/2030	3,108	2,805,775	0.0
Travel & Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	26,289	26,559,175	0.1
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	11,291	11,025,301	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	13,465	12,712,492	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.13%	02/15/2031	6,200	6,401,340	0.0
				<u>364,532,426</u>	<u>1.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Arko Corp.	5.13%	11/15/2029	11,996	10,396,896	0.0
Asbury Automotive Group, Inc.	5.00%	02/15/2032	16,593	14,765,383	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.63%	10/01/2030	16,754	16,858,440	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.75%	07/01/2036	29,820	29,368,984	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.95%	03/01/2033	329	320,329	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.50%	06/15/2029	7,154	7,367,410	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.60%	07/15/2037	716	698,302	0.0
Beacon Roofing Supply, Inc.	6.50%	08/01/2030	7,997	8,041,927	0.0
FirstCash, Inc.	4.63%	09/01/2028	8,381	7,755,432	0.0
FirstCash, Inc.	5.63%	01/01/2030	21,733	20,589,383	0.1
FirstCash, Inc.	6.88%	03/01/2032	19,962	19,781,055	0.1
Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd.	8.38%	01/15/2029	15,200	14,555,446	0.1
Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd.	8.75%	01/15/2032	15,271	14,521,598	0.1
Group 1 Automotive, Inc.	4.00%	08/15/2028	6,398	5,845,503	0.0
LCM Investments Holdings II LLC.	8.25%	08/01/2031	16,251	16,637,936	0.1
Levi Strauss & Co.	3.50%	03/01/2031	23,739	20,579,063	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	3.75%	02/15/2031	2,611	2,238,629	0.0
Murphy Oil USA, Inc.	4.75%	09/15/2029	11,452	10,779,872	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	36,696	34,371,170	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Sonic Automotive, Inc.	4.63%	11/15/2029	USD 33,819	\$ 29,885,834	0.1%
Sonic Automotive, Inc.	4.88%	11/15/2031	15,691	13,488,280	0.1
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	10,386	10,219,373	0.0
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	31,586	30,325,076	0.1
				<u>339,391,321</u>	<u>1.4</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC.	5.13%	03/01/2030	6,500	5,436,882	0.0
AdaptHealth LLC.	6.13%	08/01/2028	6,613	6,082,535	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	3.50%	03/15/2029	1,000	890,504	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	4.88%	02/15/2030	15,673	14,709,590	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	6.50%	02/15/2028	19,604	19,728,366	0.1
Amer Sports Co.	6.75%	02/16/2031	20,688	20,596,323	0.1
Bausch & Lomb Corp.	8.38%	10/01/2028	57,913	60,597,010	0.3
DaVita, Inc.	3.75%	02/15/2031	33,188	27,227,147	0.1
DaVita, Inc.	4.63%	06/01/2030	38,715	34,048,568	0.1
Elanco Animal Health, Inc.	6.65%	08/28/2028	21,340	21,615,123	0.1
Embecta Corp.	5.00%	02/15/2030	17,080	13,606,282	0.1
Fortrea Holdings, Inc.	7.50%	07/01/2030	13,325	13,626,570	0.1
Grifols SA	4.75%	10/15/2028	3,353	2,778,432	0.0
IQVIA, Inc.	6.50%	05/15/2030	5,829	5,912,792	0.0
Jazz Securities DAC	4.38%	01/15/2029	3,465	3,180,715	0.0
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	5.00%	12/31/2026	33,210	32,044,174	0.1
Medline Borrower LP	3.88%	04/01/2029	69,912	62,669,562	0.3
ModivCare Escrow Issuer, Inc.	5.00%	10/01/2029	4,163	3,069,010	0.0
Neogen Food Safety Corp.	8.63%	07/20/2030	10,941	11,639,688	0.1
Newell Brands, Inc.	6.38%	09/15/2027	4,430	4,303,413	0.0
Newell Brands, Inc.	6.63%	09/15/2029	16,159	15,468,140	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	4.13%	04/30/2028	18,538	16,947,703	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	5.13%	04/30/2031	46,269	39,608,646	0.2
Performance Food Group, Inc.	4.25%	08/01/2029	23,122	20,992,439	0.1
Perrigo Finance Unlimited Co.	4.65%	06/15/2030	3,000	2,693,959	0.0
Post Holdings, Inc.	4.50%	09/15/2031	8,368	7,445,142	0.0
Post Holdings, Inc.	4.63%	04/15/2030	5,000	4,541,842	0.0
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	6,547	6,251,778	0.0
Post Holdings, Inc.	6.25%	02/15/2032	10,198	10,249,147	0.0
Primo Water Holdings, Inc.	4.38%	04/30/2029	6,000	5,446,880	0.0
Spectrum Brands, Inc.	3.88%	03/15/2031	1,125	1,068,604	0.0
US Acute Care Solutions LLC.	6.38%	03/01/2026	9,491	8,591,147	0.0
US Foods, Inc.	4.75%	02/15/2029	1,000	938,465	0.0
				<u>504,006,578</u>	<u>2.1</u>
ENERGIE					
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp. .	5.38%	06/15/2029	2,000	1,903,381	0.0
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp. .	5.75%	01/15/2028	1,000	980,242	0.0
Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026	3,175	3,116,606	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	11,064	11,164,681	0.1
Buckeye Partners LP	4.13%	03/01/2025	5,167	5,079,845	0.0
Buckeye Partners LP	4.50%	03/01/2028	1,000	935,204	0.0
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	13,237	13,322,267	0.1
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	45,862	45,785,853	0.2
CITGO Petroleum Corp.	8.38%	01/15/2029	19,204	20,157,406	0.1
Civitas Resources, Inc.	5.00%	10/15/2026	4,730	4,591,895	0.0
Civitas Resources, Inc.	8.38%	07/01/2028	25,184	26,354,226	0.1
Civitas Resources, Inc.	8.63%	11/01/2030	7,764	8,314,548	0.0
Civitas Resources, Inc.	8.75%	07/01/2031	26,590	28,304,041	0.1
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	19,026	18,356,013	0.1
CNX Resources Corp.	7.25%	03/01/2032	17,041	16,993,772	0.1
CNX Resources Corp.	7.38%	01/15/2031	1,000	1,008,859	0.0
Comstock Resources, Inc.	5.88%	01/15/2030	2,995	2,618,895	0.0
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC	5.50%	06/15/2031	16,660	15,528,585	0.1
Crescent Energy Finance LLC.	7.25%	05/01/2026	15,590	15,533,176	0.1
Crescent Energy Finance LLC.	9.25%	02/15/2028	5,531	5,790,695	0.0
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8.50%	05/01/2028	12,292	12,274,770	0.1
EQM Midstream Partners LP.	4.75%	01/15/2031	18,166	16,905,559	0.1
EQM Midstream Partners LP.	6.38%	04/01/2029	9,276	9,304,552	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.25%	05/15/2026	2,159	2,139,365	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	34,229	34,236,140	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	17,227	17,349,419	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	11,607	11,440,911	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	7,835	7,842,064	0.0
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	8.25%	01/15/2032	10,805	11,083,769	0.1
Hess Midstream Operations LP.	5.13%	06/15/2028	1,000	961,377	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	USD 5,408	\$ 5,265,041	0.0%
ITT Holdings LLC	6.50%	08/01/2029	36,137	32,252,607	0.1
Nabors Industries, Inc.	7.38%	05/15/2027	17,675	17,605,302	0.1
Nabors Industries, Inc.	9.13%	01/31/2030	8,593	8,805,226	0.0
New Fortress Energy, Inc.	6.50%	09/30/2026	49,714	47,922,758	0.2
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	24,562	24,437,840	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	8.13%	02/15/2029	27,704	27,972,789	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	8.38%	02/15/2032	26,880	27,317,163	0.1
NuStar Logistics LP.	6.38%	10/01/2030	4,368	4,382,225	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	7.88%	09/15/2030	2,000	2,043,737	0.0
Southwestern Energy Co.	5.38%	02/01/2029	3,267	3,159,966	0.0
Summit Midstream Holdings LLC/ Summit Midstream Finance Corp.	9.00%	10/15/2026	14,264	14,178,491	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	7.00%	09/15/2028	1,000	1,023,805	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC	3.88%	11/01/2033	7,231	6,067,242	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC	4.13%	08/15/2031	7,790	6,838,548	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC	6.25%	01/15/2030	13,126	13,123,444	0.1
Venture Global LNG, Inc.	8.13%	06/01/2028	27,783	28,243,520	0.1
Venture Global LNG, Inc.	8.38%	06/01/2031	23,140	23,408,825	0.1
Venture Global LNG, Inc.	9.50%	02/01/2029	12,494	13,322,421	0.1
Venture Global LNG, Inc.	9.88%	02/01/2032	12,438	13,093,381	0.1
				<u>689,842,447</u>	<u>3.0</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	4.00%	01/15/2028	3,000	2,798,518	0.0
Ritchie Bros Holdings, Inc.	6.75%	03/15/2028	9,174	9,388,445	0.0
Ritchie Bros Holdings, Inc.	7.75%	03/15/2031	10,375	10,900,748	0.1
				<u>23,087,711</u>	<u>0.1</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The)	4.13%	08/01/2029	10,380	9,413,200	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ...	6.63%	07/15/2026	12,578	12,538,889	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.63%	06/01/2028	70,335	62,428,672	0.3
APX Group, Inc.	5.75%	07/15/2029	3,000	2,851,110	0.0
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	37,297	37,359,821	0.2
Aramark Services, Inc.	5.00%	02/01/2028	5,261	5,047,604	0.0
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	13,634	13,200,087	0.1
Garda World Security Corp.	4.63%	02/15/2027	13,000	12,424,641	0.1
Garda World Security Corp.	7.75%	02/15/2028	31,801	32,367,223	0.1
Millennium Escrow Corp.	6.63%	08/01/2026	24,610	14,683,985	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.50%	09/01/2028	34,619	30,206,671	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	16,132	12,864,711	0.1
Neptune Bidco US, Inc.	9.29%	04/15/2029	44,194	41,579,489	0.2
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	3.38%	08/31/2027	1,000	916,086	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024	1,264	1,261,642	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	12,000	11,911,661	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	61,461	60,637,522	0.3
Wand NewCo 3, Inc.	7.63%	01/30/2032	19,386	19,941,587	0.1
ZipRecruiter, Inc.	5.00%	01/15/2030	16,847	14,839,672	0.1
				<u>396,474,273</u>	<u>2.0</u>
TECHNOLOGIE					
Entegris, Inc.	5.95%	06/15/2030	12,650	12,404,962	0.1
Gen Digital, Inc.	5.00%	04/15/2025	1,000	990,063	0.0
Gen Digital, Inc.	6.75%	09/30/2027	26,207	26,365,427	0.1
Gen Digital, Inc.	7.13%	09/30/2030	22,433	22,916,338	0.1
GoTo Group, Inc.	5.50%	05/01/2028	305	215,657	0.0
Playtika Holding Corp.	4.25%	03/15/2029	5,108	4,360,883	0.0
Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027	14,559	13,987,072	0.1
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	7,300	6,662,960	0.0
Seagate HDD Cayman	5.75%	12/01/2034	3,000	2,875,690	0.0
Seagate HDD Cayman	8.25%	12/15/2029	21,529	23,031,224	0.1
Seagate HDD Cayman	8.50%	07/15/2031	32,166	34,734,959	0.2
Sensata Technologies BV	5.88%	09/01/2030	10,263	10,009,130	0.0
Western Digital Corp.	4.75%	02/15/2026	5,263	5,148,179	0.0
				<u>163,702,544</u>	<u>0.7</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Allegiant Travel Co.	7.25%	08/15/2027	10,577	10,318,858	0.0
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	7,195	7,129,782	0.0
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	18,211	17,808,873	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	7,301	6,875,188	0.0
				<u>42,132,701</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	6.13%	10/15/2026	USD 19,507	\$ 19,204,956	0.1%
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	4.75%	04/01/2028	17,737	16,058,264	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	20,279	18,464,585	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	5,000	4,763,396	0.0
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	8.00%	02/15/2031	7,175	6,932,081	0.0
PROG Holdings, Inc.	6.00%	11/15/2029	16,432	15,109,103	0.1
				<u>80,532,385</u>	<u>0.4</u>
				<u>4,388,886,453</u>	<u>18.6</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Bread Financial Holdings, Inc.	7.00%	01/15/2026	2,602	2,615,622	0.0
Bread Financial Holdings, Inc.	9.75%	03/15/2029	36,787	37,639,272	0.2
				<u>40,254,894</u>	<u>0.2</u>
MAKLER					
AG TTMT Escrow Issuer LLC	8.63%	09/30/2027	28,521	29,366,967	0.1
Aretec Group, Inc.	10.00%	08/15/2030	16,495	17,963,457	0.1
NFP Corp.	7.50%	10/01/2030	17,419	18,330,958	0.1
				<u>65,661,382</u>	<u>0.3</u>
FINANZEN					
Castlelake Aviation Finance DAC	5.00%	04/15/2027	10,524	9,998,814	0.0
GGAM Finance Ltd.	7.75%	05/15/2026	15,162	15,430,367	0.1
GGAM Finance Ltd.	8.00%	02/15/2027	10,511	10,807,296	0.1
GGAM Finance Ltd.	8.00%	06/15/2028	32,741	33,893,139	0.1
goeasy Ltd.	7.63%	07/01/2029	17,561	17,552,865	0.1
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	5.00%	08/15/2028	35,186	31,676,983	0.1
Navient Corp.	4.88%	03/15/2028	9,250	8,444,665	0.0
Navient Corp.	5.00%	03/15/2027	6,824	6,476,810	0.0
SLM Corp.	3.13%	11/02/2026	3,939	3,628,859	0.0
Synchrony Financial	7.25%	02/02/2033	5,796	5,650,178	0.0
				<u>143,559,976</u>	<u>0.5</u>
VERSICHERUNGEN					
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	4.25%	02/15/2029	2,195	1,947,102	0.0
AmWINS Group, Inc.	6.38%	02/15/2029	9,432	9,436,303	0.0
Ardonagh Finco Ltd.	7.75%	02/15/2031	14,713	14,654,482	0.1
Howden UK Refinance PLC/ Howden UK Refinance 2 PLC/Howden US Refinance LLC ...	7.25%	02/15/2031	23,618	23,669,800	0.1
HUB International Ltd.	7.25%	06/15/2030	43,226	44,141,756	0.2
				<u>93,849,443</u>	<u>0.4</u>
REITs					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sello LL	4.50%	04/01/2027	14,789	13,022,984	0.1
Brookfield Property REIT, Inc./ BPR Cumulus LLC/BPR Nimbus LLC/GGSI Sello LL	5.75%	05/15/2026	9,735	9,393,247	0.0
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029	10,460	9,728,271	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	10,020	9,477,068	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	12,339	11,886,026	0.1
				<u>53,507,596</u>	<u>0.2</u>
				<u>396,833,291</u>	<u>1.6</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Calpine Corp.	5.13%	03/15/2028	21,905	20,782,440	0.1
NRG Energy, Inc.	3.38%	02/15/2029	1,000	873,813	0.0
NRG Energy, Inc.	3.88%	02/15/2032	2,436	2,045,524	0.0
Terraform Global Operating LP.	6.13%	03/01/2026	7,871	7,792,991	0.0
Vistra Corp.(c)	7.00%	12/15/2026	16,102	15,574,249	0.1
Vistra Corp.(c)	8.00%	10/15/2026	19,514	19,514,949	0.1
Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	18,523	18,066,251	0.1
Vistra Operations Co. LLC	7.75%	10/15/2031	2,000	2,069,493	0.0
				<u>86,719,710</u>	<u>0.4</u>
ERDGAS					
AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finance Corp.	5.75%	05/20/2027	3,557	3,362,939	0.0
AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finance Corp.	5.88%	08/20/2026	2,650	2,568,445	0.0
				<u>5,931,384</u>	<u>0.0</u>
				<u>92,651,094</u>	<u>0.4</u>
				<u>4,878,370,838</u>	<u>20.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
AngloGold Ashanti Holdings PLC	3.38%	11/01/2028	USD 11,222	\$ 10,049,301	0.0%
Celanese US Holdings LLC	6.55%	11/15/2030	23,754	24,650,495	0.1
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034	367	355,596	0.0
Glencore Funding LLC	5.40%	05/08/2028	30,388	30,506,255	0.1
Glencore Funding LLC	6.38%	10/06/2030	33,738	35,440,454	0.2
Huntsman International LLC	4.50%	05/01/2029	13,936	13,239,703	0.1
MEGlobal Canada ULC	5.00%	05/18/2025	5,875	5,805,969	0.0
MEGlobal Canada ULC	5.88%	05/18/2030	3,112	3,142,964	0.0
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	26,838	26,292,424	0.1
Rohm & Haas Co.	7.85%	07/15/2029	16,500	18,320,034	0.1
				<u>167,803,195</u>	<u>0.7</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Charter Communications Operating LLC/ Charter Communications Operating Capital	6.15%	11/10/2026	6,231	6,292,801	0.0
DIRECTV Financing LLC	8.88%	02/01/2030	26,286	26,470,653	0.1
DIRECTV Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor, Inc.	5.88%	08/15/2027	28,188	26,624,914	0.1
Paramount Global	4.95%	01/15/2031	20,000	17,513,119	0.1
Time Warner Cable Enterprises LLC	8.38%	07/15/2033	15,020	16,657,059	0.1
Warnermedia Holdings, Inc.	4.28%	03/15/2032	19,532	17,237,759	0.1
				<u>110,796,305</u>	<u>0.5</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	2.25%	02/01/2032	889	712,944	0.0
AT&T, Inc.	2.55%	12/01/2033	16,126	12,716,006	0.1
AT&T, Inc.	4.50%	05/15/2035	15,834	14,569,652	0.1
AT&T, Inc.	5.40%	02/15/2034	22,352	22,381,786	0.1
AT&T, Inc.	7.13%	12/15/2031	3,042	3,273,787	0.0
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	4.74%	03/20/2025	4,452	4,416,706	0.0
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	5.15%	03/20/2028	7,769	7,728,493	0.0
				<u>65,799,374</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Ford Motor Co.	3.25%	02/12/2032	63,414	52,055,967	0.2
Ford Motor Co.	6.10%	08/19/2032	26,823	26,749,207	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	6.05%	03/05/2031	20,370	20,278,155	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	6.80%	05/12/2028	9,926	10,244,778	0.0
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	7,450	7,477,281	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	2.35%	01/08/2031	11,552	9,414,247	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	2.70%	06/10/2031	37,715	31,032,380	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	3.60%	06/21/2030	5,775	5,179,172	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.75%	02/08/2031	12,430	12,394,294	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	5.80%	06/23/2028	28,660	29,071,438	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	5.80%	01/07/2029	21,015	21,292,377	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.05%	02/14/2027	27,594	25,854,538	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	10,525	10,167,198	0.0
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	6.50%	03/10/2028	46,611	47,815,595	0.2
Hyundai Capital America	2.00%	06/15/2028	7,146	6,257,300	0.0
Hyundai Capital America	5.25%	01/08/2027	14,359	14,312,433	0.1
Hyundai Capital America	5.30%	01/08/2029	5,855	5,843,070	0.0
Hyundai Capital America	5.68%	06/26/2028	46,933	47,552,841	0.2
Hyundai Capital America	6.20%	09/21/2030	6,489	6,778,475	0.0
Hyundai Capital America	6.50%	01/16/2029	17,068	17,872,512	0.1
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	7,020	6,273,363	0.0
Lear Corp.	4.25%	05/15/2029	2,000	1,903,102	0.0
Nissan Motor Acceptance Co. LLC	1.85%	09/16/2026	799	719,424	0.0
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	20,699	19,681,188	0.1
Nissan Motor Co., Ltd.	4.81%	09/17/2030	728	670,470	0.0
				<u>436,890,805</u>	<u>1.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Hasbro, Inc.	3.90%	11/19/2029	16,713	15,335,385	0.1
Mattel, Inc.	3.75%	04/01/2029	10,407	9,501,465	0.0
Mattel, Inc.	5.45%	11/01/2041	8,681	7,876,989	0.0
				<u>32,713,839</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Genting New York LLC/GENNY Capital, Inc.	3.30%	02/15/2026	17,897	16,600,144	0.1
International Game Technology PLC	5.25%	01/15/2029	3,337	3,227,593	0.0
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	35,757	35,813,488	0.2
MDC Holdings, Inc.	2.50%	01/15/2031	7,000	5,914,793	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	3,723	3,710,008	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	USD 1,449	\$ 1,609,477	0.0%
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	6,352	6,716,282	0.0
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/16/2029	1,700	1,533,978	0.0
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/06/2031	20,600	17,629,422	0.1
				<u>92,755,185</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
AutoNation, Inc.	3.85%	03/01/2032	10,000	8,727,258	0.0
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	04/01/2029	15,172	14,616,519	0.1
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	03/15/2030	4,040	3,787,520	0.0
Ross Stores, Inc.	4.70%	04/15/2027	14,291	13,973,957	0.1
Tapestry, Inc.	7.70%	11/27/2030	30,569	32,474,301	0.1
Tapestry, Inc.	7.85%	11/27/2033	8,017	8,674,059	0.0
				<u>82,253,614</u>	<u>0.3</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Altria Group, Inc.	2.45%	02/04/2032	14,769	11,822,152	0.1
Altria Group, Inc.	4.80%	02/14/2029	25,806	25,347,341	0.1
BAT Capital Corp.	4.91%	04/02/2030	1,500	1,457,106	0.0
BAT Capital Corp.	6.42%	08/02/2033	19,040	19,542,417	0.1
BAT Capital Corp.	7.75%	10/19/2032	11,741	13,091,908	0.1
BAT International Finance PLC.	4.45%	03/16/2028	36,222	34,935,929	0.1
Bayer US Finance LLC	6.13%	11/21/2026	11,177	11,244,121	0.1
Charles River Laboratories International, Inc.	4.25%	05/01/2028	2,000	1,876,187	0.0
Cigna Group (The)	5.13%	05/15/2031	11,111	10,984,895	0.0
HCA, Inc.	5.45%	04/01/2031	16,132	16,056,644	0.1
IQVIA, Inc.	6.25%	02/01/2029	23,393	24,067,643	0.1
Philip Morris International, Inc.	5.50%	09/07/2030	68,020	68,627,527	0.3
Philip Morris International, Inc.	5.63%	11/17/2029	13,881	14,214,123	0.1
Pilgrim's Pride Corp.	4.25%	04/15/2031	6,202	5,541,106	0.0
Smithfield Foods, Inc.	3.00%	10/15/2030	4,774	3,923,981	0.0
				<u>262,733,080</u>	<u>1.2</u>
ENERGIE					
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	191	207,005	0.0
Cheniere Energy Partners LP	4.50%	10/01/2029	4,266	3,998,795	0.0
Columbia Pipelines Operating Co. LLC	6.04%	11/15/2033	7,993	8,210,146	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	9,069	8,891,280	0.0
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	11,355	12,848,589	0.1
EnLink Midstream LLC	5.63%	01/15/2028	17,787	17,518,784	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.05%	04/01/2045	12,996	11,026,316	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.45%	06/01/2047	10,303	9,063,625	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.60%	04/01/2044	1,916	1,735,067	0.0
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	27,309	30,679,207	0.1
Hess Corp.	7.88%	10/01/2029	16,239	18,208,926	0.1
Kinder Morgan Energy Partners LP	7.30%	08/15/2033	9,000	9,990,880	0.0
Marathon Oil Corp.	4.40%	07/15/2027	201	195,191	0.0
Marathon Oil Corp.	6.80%	03/15/2032	10,144	10,812,193	0.0
Ovintiv, Inc.	6.25%	07/15/2033	18,012	18,519,653	0.1
Ovintiv, Inc.	6.50%	02/01/2038	8,063	8,255,357	0.0
Suncor Energy, Inc.	7.15%	02/01/2032	12,130	13,292,895	0.1
Var Energi ASA	7.50%	01/15/2028	16,538	17,462,600	0.1
Var Energi ASA	8.00%	11/15/2032	22,203	24,799,528	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	21,298	20,812,457	0.1
				<u>246,528,494</u>	<u>0.9</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
LKQ Corp.	6.25%	06/15/2033	30,373	31,220,768	0.1
DIENTSTLEISTUNGEN					
GTCR W-2 Merger Sub LLC	7.50%	01/15/2031	55,646	58,029,986	0.2
TECHNOLOGIE					
Entegris, Inc.	4.75%	04/15/2029	35,879	33,877,754	0.1
Fiserv, Inc.	5.35%	03/15/2031	48,176	48,204,131	0.2
Jabil, Inc.	5.45%	02/01/2029	7,111	7,102,973	0.0
Leidos, Inc.	7.13%	07/01/2032	2,000	2,145,095	0.0
NXP BV/NXP Funding LLC	5.55%	12/01/2028	1,500	1,513,290	0.0
SK Hynix, Inc.	5.50%	01/16/2029	17,800	17,767,960	0.1
Western Digital Corp.	2.85%	02/01/2029	6,601	5,562,553	0.0
Western Digital Corp.	3.10%	02/01/2032	2,576	2,008,156	0.0
				<u>118,181,912</u>	<u>0.4</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	31,075	30,360,251	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/ Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	41,403	41,482,835	0.2
				<u>71,843,086</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
BNSF Funding Trust I	6.61%	12/15/2055	USD 5,597	\$ 5,533,284	0.0%
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045	24,752	24,581,941	0.1
ERAC USA Finance LLC	4.60%	05/01/2028	23,757	23,332,317	0.1
ERAC USA Finance LLC	4.90%	05/01/2033	54,939	53,537,169	0.2
				<u>101,451,427</u>	<u>0.4</u>
				<u>1,884,534,354</u>	<u>7.4</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025	66,061	65,900,867	0.2
Ally Financial, Inc.	6.85%	01/03/2030	28,108	28,727,380	0.1
Ally Financial, Inc.	6.99%	06/13/2029	15,439	15,859,095	0.1
Ally Financial, Inc.	7.10%	11/15/2027	19,842	20,657,093	0.1
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	29,727	32,573,504	0.1
AmSouth Bancorp	6.75%	11/01/2025	11,929	12,159,514	0.1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd./ United Kingdom(c)	6.75%	06/15/2026	43,923	44,061,891	0.2
Banco Santander SA	4.18%	03/24/2028	13,200	12,656,516	0.1
Banco Santander SA	5.18%	11/19/2025	30,600	30,224,267	0.1
Banco Santander SA	6.92%	08/08/2033	31,600	32,857,640	0.1
Banco Santander SA(c)	9.63%	05/21/2033	12,400	13,268,674	0.1
Bank of America Corp.	2.97%	02/04/2033	12,974	10,895,838	0.0
Bank of America Corp., Series B	8.05%	06/15/2027	34,006	36,112,538	0.2
Bank of America Corp., Series X(c)	6.25%	09/05/2024	5,657	5,646,392	0.0
Bank of Ireland Group PLC	6.25%	09/16/2026	11,177	11,239,285	0.1
Barclays PLC	5.09%	06/20/2030	6,644	6,299,869	0.0
Barclays PLC(c)	6.13%	12/15/2025	56,173	53,491,688	0.2
Barclays PLC	7.12%	06/27/2034	5,402	5,627,636	0.0
BNP Paribas SA	5.50%	05/20/2030	59,244	58,943,757	0.2
BPCE SA	4.50%	03/15/2025	13,000	12,769,682	0.1
BPCE SA	4.63%	07/11/2024	21,672	21,521,548	0.1
BPCE SA	5.15%	07/21/2024	23,413	23,278,745	0.1
BPCE SA	5.98%	01/18/2027	12,618	12,638,622	0.1
CaixaBank SA	6.84%	09/13/2034	30,915	32,476,647	0.1
Capital One Financial Corp.	5.70%	02/01/2030	14,031	14,057,457	0.1
Capital One Financial Corp.	5.82%	02/01/2034	9,700	9,585,975	0.0
Capital One Financial Corp.	6.38%	06/08/2034	12,559	12,936,374	0.1
Capital One Financial Corp.	7.62%	10/30/2031	30,590	33,477,201	0.1
Citigroup, Inc.	5.83%	02/13/2035	12,080	11,816,490	0.1
Citigroup, Inc., Series AA(c)	7.63%	11/15/2028	14,836	15,283,862	0.1
Citigroup, Inc., Series P(c)	5.95%	05/15/2025	10,465	10,308,549	0.0
Citigroup, Inc., Series U(c)	5.00%	09/12/2024	26,500	26,170,789	0.1
Citigroup, Inc., Series V(c)	4.70%	01/30/2025	9,977	9,582,374	0.0
Citigroup, Inc., Series W(c)	4.00%	12/10/2025	16,145	15,269,022	0.1
Citigroup, Inc., Series X(c)	3.88%	02/18/2026	24,915	23,419,737	0.1
Credit Agricole SA	6.32%	10/03/2029	12,213	12,612,645	0.1
Credit Agricole SA(c)	8.13%	12/23/2025	25,504	25,993,595	0.2
Danske Bank A/S	4.30%	04/01/2028	30,000	28,917,035	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	3.96%	11/26/2025	11,625	11,431,382	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	6.12%	07/14/2026	24,309	24,372,941	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	6.72%	01/18/2029	17,431	17,904,198	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	6.82%	11/20/2029	4,865	5,031,447	0.0
Deutsche Bank AG/New York NY	7.08%	02/10/2034	15,946	15,917,282	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	7.15%	07/13/2027	10,286	10,566,042	0.0
Discover Bank	5.97%	08/09/2028	42,248	41,630,765	0.2
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	11,620	12,779,702	0.1
First-Citizens Bank & Trust Co.	2.97%	09/27/2025	2,736	2,678,265	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(c) (d)	8.44%	04/01/2024	5,804	5,799,043	0.0
HSBC Holdings PLC	4.76%	03/29/2033	17,054	15,645,848	0.1
HSBC Holdings PLC	5.55%	03/04/2030	38,315	38,305,070	0.2
HSBC Holdings PLC	5.89%	08/14/2027	3,464	3,486,900	0.0
HSBC Holdings PLC(c)	6.38%	03/30/2025	9,850	9,726,875	0.0
HSBC Holdings PLC(c)	6.50%	03/23/2028	19,335	18,512,569	0.1
HSBC Holdings PLC	7.40%	11/13/2034	13,857	14,850,059	0.1
HSBC Holdings PLC	8.11%	11/03/2033	15,000	16,890,297	0.1
ING Groep NV(c)	6.75%	04/16/2024	31,733	31,748,807	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	29,505	29,342,332	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	3,000	2,974,111	0.0
JPMorgan Chase & Co.	2.96%	01/25/2033	29,736	25,108,121	0.1
Lloyds Banking Group PLC	3.75%	03/18/2028	14,111	13,384,331	0.1
Lloyds Banking Group PLC	4.58%	12/10/2025	22,665	22,217,480	0.1
Lloyds Banking Group PLC	5.46%	01/05/2028	5,508	5,493,547	0.0
Lloyds Banking Group PLC	5.87%	03/06/2029	16,838	17,032,127	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Lloyds Banking Group PLC	5.99%	08/07/2027	USD 3,428	\$ 3,451,080	0.0%
Lloyds Banking Group PLC(c)	7.50%	06/27/2024	12,113	12,077,387	0.1
Lloyds Banking Group PLC(c)	7.50%	09/27/2025	6,303	6,205,382	0.0
Lloyds Banking Group PLC	7.95%	11/15/2033	11,000	12,262,781	0.1
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	5.02%	07/20/2028	19,113	18,963,923	0.1
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.	4.60%	03/27/2024	17,908	17,886,502	0.1
Mizuho Financial Group, Inc.	5.38%	05/26/2030	22,525	22,546,862	0.1
Mizuho Financial Group, Inc.	5.41%	09/13/2028	10,000	10,054,176	0.0
Morgan Stanley	5.42%	07/21/2034	10,214	10,164,315	0.0
Morgan Stanley, Series G	2.24%	07/21/2032	26,830	21,630,961	0.1
Nationwide Building Society	6.56%	10/18/2027	77,774	79,642,817	0.3
NatWest Group PLC	4.27%	03/22/2025	21,152	21,129,739	0.1
NatWest Group PLC	6.48%	06/01/2034	12,490	12,492,748	0.1
Nordea Bank Abp(c)	3.75%	03/01/2029	2,800	2,254,128	0.0
Nordea Bank Abp(c)	6.63%	03/26/2026	59,046	58,168,677	0.2
PNC Bank NA	5.90%	04/01/2026	7,500	7,359,718	0.0
Santander Holdings USA, Inc.	2.49%	01/06/2028	11,140	10,074,695	0.0
Santander Holdings USA, Inc.	4.40%	07/13/2027	17,000	16,292,149	0.1
Santander Holdings USA, Inc.	5.81%	09/09/2026	7,436	7,418,234	0.0
Santander Holdings USA, Inc.	6.17%	01/09/2030	34,581	34,467,548	0.1
Santander Holdings USA, Inc.	6.50%	03/09/2029	11,220	11,394,423	0.1
Santander Holdings USA, Inc.	6.57%	06/12/2029	7,985	8,132,570	0.0
Santander Holdings USA, Inc.	7.66%	11/09/2031	1,939	2,071,271	0.0
Santander UK Group Holdings PLC	6.83%	11/21/2026	46,433	47,116,384	0.2
Skandinaviska Enskilda Banken AB(c)	6.88%	06/30/2027	600	588,860	0.0
Societe Generale SA	4.25%	04/14/2025	11,148	10,907,592	0.0
Societe Generale SA	4.75%	11/24/2025	22,112	21,610,660	0.1
Societe Generale SA	5.52%	01/19/2028	74,175	73,398,299	0.3
Societe Generale SA	6.45%	01/12/2027	6,504	6,559,726	0.0
Standard Chartered PLC	2.82%	01/30/2026	17,000	16,495,272	0.1
Standard Chartered PLC	6.17%	01/09/2027	22,777	22,948,802	0.1
Standard Chartered PLC	6.19%	07/06/2027	8,683	8,771,512	0.0
Standard Chartered PLC(c) (d)	7.09%	01/30/2027	34,013	32,670,556	0.2
Svenska Handelsbanken AB(c)	4.38%	03/01/2027	1,800	1,640,697	0.0
Svenska Handelsbanken AB(c)	4.75%	03/01/2031	13,600	11,397,378	0.1
Swedbank AB, Series NC5(c)	5.63%	09/17/2024	13,600	13,498,620	0.1
UBS AG	5.13%	05/15/2024	7,742	7,712,960	0.0
UBS Group AG	2.10%	02/11/2032	26,000	20,571,007	0.1
UBS Group AG	4.49%	05/12/2026	4,473	4,401,812	0.0
UBS Group AG	6.25%	09/22/2029	12,871	13,223,699	0.1
UBS Group AG(c)	7.00%	02/19/2025	30,847	30,866,259	0.1
UBS Group AG(c)	9.25%	11/13/2028	7,384	7,891,139	0.0
UBS Group AG(c)	9.25%	11/13/2033	7,080	7,815,196	0.0
US Bancorp	5.38%	01/23/2030	16,094	16,003,254	0.1
Wells Fargo & Co.	3.35%	03/02/2033	19,377	16,625,614	0.1
Wells Fargo & Co.	5.50%	01/23/2035	18,726	18,608,398	0.1
Wells Fargo & Co.(c)	7.63%	09/15/2028	4,347	4,587,858	0.0
				<u>2,084,202,974</u>	<u>9.0</u>
MAKLER					
Joy Treasure Assets Holdings, Inc.	3.50%	09/24/2029	17,500	15,655,325	0.1
FINANZEN					
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	20,004	17,790,286	0.1
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	25,957	25,655,700	0.1
Aircastle Ltd.(c)	5.25%	06/15/2026	15,194	14,145,911	0.1
Aircastle Ltd.	5.95%	02/15/2029	7,045	6,964,643	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	5,354	4,976,804	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	09/20/2026	13,175	11,988,178	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	8,286	7,646,625	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	117	113,698	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	4,985	4,883,871	0.0
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	30,672	30,523,115	0.1
Aviation Capital Group LLC	6.38%	07/15/2030	1,264	1,289,866	0.0
Aviation Capital Group LLC	6.75%	10/25/2028	3,142	3,256,548	0.0
				<u>129,235,245</u>	<u>0.5</u>
VERSICHERUNGEN					
ACE Capital Trust II	9.70%	04/01/2030	31,826	37,385,151	0.2
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	8,665	8,723,170	0.0
Allstate Corp. (The), Series B(e)	8.51%	08/15/2053	35,856	35,926,520	0.2
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.63%	08/15/2052	21,351	20,979,213	0.1
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.75%	08/15/2050	18,619	18,447,228	0.1
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co., Ltd., Series E	5.63%	06/24/2046	3,300	3,290,968	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(d)	7.69%	02/12/2047	61,341	52,983,837	0.2
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	6,501	6,672,883	0.0
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	11,997	12,861,001	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MetLife, Inc.	6.40%	12/15/2066	USD 7,456	\$ 7,579,113	0.0%
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	8,590	11,692,312	0.1
Nationwide Mutual Insurance Co.(d)	7.94%	12/15/2024	1,000	1,003,305	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044	42,601	42,590,691	0.2
Swiss Re Finance Luxembourg SA	5.00%	04/02/2049	5,290	5,129,131	0.0
				<u>265,264,523</u>	<u>1.2</u>
REITs					
American Tower Corp.	2.10%	06/15/2030	14,865	12,235,184	0.1
Boston Properties LP	6.75%	12/01/2027	19,653	20,301,369	0.1
Crown Castle, Inc.	5.60%	06/01/2029	36,893	37,137,753	0.2
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025	14,960	14,837,473	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026	5,190	5,136,266	0.0
SITE Centers Corp.	4.70%	06/01/2027	18,600	18,279,796	0.1
Store Capital Corp.	4.63%	03/15/2029	4,573	4,266,257	0.0
				<u>112,194,098</u>	<u>0.6</u>
				<u>2,606,552,165</u>	<u>11.4</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Alexander Funding Trust II	7.47%	07/31/2028	16,601	17,395,874	0.1
Electricite de France SA(c)	9.13%	03/15/2033	8,329	9,266,750	0.0
Enel Finance International NV	7.50%	10/14/2032	30,164	33,636,406	0.1
Israel Electric Corp., Ltd., Series G	4.25%	08/14/2028	12,232	11,273,134	0.1
NRG Energy, Inc.	3.75%	06/15/2024	10,265	10,177,736	0.0
NRG Energy, Inc.	4.45%	06/15/2029	7,457	6,935,918	0.0
NRG Energy, Inc.	7.00%	03/15/2033	15,378	16,019,380	0.1
Pacific Gas & Electric Co.	5.55%	05/15/2029	13,877	13,904,584	0.1
PacifiCorp	5.10%	02/15/2029	17,019	16,968,990	0.1
Palomino Funding Trust I	7.23%	05/17/2028	28,733	29,945,430	0.1
Vistra Operations Co. LLC	6.95%	10/15/2033	12,312	12,839,360	0.1
				<u>178,363,562</u>	<u>0.8</u>
				<u>4,669,450,081</u>	<u>19.6</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	3.50%	09/01/2049	3,552	3,218,610	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	4.00%	08/01/2049	841	786,886	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	5.00%	11/01/2049	3,202	3,177,635	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2022	4.50%	09/01/2052	142,193	134,752,427	0.6
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	4.50%	10/01/2053	142,441	134,809,687	0.6
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.00%	02/01/2053	70,912	68,801,754	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.00%	04/01/2053	31,342	30,402,959	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.00%	06/01/2053	76,899	74,594,340	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.00%	10/01/2053	22,084	21,420,448	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.50%	06/01/2053	275,280	272,487,821	1.1
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.50%	07/01/2053	59,792	59,166,966	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.50%	08/01/2053	62,002	61,353,553	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	6.00%	10/01/2053	168,790	169,577,473	0.7
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	6.00%	11/01/2053	168,843	169,630,360	0.7
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	6.50%	11/01/2053	95,946	97,641,265	0.4
Federal National Mortgage Association, Series 2019	3.50%	10/01/2049	3,466	3,144,882	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	09/01/2049	2,857	2,676,528	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	10/01/2049	4,936	4,628,624	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	07/01/2053	34,872	33,827,046	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	08/01/2053	213,419	207,023,481	0.9
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	12/01/2053	73,230	71,035,324	0.3
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	04/01/2053	89,665	88,755,637	0.4
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	05/01/2053	17,838	17,657,116	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	06/01/2053	25,432	25,173,790	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	07/01/2053	196,441	194,386,594	0.8
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	08/01/2053	77,236	76,428,859	0.3
Government National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	07/20/2053	99,442	97,130,619	0.4
Government National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	09/20/2053	111,363	108,775,040	0.5
Government National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	06/20/2053	58,575	58,215,132	0.2
Government National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	07/20/2053	23,598	23,453,296	0.1
				<u>2,314,134,152</u>	<u>9.7</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	37,202	26,785,440	0.1
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	15,555	11,744,025	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	19,203	16,933,397	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	13,480	11,022,596	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	7.25%	02/13/2033	17,252	15,542,057	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	USD 12,050	\$ 11,544,744	0.1%
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	11,082	10,722,278	0.1
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	42,008	33,816,440	0.1
Eldorado Gold Corp.	6.25%	09/01/2029	12,403	11,621,476	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	9.38%	03/01/2029	16,021	16,612,088	0.1
Freeport Indonesia PT	4.76%	04/14/2027	5,354	5,213,886	0.0
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	5.13%	05/15/2024	8,685	8,644,788	0.0
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	6,073	6,108,345	0.0
Industrias Penoles SAB de CV	5.65%	09/12/2049	4,016	3,540,546	0.0
Inversiones CMPC SA	6.13%	02/26/2034	4,804	4,856,640	0.0
JSW Steel Ltd.	3.95%	04/05/2027	1,921	1,781,439	0.0
JSW Steel Ltd.	5.05%	04/05/2032	8,730	7,679,672	0.0
Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027	8,310	8,022,266	0.0
Orbia Advance Corp. SAB de CV	2.88%	05/11/2031	12,000	9,710,400	0.0
Sasol Financing USA LLC	5.88%	03/27/2024	8,684	8,670,974	0.0
Sasol Financing USA LLC	8.75%	05/03/2029	9,598	9,619,792	0.0
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	6.50%	11/07/2033	20,140	20,693,850	0.1
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	17,644	15,507,488	0.1
Stillwater Mining Co.	4.50%	11/16/2029	5,188	4,030,713	0.0
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	5,486	4,794,764	0.0
Suzano Austria GmbH	5.00%	01/15/2030	9,588	9,110,709	0.0
Suzano Austria GmbH	6.00%	01/15/2029	7,590	7,590,000	0.0
Suzano Austria GmbH, Series DM3N	3.13%	01/15/2032	4,108	3,370,203	0.0
UPL Corp., Ltd.	4.50%	03/08/2028	3,017	2,621,803	0.0
UPL Corp., Ltd.	4.63%	06/16/2030	19,271	15,852,325	0.1
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	12/09/2028	10,981	10,109,403	0.1
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	6,560	4,108,200	0.0
				<u>337,982,747</u>	<u>1.4</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Cemex SAB de CV	3.88%	07/11/2031	9,350	8,169,563	0.0
Cemex SAB de CV(c)	5.13%	06/08/2026	24,345	23,188,613	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	26,107	25,997,351	0.1
IHS Holding Ltd.	6.25%	11/29/2028	2,727	2,231,451	0.0
Usiminas International SARL	5.88%	07/18/2026	11,294	11,104,261	0.1
				<u>70,691,239</u>	<u>0.3</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	10,669	9,244,689	0.0
Globo Comunicacao e Participacoes SA	5.50%	01/14/2032	8,042	6,956,330	0.0
Prosus NV	3.06%	07/13/2031	36,154	29,081,555	0.1
Prosus NV	3.26%	01/19/2027	10,600	9,777,546	0.0
Prosus NV	4.03%	08/03/2050	7,314	4,655,361	0.0
Telecomunicaciones Digitales SA	4.50%	01/30/2030	886	792,970	0.0
Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024	28,740	28,506,056	0.1
				<u>89,014,507</u>	<u>0.2</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	19,556	18,434,605	0.1
Xiaomi Best Time International Ltd.	3.38%	04/29/2030	11,588	10,117,773	0.1
				<u>28,552,378</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
GENM Capital Labuan Ltd.	3.88%	04/19/2031	1,449	1,253,838	0.0
Gohl Capital Ltd.	4.25%	01/24/2027	2,187	2,094,206	0.0
				<u>3,348,044</u>	<u>0.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Falabella SA	3.75%	10/30/2027	16,924	15,290,834	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	4,478	4,276,535	0.0
BRF SA	4.88%	01/24/2030	5,816	5,328,910	0.0
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdco SL/ Beliv Holdco SL	5.25%	04/27/2029	5,267	4,950,980	0.0
MARB BondCo PLC	3.95%	01/29/2031	41,056	33,358,000	0.1
Natura &Co Luxembourg Holdings SARL	6.00%	04/19/2029	11,231	10,908,670	0.1
Natura Cosméticos SA	4.13%	05/03/2028	3,405	3,113,362	0.0
NBM US Holdings, Inc.	6.63%	08/06/2029	10,000	9,836,700	0.0
Rede D'or Finance SARL	4.50%	01/22/2030	5,927	5,297,256	0.0
Rede D'or Finance SARL	4.95%	01/17/2028	4,189	3,963,841	0.0
				<u>81,034,254</u>	<u>0.2</u>
ENERGIE					
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	10,608	10,262,803	0.1
Canacol Energy Ltd.	5.75%	11/24/2028	17,901	12,191,935	0.0
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	11,890	9,821,497	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	18,715	18,205,952	0.1
Ecopetrol SA	8.63%	01/19/2029	24,291	25,724,169	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027	USD 14,600	\$ 13,213,000	0.1%
Gran Tierra Energy, Inc.	9.50%	10/15/2029	13,051	12,072,175	0.1
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	10,110	9,948,746	0.0
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	2,624	2,551,105	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	8.55%	09/18/2033	11,612	12,279,690	0.1
KazMunayGas National Co. JSC.	4.75%	04/19/2027	15,597	15,070,445	0.1
KazMunayGas National Co. JSC.	5.38%	04/24/2030	27,672	26,866,191	0.1
Medco Maple Tree Pte Ltd.	8.96%	04/27/2029	13,883	14,466,086	0.1
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	9,830	9,230,488	0.0
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	8,487	7,882,980	0.0
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	16,179	16,062,713	0.1
SEPLAT Energy PLC.	7.75%	04/01/2026	5,591	5,246,804	0.0
SierraCol Energy Andina LLC.	6.00%	06/15/2028	17,650	15,349,984	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	12,391	10,132,864	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	25,480	23,909,158	0.1
Transportadora de Gas Internacional SA ESP.	5.55%	11/01/2028	9,600	9,421,440	0.0
				<u>279,910,225</u>	<u>1.3</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	9,421	8,798,083	0.0
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	345	311,939	0.0
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	26,695	25,525,492	0.1
Lenovo Group Ltd.	3.42%	11/02/2030	12,000	10,450,080	0.1
Lenovo Group Ltd.	5.83%	01/27/2028	14,335	14,472,759	0.1
Lenovo Group Ltd.	6.54%	07/27/2032	4,000	4,190,000	0.0
Xiaomi Best Time International Ltd.	2.88%	07/14/2031	12,258	10,104,024	0.1
				<u>65,054,294</u>	<u>0.4</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	19,155	17,494,246	0.1
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	17,018	16,720,398	0.1
				<u>34,214,644</u>	<u>0.2</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.00%	07/30/2027	23,925	21,970,088	0.1
Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA	6.75%	03/30/2029	11,712	11,797,966	0.1
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	3,094	2,885,155	0.0
				<u>36,653,209</u>	<u>0.2</u>
				<u>1,050,544,458</u>	<u>4.5</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Absa Group Ltd.(c)	6.38%	05/27/2026	4,093	3,908,815	0.0
Banco de Credito del Peru SA	3.13%	07/01/2030	20,748	19,717,084	0.1
Banco de Credito del Peru SA	5.85%	01/11/2029	6,236	6,299,343	0.0
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand.	5.38%	04/17/2025	23,905	23,809,380	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas	5.88%	09/13/2034	26,946	24,793,688	0.1
				<u>78,528,310</u>	<u>0.3</u>
FINANZEN					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	400	380,900	0.0
Huarong Finance 2017 Co., Ltd., Series E	4.25%	11/07/2027	1,054	974,687	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.63%	06/03/2026	2,680	2,578,187	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.88%	11/22/2026	6,016	5,786,790	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	5.50%	01/16/2025	39,399	39,039,287	0.2
REC Ltd.	5.63%	04/11/2028	3,793	3,808,409	0.0
				<u>52,568,260</u>	<u>0.2</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
China Cinda 2020 I Management Ltd., Series E	3.25%	01/28/2027	24,000	22,395,360	0.1
OEC Finance Ltd.(b)	7.13%	12/26/2046	14,953	911,227	0.0
				<u>23,306,587</u>	<u>0.1</u>
REITs					
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	34,681	31,467,805	0.1
				<u>185,870,962</u>	<u>0.7</u>
STAATSANLEIHEN					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	17,946	15,963,505	0.1
Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025	12,861	12,848,653	0.1
				<u>28,812,158</u>	<u>0.2</u>
BRASILIEN					
Brazilian Government International Bond.	8.25%	01/20/2034	15,326	17,567,428	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KOLUMBIEN					
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	USD 4,454	\$ 3,525,118	0.0%
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	47,384	36,578,553	0.2
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	7,843	6,145,226	0.0
Colombia Government International Bond	8.00%	11/14/2035	1,570	1,632,329	0.0
				<u>47,881,226</u>	<u>0.2</u>
ELFENBEINKÜSTE					
Ivory Coast Government International Bond	5.75%	12/31/2032	27,680	25,921,537	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	35,155	30,837,966	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	48,227	46,750,048	0.2
				<u>103,509,551</u>	<u>0.4</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030	54,271	49,289,465	0.2
Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	16,073	14,312,685	0.1
Dominican Republic International Bond	5.50%	02/22/2029	6,306	6,099,605	0.0
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	8,000	7,978,000	0.0
Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026	4,828	4,879,298	0.0
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	2,096	2,183,246	0.0
				<u>84,742,299</u>	<u>0.3</u>
ÄGYPTEN					
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	2,395	2,155,548	0.0
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	6,969	5,768,938	0.0
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	6,932	5,904,400	0.0
				<u>13,828,886</u>	<u>0.0</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	15,000	12,903,450	0.1
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	2,444	1,670,523	0.0
				<u>14,573,973</u>	<u>0.1</u>
KENIA					
Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	19,297	18,495,596	0.1
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	7,834	6,881,934	0.0
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	25,500	23,185,365	0.1
Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	1,599	1,412,117	0.0
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	13,971	10,774,854	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	12,210	9,804,020	0.0
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	3,948	3,469,858	0.0
				<u>55,528,148</u>	<u>0.2</u>
PANAMA					
Panama Government International Bond	6.88%	01/31/2036	4,189	3,956,511	0.0
Panama Government International Bond	7.50%	03/01/2031	1,510	1,549,675	0.0
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	32,276	30,379,785	0.1
				<u>35,885,971</u>	<u>0.1</u>
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	43,004	35,800,830	0.2
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	22,447	16,246,016	0.1
				<u>52,046,846</u>	<u>0.3</u>
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	45,168	32,887,950	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	14,391	11,350,901	0.1
				<u>44,238,851</u>	<u>0.2</u>
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2035	16,267	4,262,930	0.0
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2034	12,677	3,310,091	0.0
				<u>7,573,021</u>	<u>0.0</u>
				<u>524,683,954</u>	<u>2.2</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Adani Green Energy Ltd.	4.38%	09/08/2024	8,473	8,362,258	0.0
Adani Transmission Step-One Ltd.	4.00%	08/03/2026	15,853	14,854,261	0.1
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	12,300	11,946,990	0.1
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	11,706	9,785,872	0.0
Buffalo Energy Mexico Holdings/ Buffalo Energy Infrastructure/Buffalo Energy	7.88%	02/15/2039	3,831	4,051,895	0.0
Cometa Energia SA de CV	6.38%	04/24/2035	7,483	7,366,046	0.0
Consorcio Transmantaro SA	5.20%	04/11/2038	9,670	9,047,542	0.0
Continuum Energy Aura Pte Ltd.	9.50%	02/24/2027	9,631	10,021,056	0.0
Diamond II Ltd.	7.95%	07/28/2026	16,425	16,679,983	0.1
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	4,147	3,991,603	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	USD 24,989	\$ 21,494,038	0.1%
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.38%	02/15/2031	19,852	16,313,778	0.1
Engie Energia Chile SA	4.50%	01/29/2025	9,400	9,215,666	0.0
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	13,448	12,292,313	0.1
Infraestructura Energetica Nova SAPI de CV	3.75%	01/14/2028	4,898	4,588,838	0.0
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	11,154	10,624,185	0.1
Kallpa Generacion SA	4.13%	08/16/2027	2,777	2,621,488	0.0
LLPL Capital Pte Ltd.	6.88%	02/04/2039	8,604	8,326,277	0.0
Minejesa Capital BV	4.63%	08/10/2030	19,989	18,925,034	0.1
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	11,556	11,561,184	0.1
Terraform Global Operating LP	6.13%	03/01/2026	7,314	7,241,512	0.0
				<u>219,311,819</u>	<u>0.9</u>
ERDGAS					
GNL Quintero SA	4.63%	07/31/2029	7,896	7,745,108	0.0
Grupo Energia Bogota SA ESP	7.85%	11/09/2033	10,000	10,922,131	0.1
				<u>18,667,239</u>	<u>0.1</u>
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Aegea Finance SARL	9.00%	01/20/2031	3,847	4,070,346	0.0
				<u>242,049,404</u>	<u>1.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
Raizen Fuels Finance SA	6.45%	03/05/2034	18,367	18,586,335	0.1
				<u>2,021,735,113</u>	<u>8.5</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(d)	8.48%	04/15/2034	6,750	6,700,279	0.0
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(d)	8.73%	04/15/2034	4,750	4,739,849	0.0
AGL CLO 13 Ltd., Series 2021-13A, Class D(d)	8.73%	10/20/2034	27,834	27,434,533	0.1
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class D(d)	9.28%	01/20/2034	4,250	4,252,257	0.0
Apidos CLO XXV, Series 2016-25A, Class A1R(d)	6.75%	10/20/2031	5,435	5,435,119	0.0
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(d)	8.23%	04/20/2034	6,000	5,739,138	0.0
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(d)	8.68%	10/20/2034	4,000	3,859,916	0.0
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class C(d)	9.18%	01/20/2034	8,330	8,308,375	0.0
Ballyrock CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A1(d)	6.58%	04/20/2031	2,798	2,799,398	0.0
Benefit Street Partners CLO VIII Ltd., Series 2015-8A, Class A1AR(d)	6.68%	01/20/2031	7,528	7,531,661	0.0
Betony CLO 2 Ltd., Series 2018-1A, Class A1(d)	6.66%	04/30/2031	3,180	3,185,753	0.0
Betony CLO 2 Ltd., Series 2018-1X, Class A1(d)	6.66%	04/30/2031	18,909	18,942,312	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(d)	7.34%	04/26/2031	11,000	10,961,918	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(d)	8.63%	07/23/2032	8,000	7,946,800	0.0
BlueMountain CLO Ltd., Series 2015-3A, Class A1R(d)	6.58%	04/20/2031	20,728	20,755,634	0.1
Buttermilk Park CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A1(d)	6.68%	10/15/2031	4,594	4,599,134	0.0
Carbone CLO Ltd., Series 2017-1A, Class A1(d)	6.72%	01/20/2031	16,965	16,983,905	0.1
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd., Series 2014-1A, Class A1R2(d)	6.55%	04/17/2031	19,101	19,127,442	0.1
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd., Series 2014-3RA, Class A1A(d)	6.63%	07/27/2031	6,621	6,621,960	0.0
Catamaran CLO Ltd., Series 2014-1A, Class A1AR(d)	6.68%	04/22/2030	6,458	6,464,848	0.0
CBAM Ltd., Series 2018-5A, Class A(d)	6.60%	04/17/2031	18,533	18,551,358	0.1
CIFC Funding Ltd., Series 2013-3RA, Class A1(d)	6.56%	04/24/2031	3,423	3,424,762	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2014-2RA, Class A1(d)	6.63%	04/24/2030	7,077	7,081,479	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2014-5A, Class A1R2(d)	6.78%	10/17/2031	17,185	17,188,832	0.1
CIFC Funding Ltd., Series 2015-1A, Class ARR(d)	6.69%	01/22/2031	10,250	10,265,478	0.1
CIFC Funding Ltd., Series 2017-3A, Class A1(d)	6.80%	07/20/2030	1,949	1,952,052	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2018-1A, Class A(d)	6.56%	04/18/2031	9,570	9,571,106	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2018-2A, Class A1(d)	6.62%	04/20/2031	1,902	1,902,004	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2018-3X, Class A(d)	6.66%	07/18/2031	9,759	9,775,880	0.1
CIFC Funding Ltd., Series 2018-4A, Class A1(d)	6.73%	10/17/2031	33,613	33,651,718	0.2
Clover CLO LLC, Series 2021-3A, Class D(d)	8.69%	01/25/2035	10,400	10,393,895	0.1
Dryden 30 Senior Loan Fund, Series 2013-30A, Class AR(d)	6.39%	11/15/2028	4,452	4,456,298	0.0
Dryden 53 CLO Ltd., Series 2017-53A, Class A(d)	6.70%	01/15/2031	5,911	5,910,428	0.0
Dryden 57 CLO Ltd., Series 2018-57A, Class A(d)	6.58%	05/15/2031	33,304	33,328,865	0.1
Dryden 60 CLO Ltd., Series 2018-60A, Class A(d)	6.63%	07/15/2031	25,982	26,007,223	0.1
Dryden XXVI Senior Loan Fund, Series 2013-26A, Class AR(d)	6.48%	04/15/2029	3,583	3,580,691	0.0
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(d)	8.63%	07/15/2030	1,500	1,478,090	0.0
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class D(d)	8.99%	04/22/2035	3,550	3,550,604	0.0
Galaxy XXIV CLO Ltd., Series 2017-24A, Class A(d)	6.70%	01/15/2031	16,787	16,786,542	0.1
Galaxy Xxviii CLO Ltd., Series 2018-28A, Class A1(d)	6.68%	07/15/2031	4,048	4,051,279	0.0
Gilbert Park CLO Ltd., Series 2017-1A, Class A(d)	6.77%	10/15/2030	4,629	4,630,503	0.0
Goldentree Loan Opportunities XI Ltd., Series 2015-11A, Class AR2(d)	6.63%	01/18/2031	5,857	5,865,130	0.0
GREYWOLF CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A1(d)	6.61%	04/26/2031	44,989	44,993,270	0.2
Jefferson Mill CLO Ltd., Series 2015-1A, Class AR(d)	6.75%	10/20/2031	23,565	23,569,822	0.1
KKR CLO 21 Ltd., Series 21, Class A(d)	6.58%	04/15/2031	15,445	15,453,883	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
LCM XIV LP, Series 14A, Class AR(d)	6.62%	07/20/2031	USD 23,408	\$ 23,450,302	0.1%
LCM XVIII LP, Series 18A, Class AIR(d)	6.60%	04/20/2031	5,433	5,436,102	0.0
Lockwood Grove CLO Ltd., Series 2014-1A, Class AIRR(d)	6.76%	01/25/2030	4,122	4,128,129	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(d)	8.33%	10/20/2030	6,000	5,947,638	0.0
Mountain View CLO IX Ltd., Series 2015-9A, Class AIR(d)	6.70%	07/15/2031	23,627	23,627,160	0.1
Nassau Ltd., Series 2017-IIA, Class AL(d)	6.83%	01/15/2030	3,529	3,529,635	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class DR(d)	8.48%	10/16/2033	1,875	1,851,735	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class D(d)	9.18%	01/20/2032	1,000	1,000,020	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 43 Ltd., Series 2021-43A, Class D(d)	8.68%	07/17/2035	11,050	10,858,492	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 51 Ltd., Series 2022-51A, Class D(d)	11.02%	10/23/2035	9,161	9,285,775	0.0
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(d)	8.93%	10/20/2034	11,950	11,949,618	0.1
OCP CLO Ltd., Series 2014-5A, Class AIR(d)	6.67%	04/26/2031	17,886	17,903,305	0.1
OCP CLO Ltd., Series 2014-6A, Class AIR(d)	6.84%	10/17/2030	10,988	10,991,230	0.1
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class A1A(d)	6.64%	01/20/2031	15,906	15,928,804	0.1
Octagon Investment Partners 36 Ltd., Series 2018-1A, Class A1(d)	6.55%	04/15/2031	18,319	18,318,367	0.1
OZLM VI Ltd., Series 2014-6A, Class A1S(d)	6.66%	04/17/2031	16,141	16,152,826	0.1
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class A(d)	6.60%	04/15/2031	15,675	15,690,994	0.1
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class A1(d)	6.65%	01/17/2031	7,042	7,048,096	0.0
Palmer Square CLO Ltd., Series 2018-2A, Class A1A(d)	6.68%	07/16/2031	27,720	27,748,094	0.1
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class D(d)	9.15%	04/22/2034	8,650	8,653,590	0.0
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(d)	8.68%	07/20/2034	4,000	3,984,852	0.0
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A(d)	6.73%	07/15/2031	16,749	16,772,003	0.1
Regatta XI Funding Ltd., Series 2018-1A, Class A(d)	6.65%	07/17/2031	17,425	17,434,031	0.1
Regatta XIV Funding Ltd., Series 2018-3A, Class A(d)	6.78%	10/25/2031	1,455	1,456,092	0.0
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A(d)	6.68%	05/20/2031	6,536	6,540,034	0.0
Shackleton CLO Ltd., Series 2014-5RA, Class A(d)	6.68%	05/07/2031	39,087	39,131,645	0.2
Signal Peak CLO 5 Ltd., Series 2018-5A, Class A(d)	6.70%	04/25/2031	15,596	15,604,416	0.1
Sound Point CLO XIX Ltd., Series 2018-1A, Class A(d)	6.58%	04/15/2031	37,463	37,444,793	0.2
Sounds Point CLO IV-R Ltd., Series 2013-3RA, Class A(d)	6.71%	04/18/2031	6,754	6,753,711	0.0
TICP CLO IX Ltd., Series 2017-9A, Class A(d)	6.72%	01/20/2031	2,794	2,794,896	0.0
TICP CLO XI Ltd., Series 2018-11A, Class A(d)	6.76%	10/20/2031	4,435	4,435,795	0.0
Venture 31 CLO Ltd., Series 2018-31A, Class A1(d)	6.61%	04/20/2031	5,508	5,511,451	0.0
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(d)	9.58%	07/20/2030	17,169	15,884,377	0.1
Voya CLO Ltd., Series 2013-3A, Class AIRR(d)	6.71%	10/18/2031	12,598	12,611,187	0.1
Voya CLO Ltd., Series 2016-3A, Class AIR(d)	6.75%	10/18/2031	31,275	31,317,591	0.1
Voya CLO Ltd., Series 2017-4A, Class A1(d)	6.71%	10/15/2030	5,742	5,751,442	0.0
Voya CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A1(d)	6.52%	04/19/2031	14,188	14,206,100	0.1
Wehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(d)	8.67%	04/21/2035	7,000	6,957,797	0.0
Wellfleet CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A(d)	6.68%	07/17/2031	10,029	10,033,894	0.1
Wind River CLO Ltd., Series 2014-1A, Class ARR(d)	6.61%	07/18/2031	4,032	4,036,474	0.0
				<u>1,007,973,916</u>	<u>4.3</u>

BEHÖRDEN

SCHULDVERSCHREIBUNGEN VON BEHÖRDEN

Federal Home Loan Banks	3.25%	06/09/2028	34,000	32,569,470	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.25%	07/15/2032	119,285	135,201,360	0.6
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.75%	03/15/2031	65,181	74,426,563	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series GDIF	6.75%	09/15/2029	8,750	9,776,451	0.0
Federal National Mortgage Association	6.25%	05/15/2029	120,037	130,724,482	0.5
Federal National Mortgage Association	6.63%	11/15/2030	358,671	404,881,716	1.7
Federal National Mortgage Association	7.13%	01/15/2030	142,912	163,328,201	0.7
Federal National Mortgage Association	7.25%	05/15/2030	15,000	17,353,047	0.1
Tennessee Valley Authority	7.13%	05/01/2030	19,383	22,082,895	0.1
				<u>990,344,185</u>	<u>4.1</u>

INVESTMENTGESELLSCHAFTEN

FONDS UND INVESTMENTTRUSTS

AB FCPI - Emerging Markets Debt Portfolio - Class SA			721,651	47,881,555	0.2
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			2,942,175	238,786,901	1.0
AB SICAV I - Global Income Portfolio			1,159,244	89,424,094	0.4
AB SICAV I - Sustainable Income Portfolio - Class S			856,251	81,155,435	0.3
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			4,317,024	57,545,936	0.2
				<u>514,793,921</u>	<u>2.1</u>

BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN

RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH

Bellemeade Re Ltd.					
Series 2019-1A, Class M2(d)	8.14%	03/25/2029	USD 7,515	7,560,273	0.1
Series 2019-3A, Class M1C(d)	7.39%	07/25/2029	18,989	19,016,415	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Connecticut Avenue Securities Trust, Series 2023-R07, Class 2M1(d)	7.27%	09/25/2043	USD 26,713	\$ 26,948,840	0.1%
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2023-HQA3, Series 2023-HQA3, Class A1(d)	7.17%	11/25/2043	14,784	14,984,470	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2014-HQ2, Series 2014-HQ2, Class M3(d)	9.19%	09/25/2024	1,095	1,110,286	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQA1, Series 2015-HQA1, Class M3(d)	10.14%	03/25/2028	7,041	7,256,244	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQA2, Series 2015-HQA2, Class M3(d)	10.24%	05/25/2028	7,870	8,164,757	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-HQA3, Series 2016-HQA3, Class M3(d)	9.29%	03/25/2029	1,459	1,525,967	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities Series 2014-C03, Class 2M2(d)	8.34%	07/25/2024	240	241,457	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(d)	10.99%	04/25/2028	13,655	14,131,075	0.1
Series 2016-C01, Class 2M2(d)	12.39%	08/25/2028	3,649	3,803,775	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(d)	11.44%	09/25/2028	10,241	10,706,068	0.1
JP Morgan Madison Avenue Securities Trust, Series 2015-CH1, Class M2(d)	10.94%	10/25/2025	381	389,125	0.0
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(d)	10.69%	10/25/2030	1,954	1,988,620	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-2R, Class A(d)	9.19%	05/30/2025	12,176	12,182,731	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust, Series 2015-WF1, Class 1M2(d)	10.69%	11/25/2025	457	467,969	0.0
				130,478,072	0.9

VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE

Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS

Series 3119, Class PI(d) (f)	1.76%	02/15/2036	2,769	360,097	0.0
Series 3725, Class CS(d) (f)	0.56%	05/15/2040	14,569	765,975	0.0
Series 3898, Class NS(d) (f)	0.49%	07/15/2041	4,402	299,675	0.0
Series 3921, Class SB(d) (f)	1.12%	09/15/2041	9,506	1,097,521	0.0
Series 3928, Class SE(d) (f)	1.14%	09/15/2041	8,450	849,180	0.0
Series 4125, Class SA(d) (f)	0.71%	11/15/2042	5,818	602,256	0.0
Series 4248, Class SL(d) (f)	0.61%	05/15/2041	1,617	112,887	0.0
Series 4292, Class S(d) (f)	0.61%	01/15/2044	2,024	217,037	0.0
Series 4317, Class SD(d) (f)	1.76%	08/15/2035	4,985	559,281	0.0
Series 4372, Class JS(d) (f)	0.66%	08/15/2044	12,832	1,264,663	0.0
Series 4373, Class SA(d) (f)	0.71%	08/15/2044	7,837	804,601	0.0
Series 4494, Class SL(d) (f)	0.78%	07/15/2045	25,631	2,598,675	0.0
Series 4495, Class SA(d) (f)	0.71%	07/15/2045	6,133	694,664	0.0
Series 4570, Class ST(d) (f)	0.56%	04/15/2046	7,053	746,849	0.0
Series 4585, Class DS(d) (f)	0.56%	05/15/2046	13,022	1,296,010	0.0
Series 4593, Class SA(d) (f)	0.56%	06/15/2046	9,315	909,412	0.0
Series 4656, Class SK(d) (f)	0.61%	02/15/2047	6,688	718,211	0.0
Series 4707, Class LS(d) (f)	0.71%	08/15/2047	8,063	863,443	0.0
Series 4719, Class SA(d) (f)	0.71%	09/15/2047	7,004	764,397	0.0
Series 4719, Class SB(d) (f)	0.71%	09/15/2047	13,467	1,498,361	0.0
Series 4727, Class AS(d) (f)	0.76%	11/15/2047	11,188	1,314,498	0.0
Series 4735, Class SA(d) (f)	0.76%	12/15/2047	20,562	2,255,699	0.0
Series 4736, Class LS(d) (f)	0.76%	12/15/2047	9,229	1,048,146	0.0
Series 4736, Class SM(d) (f)	0.76%	12/15/2047	18,392	1,966,243	0.0
Series 4754, Class QS(d) (f)	0.71%	02/15/2048	10,908	1,301,905	0.0
Series 4767, Class SB(d) (f)	0.76%	03/15/2048	4,564	485,880	0.0
Series 4824, Class KS(d) (f)	0.76%	09/15/2048	4,281	461,795	0.0
Series 4927, Class SJ(d) (f)	0.61%	11/25/2049	13,365	1,199,250	0.0
Series 4932, Class SM(d) (f)	0.61%	06/25/2049	19,816	1,927,139	0.0
Series 4954, Class SL(d) (f)	0.61%	02/25/2050	218	21,969	0.0
Series 4981, Class HS(d) (f)	0.66%	06/25/2050	59,625	5,092,866	0.0
Series 4981, Class JS(d) (f)	0.66%	06/25/2050	91,131	11,065,636	0.1
Federal National Mortgage Association REMICS Series 2005-58, Class IK(d) (f)	0.56%	07/25/2035	5,948	549,288	0.0
Series 2006-8, Class JH(d) (f)	1.16%	03/25/2036	6,523	694,371	0.0
Series 2011-146, Class SA(d) (f)	0.56%	01/25/2042	6,952	702,507	0.0
Series 2012-7, Class QS(d) (f)	0.56%	02/25/2042	9,182	893,530	0.0
Series 2012-17, Class ES(d) (f)	1.11%	03/25/2041	700	22,886	0.0
Series 2012-17, Class SE(d) (f)	0.51%	03/25/2042	6,735	777,072	0.0
Series 2012-70, Class HS(d) (f)	0.56%	07/25/2042	10,424	1,220,824	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2012-122, Class LS(d) (f)	0.66%	11/25/2042	USD 6,110	\$ 651,352	0.0%
Series 2012-122, Class MS(d) (f)	0.66%	11/25/2042	6,681	773,511	0.0
Series 2013-4, Class ST(d) (f)	0.71%	02/25/2043	6,367	676,633	0.0
Series 2013-15, Class SA(d) (f)	0.71%	03/25/2043	5,491	601,915	0.0
Series 2013-62, Class SA(d) (f)	1.26%	06/25/2043	8,940	1,292,146	0.0
Series 2014-17, Class SB(d) (f)	0.61%	04/25/2044	6,783	711,516	0.0
Series 2014-28, Class SB(d) (f)	0.61%	05/25/2044	6,394	779,012	0.0
Series 2014-35, Class CS(d) (f)	0.71%	06/25/2044	8,725	639,946	0.0
Series 2014-40, Class HS(d) (f)	1.26%	07/25/2044	4,197	638,907	0.0
Series 2014-78, Class SA(d) (f)	0.66%	12/25/2044	3,610	393,945	0.0
Series 2014-88, Class BS(d) (f)	0.71%	01/25/2045	6,232	639,441	0.0
Series 2015-26, Class SH(d) (f)	1.01%	05/25/2045	9,175	1,135,666	0.0
Series 2015-57, Class AS(d) (f)	0.81%	08/25/2045	34,349	2,457,762	0.0
Series 2015-90, Class SL(d) (f)	0.71%	12/25/2045	7,329	794,408	0.0
Series 2016-29, Class SA(d) (f)	0.56%	05/25/2046	8,604	927,478	0.0
Series 2016-60, Class SA(d) (f)	0.66%	09/25/2046	19,276	1,395,615	0.0
Series 2016-65, Class AS(d) (f)	0.66%	09/25/2046	8,806	746,778	0.0
Series 2016-89, Class SH(d) (f)	0.56%	12/25/2046	4,669	471,876	0.0
Series 2017-20, Class SJ(d) (f)	0.66%	04/25/2047	18,897	2,035,249	0.0
Series 2017-26, Class TS(d) (f)	0.51%	04/25/2047	6,533	730,286	0.0
Series 2017-35, Class LS(d) (f)	0.71%	05/25/2047	19,799	2,304,457	0.0
Series 2017-38, Class DS(d) (f)	0.76%	05/25/2047	4,964	157,074	0.0
Series 2017-38, Class SE(d) (f)	0.66%	05/25/2047	14,185	1,541,024	0.0
Series 2017-49, Class SP(d) (f)	0.71%	07/25/2047	5,842	665,257	0.0
Series 2017-81, Class CS(d) (f)	0.76%	10/25/2047	6,527	656,444	0.0
Series 2017-85, Class HS(d) (f)	0.76%	11/25/2047	10,582	1,144,395	0.0
Series 2017-105, Class SE(d) (f)	0.71%	01/25/2048	30,748	3,446,250	0.0
Series 2017-109, Class SJ(d) (f)	0.76%	01/25/2048	2,515	288,392	0.0
Series 2017-112, Class SA(d) (f)	0.71%	01/25/2048	8,407	925,191	0.0
Series 2018-13, Class SG(d) (f)	0.71%	03/25/2048	5,933	691,119	0.0
Series 2018-28, Class PS(d) (f)	0.76%	05/25/2048	10,785	1,092,863	0.0
Series 2018-28, Class SB(d) (f)	0.76%	05/25/2048	11,092	1,179,805	0.0
Series 2018-30, Class SA(d) (f)	0.76%	05/25/2048	10,954	1,192,726	0.0
Series 2018-32, Class SB(d) (f)	0.76%	05/25/2048	11,195	1,289,630	0.0
Series 2018-39, Class AS(d) (f)	0.76%	06/25/2048	5,300	705,720	0.0
Series 2018-45, Class SL(d) (f)	0.76%	06/25/2048	8,425	990,833	0.0
Series 2018-47, Class SD(d) (f)	0.76%	07/25/2048	16,606	1,923,775	0.0
Series 2018-63, Class KS(d) (f)	0.76%	09/25/2048	4,825	507,363	0.0
Series 2018-96, Class SC(d) (f)	0.61%	10/25/2035	4,141	278,998	0.0
Series 2019-13, Class SA(d) (f)	0.56%	04/25/2049	10,083	999,430	0.0
Series 2019-25, Class SA(d) (f)	0.61%	06/25/2049	24,341	2,409,493	0.0
Series 2019-31, Class SJ(d) (f)	0.66%	07/25/2049	5,367	416,325	0.0
Series 2019-37, Class US(d) (f)	0.61%	07/25/2049	7,989	713,214	0.0
Series 2019-38, Class SM(d) (f)	0.61%	07/25/2049	5,202	490,371	0.0
Series 2019-42, Class SQ(d) (f)	0.61%	08/25/2049	15,380	1,748,845	0.0
Series 2019-48, Class SA(d) (f)	0.76%	12/25/2039	19,154	1,953,413	0.0
Series 2019-48, Class SM(d) (f)	0.61%	07/25/2039	6,933	669,170	0.0
Series 2019-60, Class SJ(d) (f)	0.61%	10/25/2049	16,159	1,715,674	0.0
Series 2019-65, Class SY(d) (f)	0.61%	11/25/2049	10,806	1,258,798	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2014-160, Class SP(d) (f)	0.17%	10/20/2044	10,681	1,181,014	0.0
Series 2017-52, Class SN(d) (f)	0.72%	04/20/2047	3,575	325,831	0.0
Series 2017-103, Class SL(d) (f)	0.77%	07/20/2047	12,780	1,230,252	0.0
Series 2017-115, Class SA(d) (f)	0.77%	07/20/2047	10,031	987,464	0.0
Series 2017-122, Class SA(d) (f)	0.77%	08/20/2047	12,600	1,479,373	0.0
Series 2017-134, Class SE(d) (f)	0.77%	09/20/2047	5,741	555,114	0.0
Series 2017-149, Class SG(d) (f)	0.77%	10/20/2047	9,922	903,445	0.0
Series 2020-47, Class SG(d) (f)	0.57%	02/20/2049	12,200	1,243,773	0.0
				<u>109,780,456</u>	<u>0.1</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS					
Series 4398, Class IO(g)	6.00%	10/15/2037	10,316	1,760,788	0.0
Series 4913, Class IO(g)	6.00%	04/15/2041	4,745	903,891	0.0
Series 4933, Class IO(g)	5.00%	03/15/2049	5,746	816,359	0.0
Series 4976, Class MI(g)	4.50%	05/25/2050	27,147	6,052,904	0.1
Series 4981, Class MI(g)	5.00%	06/25/2050	38,343	7,628,835	0.1
Series 4987, Class IC(g)	4.50%	06/25/2050	92,039	20,797,243	0.1
Series 4993, Class LI(g)	5.00%	07/25/2050	10,914	2,169,529	0.0
Series 5008, Class AI(g)	3.50%	09/25/2050	12,943	2,474,848	0.0
Series 5011, Class MI(g)	3.00%	09/25/2050	12,481	1,923,733	0.0
Series 5013, Class JI(g)	4.00%	09/25/2050	21,259	4,392,072	0.0
Series 5015, Class BI(g)	4.00%	09/25/2050	17,264	3,422,355	0.0
Series 5018, Class AI(g)	4.00%	10/25/2050	9,066	1,788,885	0.0
Series 5018, Class GI(g)	4.50%	10/25/2050	14,520	3,274,402	0.0
Series 5024, Class DI(g)	4.00%	10/25/2050	4,615	915,387	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 5030, Class EI(g)	3.50%	10/25/2050	USD 4,381	\$ 738,739	0.0%
Series 5036, Class IT(g)	4.00%	03/25/2050	6,059	1,236,535	0.0
Series 5040, Class AI(g)	3.50%	11/25/2050	1,843	306,033	0.0
Series 5043, Class IO(g)	5.00%	11/25/2050	12,242	2,752,275	0.0
Series 5049, Class CI(g)	3.50%	12/25/2050	20,830	3,778,920	0.0
Series 5052, Class IK(g)	4.00%	12/25/2050	18,646	3,730,166	0.0
Federal National Mortgage Association REMICS					
Series 2010-109, Class IM(g)	5.50%	09/25/2040	1,588	198,368	0.0
Series 2014-37, Class AI(g)	5.50%	07/25/2044	3,373	597,710	0.0
Series 2015-22, Class EI(g)	6.00%	04/25/2045	14,338	2,306,871	0.0
Series 2016-11, Class GI(g)	5.00%	03/25/2046	3,098	507,128	0.0
Series 2016-26, Class IO(g)	5.00%	05/25/2046	10,551	1,513,630	0.0
Series 2016-33, Class NI(g)	5.00%	07/25/2034	12,152	1,906,551	0.0
Series 2016-34, Class AI(g)	5.00%	06/25/2046	10,862	1,559,466	0.0
Series 2016-37, Class BI(g)	5.00%	06/25/2046	19,268	2,929,291	0.0
Series 2016-64, Class BI(g)	5.00%	09/25/2046	17,045	2,302,048	0.0
Series 2018-54, Class IO(g)	5.50%	08/25/2048	6,278	1,277,684	0.0
Series 2020-89, Class KI(g)	4.00%	12/25/2050	62,901	12,107,350	0.1
Series 2020-96, Class KI(g)	2.50%	01/25/2051	6,513	979,191	0.0
Series 2021-18, Class IT(g)	3.00%	04/25/2051	11,735	1,880,796	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2015-62, Class GI(g)	6.50%	05/20/2045	11,766	1,896,547	0.0
Series 2019-57, Class IO(g)	5.50%	05/20/2049	3,927	635,124	0.0
				<u>103,461,654</u>	<u>0.4</u>
				<u>343,720,182</u>	<u>1.4</u>
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
CHILE					
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.13%	02/02/2033	2,373	2,227,986	0.0
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	01/08/2034	19,472	19,246,855	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile	6.44%	01/26/2036	13,291	13,536,053	0.1
				<u>35,010,894</u>	<u>0.2</u>
UNGARN					
Magyar Export-Import Bank Zrt	6.13%	12/04/2027	6,506	6,537,879	0.0
INDONESIEN					
Indonesia Asahan Aluminium PT/ Mineral Industri Indonesia Persero PT	5.45%	05/15/2030	4,342	4,249,776	0.0
MEXIKO					
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	19,438	16,194,284	0.1
Comision Federal de Electricidad	3.88%	07/26/2033	10,400	8,489,000	0.0
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	34,937	32,884,451	0.2
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	63,276	49,127,486	0.2
Petroleos Mexicanos	6.49%	01/23/2027	10,352	9,675,911	0.1
Petroleos Mexicanos	6.50%	03/13/2027	6,902	6,437,150	0.0
Petroleos Mexicanos	6.70%	02/16/2032	15,163	12,231,992	0.1
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	48,445	30,762,575	0.1
				<u>165,802,849</u>	<u>0.8</u>
PANAMA					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	4.00%	08/11/2041	7,690	5,481,528	0.0
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	5.13%	08/11/2061	3,542	2,486,520	0.0
				<u>7,968,048</u>	<u>0.0</u>
SÜDAFRIKA					
Transnet SOC Ltd	8.25%	02/06/2028	17,800	17,699,875	0.1
TRINIDAD UND TOBAGO					
Trinidad Generation UnLtd	5.25%	11/04/2027	8,374	8,162,975	0.0
				<u>245,432,296</u>	<u>1.1</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Allwyn Entertainment Financing UK PLC	7.88%	04/30/2029	18,734	19,336,481	0.1
Melco Resorts Finance Ltd	5.38%	12/04/2029	12,622	11,413,317	0.1
Melco Resorts Finance Ltd	5.63%	07/17/2027	9,002	8,560,339	0.0
MGM China Holdings Ltd	5.25%	06/18/2025	8,970	8,793,201	0.1
MGM China Holdings Ltd	5.38%	05/15/2024	4,527	4,508,575	0.0
MGM China Holdings Ltd	5.88%	05/15/2026	4,869	4,783,403	0.0
Studio City Finance Ltd	5.00%	01/15/2029	30,884	26,946,290	0.1
Wynn Macau Ltd	4.88%	10/01/2024	953	945,376	0.0
Wynn Macau Ltd	5.50%	01/15/2026	30,257	29,350,500	0.1
Wynn Macau Ltd	5.50%	10/01/2027	4,203	3,982,342	0.0
Wynn Macau Ltd	5.63%	08/26/2028	16,758	15,699,397	0.1
				<u>134,319,221</u>	<u>0.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	4.75%	05/09/2027	USD 25,018	\$ 23,805,378	0.1%
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	5.13%	05/09/2029	19,409	18,383,817	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7.88%	09/15/2029	6,357	6,767,626	0.0
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	8.13%	09/15/2031	6,785	7,331,680	0.0
				<u>56,288,501</u>	<u>0.2</u>
ENERGIE					
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	5,318	5,204,661	0.0
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	12,964	12,414,290	0.1
				<u>17,618,951</u>	<u>0.1</u>
				<u>208,226,673</u>	<u>0.9</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.65%	02/10/2036	12,568	9,212,980	0.1
Benchmark Mortgage Trust, Series 2019-B11, Class XA(g)	1.00%	05/15/2052	212,423	7,486,480	0.0
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(g)	1.01%	11/15/2050	6,085	166,307	0.0
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(g)	0.95%	02/10/2050	94,988	1,960,086	0.0
Citigroup Commercial Mortgage Trust Series 2015-GC29, Class XA(g)	1.01%	04/10/2048	29,366	226,662	0.0
Series 2016-C3, Class XA(g)	0.98%	11/15/2049	154,513	3,178,974	0.0
Series 2016-P3, Class XA(g)	1.65%	04/15/2049	106,270	2,261,699	0.0
Series 2017-P7, Class XA(g)	1.08%	04/14/2050	75,274	1,932,724	0.0
Commercial Mortgage Trust Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	8,500	4,037,510	0.0
Series 2014-CR16, Class D	4.92%	04/10/2047	12,900	10,057,742	0.1
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	390	372,584	0.0
Series 2015-CR27, Class XA(g)	0.90%	10/10/2048	23,614	252,099	0.0
Series 2015-LC21, Class XA(g)	0.63%	07/10/2048	63,374	357,708	0.0
Series 2016-DC2, Class XA(g)	0.91%	02/10/2049	1,359	17,593	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(g)	1.15%	09/10/2050	21,038	644,874	0.0
GS Mortgage Securities Trust Series 2013-GC13, Class D	3.84%	07/10/2046	17,538	8,424,915	0.1
Series 2016-GS3, Class XA(g)	1.19%	10/10/2049	110,085	2,488,853	0.0
Series 2017-GS5, Class XA(g)	0.83%	03/10/2050	129,725	2,573,815	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(g)	1.08%	08/10/2050	79,977	2,215,747	0.0
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2012-C6, Class E	4.96%	05/15/2045	5,000	4,382,835	0.0
Series 2016-JP2, Class XA(g)	1.79%	08/15/2049	53,968	1,642,434	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	9,170	8,769,470	0.1
Series 2014-C22, Class XA(g)	0.77%	09/15/2047	44,305	37,849	0.0
Series 2014-C24, Class C	4.37%	11/15/2047	455	363,514	0.0
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2017-C5, Class XA(g)	0.87%	03/15/2050	124,943	2,342,917	0.0
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(g)	1.52%	07/12/2050	32,100	1,181,995	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust Series 2013-C9, Class B	3.71%	05/15/2046	3,701	3,386,593	0.0
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	4,304	3,791,294	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust Series 2017-C1, Class XA(g)	1.53%	06/15/2050	45,142	1,657,142	0.0
Series 2017-C2, Class XA(g)	1.07%	08/15/2050	36,221	1,029,747	0.0
Series 2017-C4, Class XA(g)	1.09%	10/15/2050	53,510	1,631,008	0.0
Series 2017-C6, Class XA(g)	1.15%	12/15/2050	30,848	977,481	0.0
Series 2018-C10, Class XA(g)	0.85%	05/15/2051	120,756	3,602,681	0.0
Series 2018-C15, Class XA(g)	0.88%	12/15/2051	66,673	2,228,274	0.0
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust, Series 2013-C6, Class D	3.95%	04/10/2046	7,157	6,116,646	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust Series 2015-LC20, Class XA(g)	1.28%	04/15/2050	30,121	259,427	0.0
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	5,156	4,955,798	0.0
Series 2016-C32, Class XA(g)	1.20%	01/15/2059	105,496	1,861,539	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(g)	1.61%	10/15/2049	75,664	2,311,069	0.0
Series 2016-LC25, Class XA(g)	0.82%	12/15/2059	116,413	2,108,257	0.0
Series 2017-C38, Class XA(g)	0.93%	07/15/2050	32,458	748,160	0.0
Series 2018-C48, Class XA(g)	0.93%	01/15/2052	11,254	387,039	0.0
WFRBS Commercial Mortgage Trust Series 2011-C4, Class E	4.98%	06/15/2044	8,030	6,263,221	0.0
Series 2013-C11, Class B	3.71%	03/15/2045	539	496,366	0.0
Series 2014-C22, Class XA(g)	0.76%	09/15/2057	35,485	60,931	0.0
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	6,846	6,538,109	0.0
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	9,035	8,318,162	0.1
Series 2014-LC14, Class C	4.34%	03/15/2047	194	193,012	0.0
				<u>135,512,322</u>	<u>0.5</u>

	Zinssatz	Datum	Kontrakte/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class D(d)	9.92%	05/15/2036	USD 9,789	\$ 9,281,736	0.1%
Starwood Retail Property Trust, Series 2014-STAR, Class A(d)	8.50%	11/15/2027	33,050	24,159,208	0.1
				<u>33,440,944</u>	<u>0.2</u>
				<u>168,953,266</u>	<u>0.7</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
RUMÄNIEN					
Romanian Government International Bond	5.88%	01/30/2029	22,930	22,753,439	0.1
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	16,444	14,856,126	0.1
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN					
OPTIONEN AUF AKTIENINDIZES					
Dual Digital Option S&P 500 USISSO05					
Expiration: Mar 2024, Exercise Price: 4,128.89(h)			28,571,429	29	0.0
				<u>23,078,907,723</u>	<u>96.9</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class D(d)	8.43%	07/20/2034	USD 6,000	5,912,808	0.0
AGL CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class D(d)	8.68%	01/20/2035	5,550	5,487,074	0.0
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(d)	11.78%	04/15/2033	2,248	2,163,984	0.0
Ballyrock CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class C(d)	8.48%	07/20/2034	3,000	2,933,559	0.0
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class C(d)	8.63%	10/20/2034	13,950	13,725,977	0.1
Cbam Ltd., Series 2018-7A, Class B1(d)	7.18%	07/20/2031	7,726	7,719,819	0.0
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(d)	11.86%	07/18/2030	4,717	4,393,181	0.0
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class A2(d)	7.38%	07/21/2031	7,424	7,408,046	0.0
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class D(d)	8.63%	04/15/2034	8,000	7,865,120	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class CR(d)	7.48%	10/16/2033	12,000	11,902,692	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class D(d)	8.38%	07/16/2035	4,000	3,861,688	0.0
Northwoods Capital XII-B Ltd., Series 2018-12BA, Class B(d)	7.50%	06/15/2031	5,400	5,347,917	0.0
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(d)	10.78%	01/20/2031	2,750	2,468,513	0.0
Octagon Investment Partners 38 Ltd., Series 2018-1A, Class B(d)	7.53%	07/20/2030	3,900	3,867,080	0.0
OHA Credit Partners XI Ltd., Series 2015-11A, Class A1R(d)	6.73%	01/20/2032	6,000	6,007,710	0.0
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class B(d)	7.13%	04/15/2031	3,000	2,992,521	0.0
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class D(d)	8.53%	10/20/2034	27,675	27,457,530	0.1
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class D(d)	8.61%	10/18/2034	16,000	15,205,856	0.1
Signal Peak CLO 12 Ltd., Series 2022-12A, Class D(d)	10.12%	07/18/2034	4,550	4,561,020	0.0
TICP CLO IX Ltd., Series 2017-9A, Class B(d)	7.18%	01/20/2031	1,550	1,550,085	0.0
Venture XXIX CLO Ltd., Series 2017-29A, Class C(d)	8.07%	09/07/2030	2,300	2,279,229	0.0
Voya CLO Ltd., Series 2016-3A, Class BR(d)	7.76%	10/18/2031	10,000	9,885,720	0.1
				<u>154,997,129</u>	<u>0.5</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Sealed Air Corp./Sealed Air Corp. US	6.13%	02/01/2028	8,825	8,806,442	0.0
INVESTITIONSGÜTER					
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	7.25%	01/15/2031	5,710	5,918,335	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Six Flags Entertainment Corp.	7.25%	05/15/2031	18,374	18,489,059	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc					
	4.88%	07/01/2031	2,742	2,419,820	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	19,163	18,386,008	0.1
				<u>20,805,828</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Wolverine World Wide, Inc.	4.00%	08/15/2029	7,890	6,323,985	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Emergent BioSolutions, Inc.	3.88%	08/15/2028	1,537	632,801	0.0
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	7,135	7,002,019	0.0
				<u>7,634,820</u>	<u>0.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ENERGIE					
EQM Midstream Partners LP	4.50%	01/15/2029	USD 18,035	\$ 16,881,035	0.1%
Hess Midstream Operations LP	4.25%	02/15/2030	206	187,521	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	7,941	7,672,241	0.0
				<u>24,740,797</u>	<u>0.1</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The)	4.88%	07/15/2032	1,314	1,190,835	0.0
Block, Inc.	3.50%	06/01/2031	5,810	4,958,560	0.0
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	7,706	7,480,184	0.0
				<u>13,629,579</u>	<u>0.0</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	30,569	22,069,733	0.1
				<u>128,418,578</u>	<u>0.4</u>
FINANZINSTITUTE					
MAKLER					
NFP Corp.	4.88%	08/15/2028	8,605	8,581,547	0.0
				<u>137,000,125</u>	<u>0.4</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust, Series 2016-UB10, Class C	4.82%	07/15/2049	2,354	2,192,449	0.0
Commercial Mortgage Trust Series 2012-CR3, Class D	4.29%	10/15/2045	3,971	2,410,129	0.0
Series 2012-CR3, Class E	4.29%	10/15/2045	2,959	1,331,477	0.0
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	3,622	3,546,728	0.0
Series 2015-PC1, Class C	4.28%	07/10/2050	11,346	10,289,535	0.1
Grantor Trust CGCMT(i)	4.49%	09/15/2048	105	5,472,863	0.0
Grantor Trust CMBSIT(i)	0.00%	11/10/2046	149	5,699,954	0.0
Grantor Trust COMM(i)	0.00%	03/10/2047	142	3,102,262	0.0
Grantor Trust CSAIL(i)	4.00%	04/15/2050	207	4,701,420	0.0
Grantor Trust JPMBB(i)	4.00%	11/15/2047	222	3,376,561	0.0
Grantor Trust WFRBS(i)	3.40%	10/15/2057	126	2,547,927	0.0
GS Mortgage Securities Trust(i)	3.49%	07/10/2046	112	2,557,681	0.0
GS Mortgage Securities Trust(i)	2.16%	07/10/2046	50	615,709	0.0
Series 2011-GC5, Class D	5.15%	08/10/2044	3,699	1,341,149	0.0
Series 2014-GC22, Class C	4.68%	06/10/2047	993	611,743	0.0
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2012-LC9, Class E	3.77%	12/15/2047	10,881	8,214,800	0.1
Series 2013-LC11, Class B	3.50%	04/15/2046	11,410	9,896,149	0.1
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2014-C24, Class B	4.12%	11/15/2047	1,355	1,200,333	0.0
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust, Series 2013-C5, Class C	3.76%	03/10/2046	1,798	1,487,529	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust Series 2015-C28, Class B	4.08%	05/15/2048	2,802	2,610,125	0.0
Series 2015-LC20, Class C	4.06%	04/15/2050	7,415	6,898,290	0.0
WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2012-C9, Class E	4.88%	11/15/2045	5,000	4,544,769	0.0
				<u>84,649,582</u>	<u>0.3</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
First Quantum Minerals Ltd.	8.63%	06/01/2031	27,741	26,514,570	0.1
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	30,147	28,859,723	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Falabella SA.	3.38%	01/15/2032	22,083	16,961,400	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Tonon Luxembourg SA(j)	6.50%	10/31/2024	4,600	460	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(i) (k)	10.50%	01/28/2018	3,700	370	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(i) (k)	11.75%	02/09/2022	31,238	3,124	0.0
				<u>3,954</u>	<u>0.0</u>
				<u>72,339,647</u>	<u>0.3</u>
FINANZINSTITUTE					
SONSTIGE FINANZWERTE					
OEC Finance Ltd.(b)	4.38%	10/25/2029	5,514	220,545	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Chile Electricity PEC SpA.....	0.00%	01/25/2028	USD 5,495	\$ 4,305,333	0.0%
STAATSANLEIHEN					
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond.....	8.99%	02/01/2026	10,000	3,198,100	0.0
				<u>80,063,625</u>	<u>0.3</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
State of California, Series 2010.....	7.60%	11/01/2040	1,600	1,962,329	0.0
State of Illinois, Series 2010.....	7.35%	07/01/2035	6,579	7,096,348	0.0
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021.....	5.75%	07/25/2041	15,000	13,316,133	0.1
				<u>22,374,810</u>	<u>0.1</u>
ABS-ANLEIHEN					
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2019-2A, Class C.....	4.24%	09/22/2025	4,000	3,965,988	0.0
Flagship Credit Auto Trust Series 2019-1, Class E.....	5.06%	06/15/2026	5,339	5,286,442	0.0
Series 2019-2, Class E.....	4.52%	12/15/2026	5,677	5,565,515	0.1
Series 2019-3, Class E.....	3.84%	12/15/2026	5,230	5,077,022	0.0
				<u>19,894,967</u>	<u>0.1</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
UKRAINE					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC.....	7.63%	11/08/2028	14,994	7,960,877	0.0
State Agency of Roads of Ukraine.....	6.25%	06/24/2030	22,184	5,854,580	0.0
				<u>13,815,457</u>	<u>0.0</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
PMT Credit Risk Transfer Trust Series 2019-3R, Class A(d).....	9.14%	11/27/2031	3,737	3,728,758	0.0
Series 2020-1R, Class A(d).....	8.79%	02/25/2025	9,854	9,782,263	0.1
				<u>13,511,021</u>	<u>0.1</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
INVESTITIONSGÜTER					
Regal Rexnord Corp.....	6.30%	02/15/2030	7,050	7,173,379	0.0
ENERGIE					
Continental Resources, Inc./OK.....	2.88%	04/01/2032	4,361	3,502,267	0.0
				<u>10,675,646</u>	<u>0.0</u>
STAMMAKTIEN					
FINANZWERTE					
VERSICHERUNGEN					
Mt. Logan Re, Ltd. Special Investment, Series 1, December 2021 - Class U-1(i).....			10,878	3,131,192	0.0
				<u>540,113,554</u>	<u>1.8</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$25,708,531,016).....				\$ 23,619,021,277	98.7%
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(l).....	2.90 %	–		7,509	0.0
ANZ, London(l).....	3.15 %	–		355,035	0.0
BNP Paribas, Paris(l).....	2.58 %	–		185,243	0.0
HSBC, Hong Kong(l).....	2.69 %	–		7,093,309	0.0
HSBC, London(l).....	4.15 %	–		394,170	0.0
HSBC, Paris(l).....	2.86 %	–		57,240	0.0
JPMorgan Chase, New York(l).....	4.68 %	–		187,909,390	0.8
MUFG, Tokyo(l).....	(0.36)%	–		51	0.0
Scotiabank, Toronto(l).....	3.83 %	–		54,886	0.0
Standard Chartered Bank, Johannesburg(l).....	6.65 %	–		5,761,694	0.0
				<u>201,818,527</u>	<u>0.8</u>
Termineinlagen insgesamt.....					
				<u>101,160,354</u>	<u>0.5</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten.....					
				\$ 23,922,000,158	100.0%
Nettovermögen.....					

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
U.S. Long Bond (CBT) Futures	06/18/2024	7,005	\$ 830,749,219	\$ 835,346,250	\$ 4,597,031
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	06/28/2024	25,230	5,161,829,646	5,165,842,500	4,012,854
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	06/28/2024	47,198	5,039,912,625	5,045,761,188	5,848,562
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	06/18/2024	13,182	1,455,298,969	1,455,787,125	488,156
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Futures	06/18/2024	2,259	257,107,328	257,914,266	(806,937)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures+	06/18/2024	50	5,521,094	5,521,875	(781)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	06/18/2024	2,669	338,382,484	341,298,375	(2,915,891)
					\$ 11,222,994
				Wertsteigerung	\$ 14,946,603
				Wertminderung	\$ (3,723,609)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CAD 293,644	USD 217,523	03/04/2024	\$ 1,154,688
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CHF 29,355	USD 33,829	03/04/2024	634,035
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CHF 9,739	USD 10,995	03/04/2024	(17,150)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	EUR 246,242	USD 266,727	03/04/2024	588,681
Brown Brothers Harriman & Co.+.	EUR 247,106	USD 265,899	03/04/2024	(1,173,338)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	JPY 4,516,363	USD 30,633	03/04/2024	508,019
Brown Brothers Harriman & Co.+.	JPY 4,458,449	USD 29,610	03/04/2024	(129,215)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	NZD 495,333	USD 302,799	03/04/2024	1,215,562
Brown Brothers Harriman & Co.+.	NZD 506,881	USD 307,500	03/04/2024	(1,114,711)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	SGD 526,189	USD 392,813	03/04/2024	1,754,781
Brown Brothers Harriman & Co.+.	SGD 527,230	USD 390,987	03/04/2024	(845,241)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 217,925	CAD 293,644	03/04/2024	(1,557,649)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 10,995	CHF 9,739	03/04/2024	17,150
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 33,850	CHF 29,355	03/04/2024	(655,377)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 395,317	EUR 367,203	03/04/2024	1,555,335
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 136,842	EUR 126,145	03/04/2024	(504,213)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 14,865	JPY 2,235,423	03/04/2024	45,659
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 45,487	JPY 6,739,388	03/04/2024	(533,280)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 302,264	NZD 498,299	03/04/2024	1,125,604
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 308,412	NZD 503,915	03/04/2024	(1,603,526)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 197,703	SGD 266,958	03/04/2024	697,457
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 586,366	SGD 786,461	03/04/2024	(1,875,382)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 4,310	ZAR 83,115	03/04/2024	23,677
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 268,245	ZAR 5,088,534	03/04/2024	(2,941,027)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	ZAR 3,823,033	USD 201,538	03/04/2024	2,214,339
Brown Brothers Harriman & Co.+.	ZAR 1,348,616	USD 70,292	03/04/2024	(22,010)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	AUD 1,019,819	USD 665,934	03/11/2024	2,912,992
Brown Brothers Harriman & Co.+.	AUD 1,024,025	USD 661,263	03/11/2024	(4,492,869)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CAD 361,715	USD 267,582	03/11/2024	1,029,018
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CNH 25,915	USD 3,601	03/11/2024	2,097
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CNH 140	USD 19	03/11/2024	(59)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	GBP 190,576	USD 240,635	03/11/2024	62,270
Brown Brothers Harriman & Co.+.	GBP 190,637	USD 240,027	03/11/2024	(622,771)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 663,938	AUD 1,028,151	03/11/2024	4,499,223
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 1,342,247	AUD 2,056,026	03/11/2024	(5,550,541)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 103	CAD 140	03/11/2024	9
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 401,709	CAD 542,322	03/11/2024	(2,064,305)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 3,016	CNH 21,741	03/11/2024	3,157
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 144,216	CNH 1,036,923	03/11/2024	(235,793)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 477,363	GBP 379,031	03/11/2024	1,105,954
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 244,550	GBP 193,671	03/11/2024	(69,453)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CAD 430	USD 318	03/25/2024	1,227
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CNH 23,483	USD 3,265	03/25/2024	1,104
Brown Brothers Harriman & Co.+.	EUR 614	USD 666	03/25/2024	1,602
Brown Brothers Harriman & Co.+.	GBP 389	USD 492	03/25/2024	1,144
Brown Brothers Harriman & Co.+.	PLN 348	USD 88	03/25/2024	406
Brown Brothers Harriman & Co.+.	SGD 152	USD 113	03/25/2024	201
Brown Brothers Harriman & Co.+.	SGD 181	USD 134	03/25/2024	(72)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 1,961	AUD 3,017	03/25/2024	1,079
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 547,119	AUD 834,156	03/25/2024	(4,550,708)

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 103	CAD 140	03/25/2024	\$ 11
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 131,778	CAD 178,172	03/25/2024	(452,541)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 745	CNH 5,366	03/25/2024	925
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 146,712	CNH 1,053,691	03/25/2024	(259,464)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 137,711	EUR 127,284	03/25/2024	(23,074)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 234,453	GBP 185,669	03/25/2024	(52,633)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 21,123	PLN 84,423	03/25/2024	14,281
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 136	PLN 540	03/25/2024	(674)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 585	SGD 787	03/25/2024	171
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 220,414	SGD 295,885	03/25/2024	(305,497)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 3,313	ZAR 64,060	03/25/2024	21,419
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 38,319	ZAR 723,302	03/25/2024	(675,969)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR 7,043	USD 366	03/25/2024	(1,067)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CAD 547	USD 403	04/02/2024	10
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CHF 935	USD 1,068	04/02/2024	7,046
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 125	USD 135	04/02/2024	387
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY 16,398	USD 109	04/02/2024	(581)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD 619	USD 377	04/02/2024	224
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 181	USD 134	04/02/2024	(75)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 53,704	CAD 72,832	04/02/2024	(15,360)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 10,930	CHF 9,593	04/02/2024	(47,005)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 133,886	EUR 123,642	04/02/2024	(91,217)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 14,840	JPY 2,227,176	04/02/2024	85,834
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 153,799	NZD 252,484	04/02/2024	(70,579)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 195,293	SGD 262,630	04/02/2024	149,568
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 70,288	ZAR 1,351,832	04/02/2024	16,738
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR 6,973	USD 362	04/02/2024	(1,044)
				<u>\$ (11,102,386)</u>
			Wertsteigerung	\$ 21,453,084
			Wertminderung	\$ (32,555,470)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschlussdatum	Nominalbetrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Verkaufskontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHYS41V2-5Y	12/20/2028	USD 1,100,118	\$ 69,864,658	\$ 63,778,586

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominalbetrag (000)	Abschlussdatum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 715,000	03/24/2024	1 Day SOFR	9.000%	\$ (438,537)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 600,000	09/29/2028	4.455%	1 Day SOFR	(10,069,524)
Insgesamt					<u>\$ (10,508,061)</u>

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschlussdatum	Nominalbetrag (000)	Marktwert	Vorabgebühren bezahlt/(erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 11,516	\$ (1,453,363)	\$ (162,280)	\$ (1,291,083)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,692	(970,730)	(1,687,176)	716,446
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(1,276,236)	694,891
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(1,266,104)	684,759
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,769	(728,077)	(1,278,215)	550,138
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,769	(728,077)	(1,265,433)	537,356
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(674,060)	383,387
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,077	(388,280)	(736,381)	348,101
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(627,908)	337,235
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,910	(872,018)	(891,705)	19,687
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 118	(14,941)	(13,162)	(1,779)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 387	\$ (48,833)	\$ (46,338)	\$ (2,495)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 169	(21,277)	(18,673)	(2,604)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 143	(18,080)	(8,027)	(10,053)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 921	(116,269)	(83,934)	(32,335)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 890	(112,374)	(50,665)	(61,709)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(181,170)	(109,503)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,764	(348,807)	(205,699)	(143,108)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(424,851)	(156,494)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(423,777)	(157,568)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(418,689)	(162,656)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(127,539)	(163,134)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(415,867)	(165,478)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(358,115)	(223,230)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,910	(872,018)	(577,215)	(294,803)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,463	(543,266)	(250,066)	(313,200)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(262,108)	(319,237)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(252,132)	(329,213)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,910	(872,018)	(511,625)	(360,393)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,908	(1,124,148)	(699,116)	(425,032)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,084	(1,020,188)	(450,816)	(569,372)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,323	(1,050,316)	(473,550)	(576,766)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 13,820	(1,744,035)	(1,034,413)	(709,622)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 11,516	(1,453,363)	(198,079)	(1,255,284)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,078	(136,035)	(12,513)	(123,522)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(293,035)	2,362
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(578,271)	(3,074)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 146	(18,487)	(13,721)	(4,766)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(282,833)	(7,840)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,880	(237,305)	(176,126)	(61,179)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,346	(800,861)	(685,309)	(115,552)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,916	(241,782)	(121,296)	(120,486)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,976	(249,397)	(126,805)	(122,592)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,205	(656,920)	(504,803)	(152,117)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(322,050)	(259,295)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,138	(648,433)	(332,763)	(315,670)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,949	(1,129,321)	(585,989)	(543,332)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 9,213	(1,162,690)	(532,141)	(630,549)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(644,420)	63,075
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(634,922)	53,577
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(633,448)	52,103
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(629,690)	48,345
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(317,461)	26,788
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(278,541)	(12,132)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,972	(375,084)	(355,918)	(19,166)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,612	(203,471)	(158,506)	(44,965)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(237,116)	(53,557)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(227,257)	(63,416)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(226,984)	(63,689)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(512,969)	(68,376)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(209,834)	(80,839)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,994	(377,874)	(295,788)	(82,086)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(198,376)	(92,297)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(182,632)	(108,041)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(431,280)	(150,065)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,929	(748,191)	(372,863)	(375,328)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,910	(872,018)	(383,357)	(488,661)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 13,820	(1,744,035)	(1,086,604)	(657,431)
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,303	(290,673)	(293,035)	2,362
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,547	(447,636)	(420,813)	(26,823)
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,008	(379,560)	(187,148)	(192,412)
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(64,692)	(516,653)
Morgan Stanley & Co., International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,607	(581,345)	(45,043)	(536,302)
Insgesamt				\$ (40,355,228)	\$ (30,947,476)	\$ (9,407,752)
					Wertsteigerung	\$ 4,520,612
					Wertminderung	\$ (13,928,364)
Swaps insgesamt						\$ 43,862,773

- (a) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.
- (b) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (c) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (d) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 29. Februar 2024.
- (e) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 29. Februar 2024.
- (f) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (g) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (h) Ein Vertrag bezieht sich auf 1 Aktie.
- (i) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (j) Not leidend.
- (k) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (l) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

- CBT – Chicago Board of Trade
- CDX-CMBX.NA. – North American Commercial Mortgage-Backed Index
- CLO – Collateralized Loan Obligations
- CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities
- INTRCONX – Intercontinental Exchange
- JSC – Joint Stock Company
- LCH – London Clearing House
- LP – Limited Partnership
- REIT – Real Estate Investment Trust
- REMICS – Real Estate Mortgage Investment Conduits
- SOFR – Secured Overnight Financing Rate

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Agps Bondco PLC	6.00%	08/05/2025	EUR 6,100	€ 2,507,226	0.2%
Ahlstrom Holding 3 Oy	3.63%	02/04/2028	1,899	1,776,633	0.2
Constellium SE	3.13%	07/15/2029	4,860	4,494,154	0.4
Fiber Bidco SpA(a)	7.97%	01/15/2030	2,300	2,317,534	0.2
Fiber Bidco SpA.	11.00%	10/25/2027	1,538	1,676,391	0.1
Guala Closures SpA(a)	7.93%	06/29/2029	5,440	5,495,832	0.5
INEOS Finance PLC	6.38%	04/15/2029	6,500	6,500,000	0.6
INEOS Quattro Finance 2 PLC	8.50%	03/15/2029	4,006	4,197,928	0.4
INEOS Styrolution Ludwigshafen GmbH	2.25%	01/16/2027	3,800	3,487,354	0.3
Italmatch Chemicals SpA.	10.00%	02/06/2028	4,478	4,698,454	0.4
Itelyum Regeneration SpA.	4.63%	10/01/2026	2,720	2,648,201	0.2
Monitchem HoldCo 3 SA.	8.75%	05/01/2028	2,970	3,113,378	0.3
Monitchem HoldCo 3 SA(a)	9.18%	05/01/2028	2,540	2,579,764	0.2
Reno de Medici SpA(a)	9.18%	12/14/2026	3,370	3,383,755	0.3
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	4.38%	11/01/2026	3,900	3,855,709	0.3
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	9.50%	07/15/2028	595	646,769	0.1
SNF Group SACA	2.63%	02/01/2029	2,480	2,290,647	0.2
Vallourec SACA.	8.50%	06/30/2026	3,800	3,810,386	0.3
WEPA Hygieneprodukte GmbH	5.63%	01/15/2031	2,323	2,338,393	0.2
				<u>61,818,508</u>	<u>5.4</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	2.13%	08/15/2026	4,880	4,396,587	0.4
Derichebourg SA	2.25%	07/15/2028	1,800	1,652,482	0.1
EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer, Inc.	6.38%	12/15/2030	2,522	2,650,337	0.2
IMA Industria Macchine Automatiche SpA.	3.75%	01/15/2028	2,410	2,299,756	0.2
Paprec Holding SA.	3.50%	07/01/2028	3,880	3,673,493	0.3
Paprec Holding SA.	7.25%	11/17/2029	3,043	3,226,139	0.3
PCF GmbH(a)	8.69%	04/15/2026	2,920	2,365,556	0.2
Titan Holdings II BV	5.13%	07/15/2029	4,200	3,679,486	0.3
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	1,728	1,672,381	0.1
				<u>25,616,217</u>	<u>2.1</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Altice Finco SA	4.75%	01/15/2028	2,047	1,721,915	0.1
Banjay Entertainment SASU	7.00%	05/01/2029	1,243	1,302,042	0.1
UPCB Finance VII Ltd.	3.63%	06/15/2029	1,900	1,822,079	0.2
Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC	4.88%	07/15/2028	GBP 3,879	4,029,613	0.3
Ziggo Bond Co. BV	3.38%	02/28/2030	EUR 5,350	4,587,749	0.4
				<u>13,463,398</u>	<u>1.1</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France Holding SA	8.00%	05/15/2027	1,500	856,679	0.1
Altice France SA/France	5.88%	02/01/2027	2,325	2,093,218	0.2
Iliad Holding SASU.	5.13%	10/15/2026	3,650	3,612,444	0.3
Lorca Telecom Bondco SA	4.00%	09/18/2027	775	760,723	0.1
Telecom Italia SpA/Milano	6.88%	02/15/2028	4,023	4,265,596	0.4
Telecom Italia SpA/Milano	7.88%	07/31/2028	2,643	2,910,232	0.2
Telefonica Europe BV(b)	6.14%	02/03/2030	8,400	8,536,866	0.7
Telefonica Europe BV(b)	7.13%	08/23/2028	1,200	1,287,182	0.1
United Group BV	3.13%	02/15/2026	2,110	2,048,263	0.2
United Group BV	6.75%	02/15/2031	444	450,823	0.0
United Group BV(a)	8.13%	02/15/2031	1,331	1,331,496	0.1
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.00%	01/31/2029	GBP 8,900	9,043,691	0.8
Vodafone Group PLC.	4.88%	10/03/2078	7,600	8,656,996	0.7
Vodafone Group PLC, Series E	6.50%	08/30/2084	EUR 1,655	1,760,633	0.2
				<u>47,614,842</u>	<u>4.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Dana Financing Luxembourg SARL	3.00%	07/15/2029	1,760	1,564,418	0.1
Dana Financing Luxembourg SARL	8.50%	07/15/2031	1,871	2,051,458	0.2
Forvia SE	7.25%	06/15/2026	567	597,596	0.1
Goodyear Europe BV	2.75%	08/15/2028	3,000	2,698,827	0.2
IHO Verwaltungs GmbH(c)	8.75%	05/15/2028	3,125	3,386,096	0.3
ZF Europe Finance BV	3.00%	10/23/2029	900	820,866	0.1
ZF Europe Finance BV, Series E	4.75%	01/31/2029	1,300	1,294,591	0.1
ZF Europe Finance BV, Series E	6.13%	03/13/2029	1,100	1,153,273	0.1
ZF Finance GmbH, Series E	3.75%	09/21/2028	2,600	2,488,895	0.2
				<u>16,056,020</u>	<u>1.4</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	7.63%	03/01/2026	EUR 2,610	€ 2,658,885	0.2%
CPUK Finance Ltd.	4.50%	08/28/2027	GBP 4,577	4,805,693	0.4
CPUK Finance Ltd.	4.88%	08/28/2025	2,050	2,339,610	0.2
Deuce Finco PLC(a)	8.68%	06/15/2027	EUR 5,630	5,679,273	0.5
Loarre Investments SARL	6.50%	05/15/2029	3,460	3,454,133	0.3
Motion Finco SARL	7.38%	06/15/2030	3,770	3,916,679	0.3
Pinnacle Bidco PLC.	10.00%	10/11/2028	GBP 1,409	1,727,896	0.1
				<u>24,582,169</u>	<u>2.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Accor SA(b)	2.63%	01/30/2025	EUR 2,600	2,541,500	0.2
Accor SA(b)	7.25%	01/11/2029	2,500	2,724,949	0.2
Cirsa Finance International SARL	4.50%	03/15/2027	1,750	1,710,031	0.1
Cirsa Finance International SARL	6.50%	03/15/2029	1,711	1,732,156	0.1
Cirsa Finance International SARL	10.38%	11/30/2027	1,503	1,623,053	0.1
Kier Group PLC.	9.00%	02/15/2029	GBP 2,402	2,824,427	0.2
Lottomatica SpA/Roma	7.13%	06/01/2028	EUR 1,750	1,851,967	0.2
Lottomatica SpA/Roma(a)	7.94%	12/15/2030	300	304,473	0.0
Lottomatica SpA/Roma(a)	8.07%	06/01/2028	300	303,546	0.0
Maison Finco PLC	6.00%	10/31/2027	GBP 6,013	6,377,371	0.5
Miller Homes Group Finco PLC	7.00%	05/15/2029	1,870	2,027,404	0.2
Miller Homes Group Finco PLC(a)	9.15%	05/15/2028	EUR 5,826	5,796,768	0.5
NH Hotel Group SA	4.00%	07/02/2026	3,987	3,963,847	0.3
Playtech PLC	5.88%	06/28/2028	2,940	2,939,089	0.3
Standard Industries, Inc./NJ	2.25%	11/21/2026	1,900	1,772,213	0.2
TVL Finance PLC(a)	9.43%	04/28/2028	2,800	2,832,863	0.2
				<u>41,325,657</u>	<u>3.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
Burger King France SAS(a)	8.65%	11/01/2026	2,484	2,505,056	0.2
Punch Finance PLC	6.13%	06/30/2026	GBP 2,800	3,160,560	0.3
				<u>5,665,616</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Affelou SAS(a)	11.92%	05/19/2027	EUR 2,590	2,522,391	0.2
B&M European Value Retail SA	4.00%	11/15/2028	GBP 1,069	1,158,432	0.1
B&M European Value Retail SA	8.13%	11/15/2030	2,848	3,547,674	0.3
Birkenstock Financing SARL	5.25%	04/30/2029	EUR 5,510	5,457,062	0.5
CT Investment GmbH	5.50%	04/15/2026	1,790	1,777,957	0.2
Goldstory SAS	6.75%	02/01/2030	550	552,138	0.0
Shiba Bidco SpA	4.50%	10/31/2028	3,529	3,361,720	0.3
				<u>18,377,374</u>	<u>1.6</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Bellis Acquisition Co. PLC	4.50%	02/16/2026	GBP 4,659	5,241,429	0.4
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	EUR 2,548	2,463,960	0.2
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	4.38%	01/15/2028	2,446	2,377,615	0.2
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	7.50%	05/15/2030	2,240	2,363,048	0.2
Ephios Subco 3 SARL	7.88%	01/31/2031	1,054	1,123,668	0.1
Grifols SA	3.88%	10/15/2028	5,357	4,554,373	0.4
Gruenthal GmbH	6.75%	05/15/2030	4,080	4,336,023	0.4
Iceland Bondco PLC(a)	9.40%	12/15/2027	1,649	1,662,638	0.1
Iceland Bondco PLC	10.88%	12/15/2027	GBP 828	1,025,757	0.1
International Design Group SpA	10.00%	11/15/2028	EUR 1,600	1,652,632	0.1
IQVIA, Inc.	2.88%	06/15/2028	1,350	1,266,156	0.1
Market Bidco Finco PLC	5.50%	11/04/2027	GBP 1,640	1,741,986	0.2
Nidda Healthcare Holding GmbH	7.50%	08/21/2026	EUR 1,490	1,541,078	0.1
Nomad Foods Bondco PLC	2.50%	06/24/2028	2,820	2,603,636	0.2
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV	2.88%	04/30/2028	1,890	1,751,225	0.2
Picard Bondco SA	5.38%	07/01/2027	1,793	1,748,990	0.2
Primo Water Holdings, Inc.	3.88%	10/31/2028	2,770	2,660,668	0.2
Versuni Group BV	3.13%	06/15/2028	2,250	1,940,956	0.2
				<u>42,055,838</u>	<u>3.6</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Azelis Finance NV	5.75%	03/15/2028	3,240	3,334,747	0.3
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	1,960	1,889,106	0.2
Manuchar Group SARL	7.25%	06/30/2027	1,800	1,736,576	0.2
Multiversity SRL(a)	8.14%	10/30/2028	3,450	3,458,905	0.3
Rexel SA	5.25%	09/15/2030	1,600	1,644,882	0.1
SIG PLC.	5.25%	11/30/2026	6,954	6,569,192	0.6
				<u>18,633,408</u>	<u>1.7</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.88%	06/01/2028	GBP 1,364	1,397,699	0.1
APCOA Parking Holdings GmbH	4.63%	01/15/2027	EUR 4,165	4,069,513	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
Elior Group SA	3.75%	07/15/2026	EUR 1,972	€ 1,834,729	0.2%
Engineering - Ingegneria Informatica - SpA	5.88%	09/30/2026	1,830	1,790,037	0.2
Engineering - Ingegneria Informatica - SpA	11.13%	05/15/2028	2,130	2,292,914	0.2
House of HR Group BV	9.00%	11/03/2029	2,000	2,086,756	0.2
Q-Park Holding I BV	2.00%	03/01/2027	1,240	1,157,771	0.1
Q-Park Holding I BV	5.13%	03/01/2029	2,344	2,353,278	0.2
Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH	6.00%	07/30/2026	3,449	3,441,446	0.3
TUI AG	5.88%	03/15/2029	800	788,224	0.1
				<u>21,212,367</u>	<u>1.9</u>
TECHNOLOGIE					
Boxer Parent Co., Inc.	6.50%	10/02/2025	2,256	2,256,103	0.2
Cedacri Mergeco SpA(a)	8.53%	05/15/2028	7,968	7,951,467	0.7
iliad SA	5.38%	02/15/2029	1,000	1,012,712	0.1
iliad SA	5.63%	02/15/2030	1,200	1,228,868	0.1
IPD 3 BV	8.00%	06/15/2028	3,756	3,977,400	0.3
TeamSystem SpA	3.50%	02/15/2028	1,860	1,767,956	0.2
TeamSystem SpA(a)	7.69%	02/15/2028	1,940	1,942,166	0.2
				<u>20,136,672</u>	<u>1.8</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	5.25%	10/15/2026	2,648	2,636,343	0.2
Avis Budget Finance PLC	7.00%	02/28/2029	3,000	2,992,101	0.3
Avis Budget Finance PLC	7.25%	07/31/2030	1,097	1,104,511	0.1
Boels Topholding BV	6.25%	02/15/2029	2,250	2,338,623	0.2
Gatwick Airport Finance PLC	4.38%	04/07/2026	5,600	6,296,374	0.5
Kapla Holding SAS	3.38%	12/15/2026	EUR 4,922	4,751,964	0.4
Kapla Holding SAS(a)	7.38%	07/31/2030	1,642	1,640,957	0.1
Loxam SAS	5.75%	07/15/2027	2,020	2,020,755	0.2
Loxam SAS	6.38%	05/31/2029	1,105	1,143,613	0.1
Loxam SAS, Series E	6.38%	05/15/2028	2,280	2,359,876	0.2
				<u>27,285,117</u>	<u>2.3</u>
				<u>383,843,203</u>	<u>32.8</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Abanca Corp. Bancaria SA, Series E	8.38%	09/23/2033	1,300	1,420,970	0.1
AIB Group PLC(b)	6.25%	06/23/2025	1,287	1,274,438	0.1
Banco de Sabadell SA(b)	5.00%	05/19/2027	2,000	1,750,486	0.2
Banco de Sabadell SA, Series E	5.63%	05/06/2026	7,100	7,294,316	0.6
Banco Santander SA(b)	4.38%	01/14/2026	6,800	6,213,500	0.5
Bank of Ireland Group PLC(b)	7.50%	05/19/2025	2,854	2,876,146	0.2
Bankinter SA(b)	6.25%	01/17/2026	3,800	3,765,678	0.3
BPER Banca, Series E	6.13%	02/01/2028	1,485	1,572,254	0.1
CaixaBank SA(b)	5.25%	03/23/2026	3,800	3,582,431	0.3
Raiffeisen Bank International AG(b)	6.00%	06/15/2026	2,400	2,263,448	0.2
Virgin Money UK PLC(b)	8.25%	06/17/2027	GBP 1,344	1,474,991	0.1
				<u>33,488,658</u>	<u>2.7</u>
MAKLER					
Kane Bidco Ltd.	6.50%	02/15/2027	1,953	2,220,138	0.2
Sherwood Financing PLC	6.00%	11/15/2026	2,730	2,856,257	0.2
				<u>5,076,395</u>	<u>0.4</u>
FINANZEN					
doValue SpA	3.38%	07/31/2026	EUR 3,020	2,627,958	0.2
doValue SpA	5.00%	08/04/2025	3,493	3,390,684	0.3
Encore Capital Group, Inc.	5.38%	02/15/2026	GBP 4,100	4,568,258	0.4
				<u>10,586,900</u>	<u>0.9</u>
VERSICHERUNGEN					
Ardonagh Finco Ltd.	6.88%	02/15/2031	EUR 2,930	2,902,660	0.2
REITs					
Aedas Homes Opco SL	4.00%	08/15/2026	3,250	3,181,712	0.3
Agps Bondco PLC	5.00%	01/14/2029	2,600	1,014,296	0.1
Emeria SASU	7.75%	03/31/2028	4,300	4,173,841	0.4
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA	5.25%	04/01/2026	3,250	3,193,554	0.3
Vivion Investments SARL, Series E(c)	7.90%	08/31/2028	5,520	4,559,501	0.4
Vivion Investments SARL, Series E(c)	7.90%	02/28/2029	1,440	1,156,374	0.1
				<u>17,279,278</u>	<u>1.6</u>
				<u>69,333,891</u>	<u>5.8</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
EDP - Energias de Portugal SA, Series NC5	1.50%	03/14/2082	1,800	1,631,152	0.1

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
ERDGAS						
	UGI International LLC	2.50%	12/01/2029	EUR 3,350	€ 2,975,220	0.3%
					4,606,372	0.4
					457,783,466	39.0
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
	Celanese US Holdings LLC	4.78%	07/19/2026	5,150	5,195,035	0.4
	Syensqo SA(b)	2.50%	12/02/2025	1,300	1,240,868	0.1
					6,435,903	0.5
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
	Pinewood Finance Co., Ltd.	3.25%	09/30/2025	GBP 2,500	2,852,836	0.2
	Pinewood Finance Co., Ltd.	3.63%	11/15/2027	2,170	2,351,171	0.2
	Time Warner Cable LLC	5.75%	06/02/2031	1,635	1,827,857	0.1
					7,031,864	0.5
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
	AT&T, Inc.	3.95%	04/30/2031	EUR 5,445	5,539,324	0.5
	CK Hutchison Group Telecom Finance SA	1.50%	10/17/2031	1,432	1,202,104	0.1
	Orange SA, Series E(b)	5.38%	01/18/2030	1,100	1,139,717	0.1
					7,881,145	0.7
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
	Ford Motor Credit Co. LLC	6.13%	05/15/2028	2,182	2,335,821	0.2
	Ford Motor Credit Co. LLC, Series E	5.13%	02/20/2029	3,300	3,419,590	0.3
	General Motors Financial Co., Inc.	0.65%	09/07/2028	2,300	1,998,954	0.2
	General Motors Financial Co., Inc., Series E	3.90%	01/12/2028	197	197,197	0.0
	General Motors Financial Co., Inc., Series E	4.50%	11/22/2027	2,332	2,383,479	0.2
	Harley-Davidson Financial Services, Inc.	5.13%	04/05/2026	2,403	2,456,850	0.2
	Schaeffler AG, Series E	4.75%	08/14/2029	500	506,637	0.0
	Toyota Motor Credit Corp., Series E	4.05%	09/13/2029	1,632	1,675,547	0.1
	Toyota Motor Finance Netherlands BV, Series E	4.63%	06/08/2026	GBP 1,740	2,014,581	0.2
	Volkswagen International Finance NV(b)	3.88%	06/14/2027	EUR 3,300	3,111,367	0.3
					20,100,023	1.7
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG						
	CPUK Finance Ltd.	5.88%	08/28/2027	GBP 646	756,635	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
	Berkeley Group PLC (The)	2.50%	08/11/2031	2,000	1,759,609	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS						
	McDonald's Corp., Series G	4.13%	11/28/2035	EUR 2,077	2,117,322	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
	Marks & Spencer PLC	4.50%	07/10/2027	GBP 5,100	5,674,461	0.5
	Tapestry, Inc.	5.88%	11/27/2031	EUR 2,933	3,099,669	0.3
	VF Corp., Series E	4.25%	03/07/2029	1,066	1,029,590	0.1
					9,803,720	0.9
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
	American Medical Systems Europe BV	3.50%	03/08/2032	2,100	2,089,190	0.2
	JAB Holdings BV	4.75%	06/29/2032	1,000	1,049,661	0.1
					3,138,851	0.3
ENERGIE						
	BP Capital Markets PLC(b)	3.63%	03/22/2029	3,671	3,431,739	0.3
	Eni SpA, Series NC9(b)	3.38%	07/13/2029	3,787	3,471,755	0.3
	Repsol International Finance BV(b)	2.50%	12/22/2026	1,613	1,505,340	0.1
	TotalEnergies SE(b)	2.00%	06/04/2030	4,108	3,496,021	0.3
					11,904,855	1.0
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
	Travis Perkins PLC	3.75%	02/17/2026	GBP 2,950	3,266,231	0.3
DIENSTLEISTUNGEN						
	Booking Holdings, Inc.	3.50%	03/01/2029	EUR 1,612	1,613,591	0.1
	Booking Holdings, Inc.	4.50%	11/15/2031	1,741	1,839,041	0.2
	Global Payments, Inc.	4.88%	03/17/2031	2,916	3,005,339	0.2
	GTCR W-2 Merger Sub LLC/GTCR W Dutch Finance Sub BV ..	8.50%	01/15/2031	GBP 1,817	2,288,395	0.2
					8,746,366	0.7
TECHNOLOGIE						
	Honeywell International, Inc., Series 4Y	3.50%	05/17/2027	EUR 1,634	1,637,147	0.1
	Infinion Technologies AG(b)	3.63%	01/01/2028	4,500	4,336,765	0.4
					5,973,912	0.5
					88,916,436	7.5

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV(b)	4.75%	09/22/2027	EUR 2,200	€ 2,040,102	0.2%
AIB Group PLC, Series E	4.63%	07/23/2029	2,718	2,776,002	0.2
Banco Santander SA, Series E	5.00%	04/22/2034	3,800	3,814,598	0.3
Banque Federative du Credit Mutuel SA	3.88%	06/16/2032	2,800	2,737,305	0.2
Barclays PLC	4.51%	01/31/2033	1,991	1,996,656	0.2
Barclays PLC(b)	6.38%	12/15/2025	GBP 4,310	4,825,383	0.4
Barclays PLC, Series E	4.92%	08/08/2030	EUR 2,300	2,372,167	0.2
Barclays PLC, Series E	8.41%	11/14/2032	GBP 450	552,690	0.0
BNP Paribas SA(b)	6.88%	12/06/2029	EUR 6,200	6,356,169	0.5
BNP Paribas SA, Series E	2.50%	03/31/2032	3,000	2,819,889	0.2
CaixaBank SA, Series E	6.25%	02/23/2033	2,000	2,093,800	0.2
Capital One Financial Corp.	1.65%	06/12/2029	1,510	1,317,451	0.1
Citigroup, Inc., Series E	1.25%	07/06/2026	2,660	2,567,969	0.2
Commerzbank AG, Series E	5.13%	01/18/2030	500	516,519	0.0
Commerzbank AG, Series E	6.50%	12/06/2032	4,300	4,478,206	0.4
Commerzbank AG, Series E	8.63%	02/28/2033	GBP 1,000	1,226,110	0.1
Cooperatieve Rabobank UA(b)	4.38%	06/29/2027	EUR 7,400	6,914,325	0.6
Credit Agricole SA(b)	4.00%	12/23/2027	2,100	1,926,750	0.2
Danske Bank A/S, Series E	4.50%	11/09/2028	3,301	3,359,624	0.3
Deutsche Bank AG	3.25%	05/24/2028	2,000	1,932,850	0.2
Deutsche Bank AG	4.00%	06/24/2026	GBP 2,800	3,178,933	0.3
Deutsche Bank AG, Series E	1.75%	11/19/2030	EUR 1,400	1,210,403	0.1
Erste Group Bank AG(b)	4.25%	10/15/2027	7,000	6,096,711	0.5
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	7.13%	08/07/2025	GBP 11,430	13,685,994	1.2
HSBC Holdings PLC	6.36%	11/16/2032	EUR 5,791	6,114,860	0.5
HSBC Holdings PLC, Series E(b)	4.75%	07/04/2029	9,926	9,143,577	0.8
ING Groep NV	4.13%	08/24/2033	4,400	4,318,796	0.4
Intesa Sanpaolo SpA, Series E	2.50%	01/15/2030	GBP 1,316	1,283,549	0.1
Intesa Sanpaolo SpA, Series E	4.88%	05/19/2030	EUR 3,295	3,458,450	0.3
JPMorgan Chase & Co., Series E	1.64%	05/18/2028	2,300	2,155,724	0.2
KBC Group NV(b)	4.25%	10/24/2025	9,600	9,069,239	0.8
Lloyds Banking Group PLC(b)	7.88%	06/27/2029	GBP 1,746	1,965,718	0.2
Lloyds Banking Group PLC, Series E	4.38%	04/05/2034	EUR 1,000	979,551	0.1
Lloyds Banking Group PLC, Series E	4.75%	09/21/2031	3,967	4,105,246	0.3
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., Series E	4.64%	06/07/2031	347	361,611	0.0
Morgan Stanley	2.10%	05/08/2026	3,420	3,348,743	0.3
Morgan Stanley	4.81%	10/25/2028	2,300	2,378,401	0.2
Nationwide Building Society(b)	5.75%	06/20/2027	GBP 4,442	4,810,888	0.4
Nationwide Building Society	6.18%	12/07/2027	1,027	1,217,720	0.1
NatWest Group PLC, Series E	4.70%	03/14/2028	EUR 2,452	2,502,679	0.2
NatWest Group PLC, Series E	7.42%	06/06/2033	GBP 779	935,315	0.1
NatWest Markets PLC, Series E	6.38%	11/08/2027	2,475	2,987,329	0.2
Skandinaviska Enskilda Banken AB, Series E	0.75%	08/09/2027	EUR 3,784	3,412,830	0.3
Svenska Handelsbanken AB, Series E	5.00%	08/16/2034	980	1,001,371	0.1
Swedbank AB, Series E	2.10%	05/25/2027	1,865	1,781,877	0.1
Swedbank AB, Series G	1.30%	02/17/2027	2,040	1,889,164	0.2
Swedbank AB, Series G	3.63%	08/23/2032	2,200	2,127,032	0.2
UBS Group AG	4.13%	06/09/2033	5,139	5,124,356	0.4
UniCredit SpA, Series E	4.30%	01/23/2031	2,900	2,889,107	0.2
Virgin Money UK PLC, Series G	7.63%	08/23/2029	GBP 300	368,444	0.0
				<u>160,528,183</u>	<u>13.5</u>
MAKLER					
LKQ Dutch Bond BV	4.13%	03/13/2031	EUR 1,772	1,778,735	0.1
FINANZEN					
JAB Holdings BV	5.00%	06/12/2033	1,000	1,064,661	0.1
VERSICHERUNGEN					
Ageas SA/NV	1.88%	11/24/2051	2,500	2,002,800	0.2
Allianz SE, Series E	2.12%	07/08/2050	3,200	2,789,100	0.2
Allianz SE, Series E	4.25%	07/05/2052	11,600	11,320,023	1.0
ASR Nederland NV	3.38%	05/02/2049	13,599	12,694,417	1.1
CNP Assurances SACA(b)	4.75%	06/27/2028	12,000	11,590,832	1.0
Credit Agricole Assurances SA(b)	4.25%	01/13/2025	500	497,166	0.0
Credit Agricole Assurances SA	4.75%	09/27/2048	5,200	5,253,579	0.4
Metropolitan Life Global Funding I, Series G	3.75%	12/07/2031	1,871	1,890,556	0.2
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co., Series E	1.88%	09/17/2050	2,232	1,922,742	0.2
				<u>49,961,215</u>	<u>4.3</u>
REITs					
American Tower Corp.	4.63%	05/16/2031	2,414	2,510,972	0.2
Digital Intrepid Holding BV	0.63%	07/15/2031	2,550	1,970,435	0.2
Digital Stout Holding LLC	3.75%	10/17/2030	GBP 4,150	4,387,585	0.4
Heimstaden Bostad Treasury BV, Series E	0.25%	10/13/2024	EUR 1,160	1,115,079	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
Heimstaden Bostad Treasury BV, Series E	0.63%	07/24/2025	EUR 3,700	€ 3,417,518	0.3%
Summit Properties Ltd.	2.00%	01/31/2025	3,052	2,895,341	0.2
Unibail-Rodamco-Westfield SE, Series E	4.13%	12/11/2030	2,200	2,212,463	0.2
Westfield America Management Ltd.	2.63%	03/30/2029	GBP 1,972	1,984,914	0.2
				<u>20,494,307</u>	<u>1.8</u>
				<u>233,827,101</u>	<u>19.8</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Electricite de France SA, Series E	4.25%	01/25/2032	EUR 600	618,334	0.0
Enel SpA, Series E(b)	6.38%	04/16/2028	3,080	3,236,890	0.3
Iberdrola Finanzas SA, Series E(b)	4.88%	04/25/2028	1,900	1,910,290	0.2
Iberdrola International BV, Series NC6(b)	1.45%	11/09/2026	2,100	1,920,091	0.2
Vattenfall AB	3.00%	03/19/2077	800	762,369	0.1
Vattenfall AB	6.88%	08/17/2083	GBP 1,200	1,423,307	0.1
				<u>9,871,281</u>	<u>0.9</u>
ERDGAS					
National Grid North America, Inc., Series E	4.15%	09/12/2027	EUR 1,899	1,920,786	0.2
National Grid North America, Inc., Series E	4.67%	09/12/2033	3,260	3,421,410	0.3
				<u>5,342,196</u>	<u>0.5</u>
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Anglian Water Osprey Financing PLC, Series E	2.00%	07/31/2028	GBP 1,940	1,834,374	0.1
Severn Trent Utilities Finance PLC, Series E	4.00%	03/05/2034	EUR 889	890,516	0.1
Suez SACA, Series E	2.38%	05/24/2030	2,000	1,851,301	0.2
Suez SACA, Series E	5.00%	11/03/2032	1,800	1,948,026	0.2
Veolia Environnement SA(b)	2.25%	01/20/2026	1,300	1,231,214	0.1
Veolia Environnement SA(b)	2.50%	01/20/2029	1,300	1,160,645	0.1
Veolia Environnement SA(b)	5.99%	11/22/2028	900	942,819	0.1
				<u>9,858,895</u>	<u>0.9</u>
				<u>25,072,372</u>	<u>2.3</u>
				<u>347,815,909</u>	<u>29.6</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
ÖSTERREICH					
Republic of Austria Government Bond	2.90%	02/20/2033	14,550	14,580,776	1.2
DEUTSCHLAND					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	4.75%	07/04/2034	11,000	13,323,878	1.1
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	6.25%	01/04/2030	81,821	98,689,162	8.4
				<u>112,013,040</u>	<u>9.5</u>
ITALIEN					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 30Y	4.50%	10/01/2053	5,141	5,275,189	0.5
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 31Y	6.00%	05/01/2031	25,092	29,072,534	2.5
				<u>34,347,723</u>	<u>3.0</u>
SPANIEN					
Spain Government Bond	4.20%	01/31/2037	3,202	3,451,986	0.3
Spain Government Bond	5.15%	10/31/2044	12,693	15,284,156	1.3
				<u>18,736,142</u>	<u>1.6</u>
VEREINIGTES KÖNIGREICH					
United Kingdom Gilt	3.75%	10/22/2053	GBP 16,989	17,281,320	1.5
				<u>196,959,001</u>	<u>16.8</u>
GEDECKTE ANLEIHEN					
Banco de Sabadell SA, Series DMTN	3.50%	08/28/2026	EUR 3,400	3,403,430	0.3
Bank of Montreal	1.00%	04/05/2026	3,615	3,437,528	0.3
Bank of Montreal	3.38%	07/04/2026	1,155	1,152,387	0.1
BNP Paribas Home Loan SFH SA, Series E	3.00%	01/31/2030	2,000	1,993,074	0.2
BPCE SFH SA	3.25%	04/12/2028	5,600	5,608,054	0.5
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	2.75%	04/12/2028	5,600	5,507,929	0.5
Caisse Francaise de Financement Local	3.50%	03/16/2032	6,100	6,241,879	0.5
Caisse Francaise de Financement Local, Series E	3.00%	10/02/2028	3,100	3,078,650	0.3
Caisse Francaise de Financement Local, Series E	3.13%	11/16/2027	3,100	3,094,062	0.3
Canadian Imperial Bank of Commerce	0.01%	10/07/2026	5,680	5,205,200	0.4
Cie de Financement Foncier SA	3.13%	05/18/2027	4,200	4,181,648	0.4
Cie de Financement Foncier SA, Series E	3.63%	01/16/2029	1,400	1,431,989	0.1
Commonwealth Bank of Australia	3.77%	08/31/2027	1,695	1,716,385	0.1
Commonwealth Bank of Australia, Series E	0.75%	02/28/2028	3,800	3,439,412	0.3
Danske Mortgage Bank PLC	0.01%	11/24/2026	500	458,622	0.0
DNB Boligkreditt AS	0.01%	10/08/2027	1,032	921,616	0.1
Erste Group Bank AG, Series E	0.63%	01/18/2027	3,400	3,152,347	0.3
Lloyds Bank PLC, Series E	3.25%	02/02/2026	933	929,062	0.1
National Australia Bank Ltd., Series G	0.63%	03/16/2027	3,970	3,656,007	0.3

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
Nationwide Building Society, Series E	2.25%	06/25/2029	EUR 3,200	€ 3,054,660	0.3%
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj, Series E	3.00%	02/20/2030	2,500	2,485,483	0.2
Royal Bank of Canada, Series E	0.13%	04/26/2027	9,480	8,580,453	0.7
Santander UK PLC	1.13%	03/12/2027	3,575	3,348,124	0.3
Toronto-Dominion Bank (The), Series G	0.86%	03/24/2027	1,850	1,716,934	0.1
Westpac Banking Corp., Series E	0.01%	09/22/2028	740	634,650	0.0
				<u>78,429,585</u>	<u>6.7</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
RCS & RDS SA	3.25%	02/05/2028	2,700	<u>2,483,649</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Allwyn Entertainment Financing UK PLC	7.25%	04/30/2030	6,355	6,713,906	0.6
Allwyn Entertainment Financing UK PLC(a)	8.03%	02/15/2028	4,276	<u>4,310,069</u>	<u>0.3</u>
				<u>11,023,975</u>	<u>0.9</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	7.88%	09/15/2031	2,080	<u>2,380,373</u>	<u>0.2</u>
				<u>15,887,997</u>	<u>1.3</u>
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
NIEDERLANDE					
BNG Bank NV, Series E	1.88%	07/13/2032	7,000	<u>6,443,428</u>	<u>0.5</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 3 DAC, Series 2022-3A, Class A(a)	4.87%	10/25/2034	3,700	3,639,205	0.3
Richmond Park CLO 1 DAC, Series 1X, Class DRR(a)	6.99%	07/14/2031	2,300	<u>2,297,420</u>	<u>0.2</u>
				<u>5,936,625</u>	<u>0.5</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
DEUTSCHLAND					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, Series E	2.88%	12/28/2029	5,714	<u>5,736,207</u>	<u>0.5</u>
				<u>1,114,992,218</u>	<u>94.9</u>
GELDMARKTINSTRUMENTE					
SCHATZWECHSEL					
France Treasury Bill BTF	0.00%	04/10/2024	19,018	<u>18,944,779</u>	<u>1.6</u>
				<u>1,133,936,997</u>	<u>96.5</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Olympus Water US Holding Corp.	9.63%	11/15/2028	2,447	<u>2,631,850</u>	<u>0.2</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Hellas Telecommunications Luxembourg III(d)	8.50%	10/15/2049	641	<u>0</u>	<u>0.0</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
CAB SELAS	3.38%	02/01/2028	4,080	<u>3,702,639</u>	<u>0.3</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
BCP V Modular Services Finance II PLC	6.13%	11/30/2028	GBP 2,750	2,986,216	0.3
BCP V Modular Services Finance PLC	6.75%	11/30/2029	EUR 3,954	<u>3,545,128</u>	<u>0.3</u>
				<u>6,531,344</u>	<u>0.6</u>
				<u>12,865,833</u>	<u>1.1</u>
STAMMAKTIE					
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
BREIT ANGELEGTER EINZELHANDEL					
K201640219 South Africa Ltd. - Class A(d)			18,654,746	<u>17</u>	<u>0.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
K201640219 South Africa Ltd.(d) (e)	0.00%	06/25/2023	ZAR 57	<u>0</u>	<u>0.0</u>
				<u>12,865,850</u>	<u>1.1</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten €1,192,162,425)				<u>€ 1,146,802,847</u>	<u>97.6%</u>
Termineinlagen					
BNP Paribas, Paris(f)	2.58 %	–		6,852	0.0
BNP Paribas, Paris(f)	3.15 %	–		15,886	0.0
HSBC, Hong Kong(f)	2.69 %	–		13,931	0.0

	Zinssatz	Datum	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
HSBC, Paris(f)	2.86 %	–	€ 13,492,712	1.1%
SEB, Stockholm(f)	3.32 %	–	123	0.0
SEB, Stockholm(f)	4.15 %	–	432,534	0.0
SMBC, London(f)	4.68 %	–	995,816	0.1
Termineinlagen insgesamt			<u>14,957,854</u>	<u>1.2</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>12,975,771</u>	<u>1.2</u>
Nettovermögen			<u>€ 1,174,736,472</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
EEuro Buxl 30 Yr Bond Futures	03/07/2024	135	€ 17,909,100	€ 17,976,600	€ 67,500
Euro-BOBL Futures	03/07/2024	260	30,277,000	30,217,200	(59,800)
Euro-BTP Futures	03/07/2024	260	29,908,290	30,633,200	724,910
Euro-Bund Futures	03/07/2024	1,387	185,788,260	183,985,550	(1,802,710)
					<u>€ (1,070,100)</u>
				Wertsteigerung	€ 792,410
				Wertminderung	€ (1,862,510)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Barclays Bank PLC	GBP 468	EUR 547	04/19/2024	€ 896
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 544	EUR 569	03/01/2024	633
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 603	CHF 544	03/01/2024	(33,646)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 12,601	EUR 7,630	03/04/2024	51,855
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 129,887	EUR 77,920	03/04/2024	(194,523)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 2,113	EUR 2,252	03/04/2024	41,091
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1,002	AUD 1,672	03/04/2024	3,190
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 85,551	AUD 140,816	03/04/2024	(862,701)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,251	CHF 2,113	03/04/2024	(40,140)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 5	SGD 7	03/04/2024	15
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 380	SGD 552	03/04/2024	(379)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 215,920	USD 234,237	03/04/2024	805,458
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,554	USD 2,754	03/04/2024	(5,884)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 27	EUR 18	03/04/2024	62
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 532	EUR 365	03/04/2024	(868)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,498	EUR 1,388	03/04/2024	2,686
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 235,493	EUR 217,742	03/04/2024	(145,895)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,615	CNH 20,291	03/11/2024	(12,621)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 64	HKD 540	03/11/2024	167
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 11,077	HKD 93,310	03/11/2024	(50,874)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3,150	USD 3,411	03/11/2024	4,948
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 243,131	USD 262,231	03/11/2024	(570,451)
Brown Brothers Harriman & Co.+	HKD 135	EUR 16	03/11/2024	70
Brown Brothers Harriman & Co.+	HKD 378	EUR 45	03/11/2024	(36)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 493	EUR 457	03/11/2024	830
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 967	EUR 892	03/11/2024	(1,892)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,753	CNH 21,401	03/25/2024	(7,062)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 64	HKD 540	03/25/2024	161
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 20,523	HKD 173,508	03/25/2024	(23,258)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,889	PLN 12,492	03/25/2024	2,700
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 92	PLN 396	03/25/2024	(207)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3	SGD 5	03/25/2024	11
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 4,484	SGD 6,512	03/25/2024	(5,938)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 233,104	USD 252,198	03/25/2024	36,245
Brown Brothers Harriman & Co.+	HKD 378	EUR 45	03/25/2024	(31)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 5	EUR 1	03/25/2024	2
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 44	EUR 30	03/25/2024	(99)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 967	EUR 892	03/25/2024	(1,835)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 1,672	EUR 1,002	04/02/2024	(3,233)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 78,159	AUD 130,318	04/02/2024	193,510
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 570	CHF 543	04/02/2024	(1,547)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 336	SGD 489	04/02/2024	769
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 216,091	USD 233,994	04/02/2024	146,771

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 1	EUR 1	04/02/2024	€ (2)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 152	EUR 140	04/02/2024	(401)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 1,205	GBP 1,034	04/19/2024	38
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP 1,227	EUR 1,429	04/19/2024	(797)
Morgan Stanley & Co., LLC.....	GBP 1,584	EUR 1,857	04/19/2024	9,779
NatWest Markets PLC.....	GBP 137,265	EUR 160,218	03/07/2024	(81,016)
Societe Generale.....	GBP 4,089	EUR 4,768	04/19/2024	467
				€ (742,982)
			Wertsteigerung	€ 1,302,354
			Wertminderung	€ (2,045,336)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Kaufkontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	ITRAXX-XOVERS40V1-5Y	12/20/2028	EUR 42,080	€ (3,320,404)	€ (1,506,830)

- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 29. Februar 2024.
- (b) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (c) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (d) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (e) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (f) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

- BOBL – Bundesobligation
- BTP – Buoni del Tesoro Poliennali
- CAB – Capital Appreciation Bond
- CLO – Collateralized Loan Obligations
- INTRCONX – Intercontinental Exchange
- LP – Limited Partnership

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
STAATSANLEIHEN					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	USD 7,106	\$ 6,321,000	1.3%
Angolan Government International Bond	8.25%	05/09/2028	2,208	2,033,502	0.4
Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048	479	392,205	0.1
				<u>8,746,707</u>	<u>1.8</u>
ARGENTINIEN					
Argentine Republic Government International Bond	0.75%	07/09/2030	6,402	2,952,502	0.6
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	3,315	1,535,237	0.3
Argentine Republic Government International Bond	3.50%	07/09/2041	2,951	1,056,365	0.2
Argentine Republic Government International Bond	3.63%	07/09/2035	10,174	3,777,148	0.8
Argentine Republic Government International Bond	4.25%	01/09/2038	4,508	1,881,964	0.4
				<u>11,203,216</u>	<u>2.3</u>
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	6.00%	09/19/2044	1,100	887,590	0.2
Bahrain Government International Bond	6.25%	01/25/2051	5,345	4,322,769	0.9
				<u>5,210,359</u>	<u>1.1</u>
CHILE					
Chile Electricity Lux MPC SARL	6.01%	01/20/2033	983	998,807	0.2
Chile Government International Bond	3.10%	05/07/2041	473	346,964	0.1
Chile Government International Bond	5.33%	01/05/2054	2,782	2,658,590	0.5
				<u>4,004,361</u>	<u>0.8</u>
KOLUMBIEN					
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	2,884	2,282,542	0.5
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	4,354	3,361,114	0.7
Colombia Government International Bond	3.88%	02/15/2061	1,006	575,502	0.1
Colombia Government International Bond	4.13%	02/22/2042	1,502	1,001,759	0.2
Colombia Government International Bond	5.00%	06/15/2045	2,746	1,973,413	0.4
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	610	519,677	0.1
Colombia Government International Bond	7.50%	02/02/2034	3,105	3,141,049	0.6
Colombia Government International Bond	8.00%	04/20/2033	3,205	3,354,914	0.7
Colombia Government International Bond	8.00%	11/14/2035	679	705,956	0.1
				<u>16,915,926</u>	<u>3.4</u>
COSTA RICA					
Costa Rica Government International Bond	6.55%	04/03/2034	532	548,939	0.1
Costa Rica Government International Bond	7.30%	11/13/2054	1,065	1,123,287	0.2
				<u>1,672,226</u>	<u>0.3</u>
ELFENBEINKÜSTE					
Ivory Coast Government International Bond	5.75%	12/31/2032	470	439,979	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	7,055	6,188,646	1.3
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	4,045	3,921,122	0.8
				<u>10,549,747</u>	<u>2.2</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	5,510	4,906,545	1.0
Dominican Republic International Bond	5.50%	02/22/2029	1,750	1,692,722	0.4
Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027	770	768,375	0.2
Dominican Republic International Bond	6.85%	01/27/2045	726	712,932	0.1
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	2,702	2,814,471	0.6
				<u>10,895,045</u>	<u>2.3</u>
ÄGYPTEN					
Egypt Government International Bond	3.88%	02/16/2026	1,049	965,835	0.2
Egypt Government International Bond	5.25%	10/06/2025	1,007	963,961	0.2
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	2,353	2,117,747	0.4
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	3,221	2,666,344	0.6
Egypt Government International Bond	7.50%	02/16/2061	511	362,411	0.1
Egypt Government International Bond	7.90%	02/21/2048	4,084	3,064,797	0.6
Egypt Government International Bond	8.75%	09/30/2051	587	463,102	0.1
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	4,771	3,815,309	0.8
				<u>14,419,506</u>	<u>3.0</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	3,270	2,812,952	0.6
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	725	495,552	0.1
El Salvador Government International Bond	7.63%	02/01/2041	170	123,937	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	4,579	3,989,454	0.8
				<u>7,421,895</u>	<u>1.5</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
GHANA						
	Ghana Government International Bond(a)	7.63%	05/16/2029	USD 2,108	\$ 893,265	0.2%
	Ghana Government International Bond(a)	7.88%	02/11/2035	906	388,212	0.1
	Ghana Government International Bond(a)	8.95%	03/26/2051	3,427	1,461,273	0.3
					<u>2,742,750</u>	<u>0.6</u>
GUATEMALA						
	Guatemala Government Bond	4.38%	06/05/2027	4,822	4,612,484	1.0
UNGARN						
	Hungary Government International Bond	2.13%	09/22/2031	3,329	2,602,113	0.5
	Hungary Government International Bond	5.50%	06/16/2034	2,987	2,905,694	0.6
	Hungary Government International Bond	6.75%	09/25/2052	1,281	1,359,320	0.3
					<u>6,867,127</u>	<u>1.4</u>
INDONESIEN						
	Indonesia Government International Bond	1.85%	03/12/2031	4,362	3,542,773	0.7
	Indonesia Government International Bond	3.55%	03/31/2032	924	828,791	0.2
	Indonesia Government International Bond	4.30%	03/31/2052	403	340,913	0.1
					<u>4,712,477</u>	<u>1.0</u>
JAMAICA						
	Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045	3,832	4,437,571	0.9
JORDANIEN						
	Jordan Government International Bond	7.38%	10/10/2047	3,215	2,768,919	0.6
	Jordan Government International Bond	7.50%	01/13/2029	2,497	2,462,666	0.5
					<u>5,231,585</u>	<u>1.1</u>
KENIA						
	Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	3,023	2,897,455	0.6
LIBANON						
	Lebanon Government International Bond(b)	6.00%	01/27/2023	1,360	78,200	0.0
	Lebanon Government International Bond(a)	6.65%	04/22/2024	3,748	215,510	0.0
	Lebanon Government International Bond, Series E(b)	6.10%	10/04/2022	6,321	363,457	0.1
	Lebanon Government International Bond, Series G(a)	1.00%	11/27/2026	1,719	98,842	0.0
	Lebanon Government International Bond, Series G(a)	6.20%	02/26/2025	4,428	254,610	0.1
	Lebanon Government International Bond, Series G(a)	6.85%	03/23/2027	4,936	283,820	0.1
					<u>1,294,439</u>	<u>0.3</u>
MEXIKO						
	Mexico Government International Bond	3.77%	05/24/2061	3,335	2,146,239	0.4
	Mexico Government International Bond	6.00%	05/07/2036	5,435	5,420,162	1.1
					<u>7,566,401</u>	<u>1.5</u>
MAROKKO						
	Morocco Government International Bond	6.50%	09/08/2033	867	889,603	0.2
NIGERIA						
	Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	9,195	8,077,532	1.7
	Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	746	678,286	0.1
	Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	2,389	2,109,786	0.4
	Nigeria Government International Bond	7.38%	09/28/2033	2,227	1,865,669	0.4
	Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	1,333	1,070,332	0.2
	Nigeria Government International Bond	8.38%	03/24/2029	602	570,521	0.1
					<u>14,372,126</u>	<u>2.9</u>
OMAN						
	Oman Government International Bond	5.63%	01/17/2028	1,611	1,611,000	0.3
	Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	462	473,406	0.1
	Oman Government International Bond	6.75%	01/17/2048	382	384,193	0.1
	Oman Government International Bond	7.38%	10/28/2032	2,215	2,434,423	0.5
					<u>4,903,022</u>	<u>1.0</u>
PAKISTAN						
	Pakistan Government International Bond	8.88%	04/08/2051	4,150	2,750,412	0.6
PANAMA						
	Panama Bonos del Tesoro, Series DOM	3.36%	06/30/2031	734	567,059	0.1
	Panama Government International Bond	3.87%	07/23/2060	3,435	1,921,453	0.4
	Panama Government International Bond	6.85%	03/28/2054	2,367	2,085,919	0.4
	Panama Government International Bond	6.88%	01/31/2036	462	436,359	0.1
	Panama Government International Bond	7.50%	03/01/2031	1,378	1,414,207	0.3
	Panama Government International Bond	7.88%	03/01/2057	476	468,414	0.1
	Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	3,021	2,843,516	0.6
					<u>9,736,927</u>	<u>2.0</u>
PARAGUAY						
	Paraguay Government International Bond	3.85%	06/28/2033	1,929	1,666,791	0.3
	Paraguay Government International Bond	4.95%	04/28/2031	2,475	2,374,713	0.5
					<u>4,041,504</u>	<u>0.8</u>

AB FCP I
Emerging Markets Debt Portfolio

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PERU	Peruvian Government International Bond	2.78%	12/01/2060	USD 1,744	\$ 1,000,167	0.2%
PHILIPPINEN	Philippine Government International Bond	3.20%	07/06/2046	3,307	2,365,745	0.5
	Philippine Government International Bond	3.56%	09/29/2032	2,722	2,434,611	0.5
	Philippine Government International Bond	3.75%	01/14/2029	745	705,366	0.1
	Philippine Government International Bond	4.20%	03/29/2047	1,850	1,546,711	0.3
					<u>7,052,433</u>	<u>1.4</u>
POLEN	Republic of Poland Government International Bond	4.88%	10/04/2033	2,397	2,351,337	0.5
	Republic of Poland Government International Bond	5.50%	04/04/2053	887	886,246	0.2
					<u>3,237,583</u>	<u>0.7</u>
KATAR	Qatar Government International Bond	5.10%	04/23/2048	385	370,778	0.1
RUMÄNIEN	Romanian Government International Bond	3.00%	02/14/2031	1,528	1,272,473	0.3
	Romanian Government International Bond	3.63%	03/27/2032	2,928	2,475,946	0.5
	Romanian Government International Bond	4.00%	02/14/2051	2,100	1,455,615	0.3
	Romanian Government International Bond	5.25%	11/25/2027	2,724	2,666,905	0.6
	Romanian Government International Bond	5.88%	01/30/2029	1,048	1,039,930	0.2
	Romanian Government International Bond	6.00%	05/25/2034	4,748	4,632,196	1.0
					<u>13,543,065</u>	<u>2.9</u>
SAUDI-ARABIEN	Saudi Government International Bond	3.45%	02/02/2061	4,015	2,628,902	0.5
	Saudi Government International Bond	5.00%	04/17/2049	1,617	1,437,545	0.3
	Saudi Government International Bond	5.25%	01/16/2050	2,098	1,930,160	0.4
	Saudi Government International Bond	5.75%	01/16/2054	2,780	2,685,897	0.6
					<u>8,682,504</u>	<u>1.8</u>
SENEGAL	Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR 1,659	1,621,587	0.3
	Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	USD 4,155	3,459,038	0.7
	Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	610	441,487	0.1
					<u>5,522,112</u>	<u>1.1</u>
SERBIEN	Serbia International Bond	6.50%	09/26/2033	4,474	4,550,058	0.9
SÜDAFRIKA	Republic of South Africa Government International Bond	4.85%	09/30/2029	2,457	2,207,461	0.5
	Republic of South Africa Government International Bond	5.38%	07/24/2044	1,602	1,168,459	0.2
	Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	645	469,641	0.1
	Republic of South Africa Government International Bond	5.88%	04/20/2032	1,220	1,100,669	0.2
					<u>4,946,230</u>	<u>1.0</u>
SRI LANKA	Sri Lanka Government International Bond(a)	6.85%	11/03/2025	5,158	2,837,467	0.6
	Sri Lanka Government International Bond(a)	7.55%	03/28/2030	4,778	2,547,343	0.5
	Sri Lanka Government International Bond(a)	7.85%	03/14/2029	1,094	583,332	0.1
					<u>5,968,142</u>	<u>1.2</u>
TÜRKEI	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	8.51%	01/14/2029	1,590	1,660,405	0.3
	Türkiye Government International Bond	4.88%	10/09/2026	1,584	1,526,612	0.3
	Türkiye Government International Bond	5.25%	03/13/2030	3,710	3,330,207	0.7
	Türkiye Government International Bond	5.75%	05/11/2047	2,006	1,503,778	0.3
	Türkiye Government International Bond	5.88%	06/26/2031	1,521	1,386,962	0.3
	Türkiye Government International Bond	6.13%	10/24/2028	2,164	2,102,283	0.4
	Türkiye Government International Bond	6.63%	02/17/2045	1,085	921,339	0.2
					<u>12,431,586</u>	<u>2.5</u>
UKRAINE	Ukraine Government International Bond	6.75%	06/20/2028	EUR 1,222	363,718	0.1
	Ukraine Government International Bond	6.88%	05/21/2031	USD 792	198,451	0.0
	Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2034	6,510	1,699,826	0.4
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026	5,724	1,716,914	0.4
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2028	5,748	1,640,652	0.3
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2029	1,434	405,162	0.1
					<u>6,024,723</u>	<u>1.3</u>
URUGUAY	Uruguay Government International Bond	4.98%	04/20/2055	1,478	1,374,648	0.3
	Uruguay Government International Bond	5.10%	06/18/2050	1,379	1,323,234	0.3
					<u>2,697,882</u>	<u>0.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VENEZUELA					
Venezuela Government International Bond(b)	7.75%	10/13/2019	USD 2,834	\$ 396,732	0.1%
Venezuela Government International Bond(b)	9.00%	05/07/2023	5,842	852,990	0.2
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	09/15/2027	3,814	682,706	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	05/07/2028	6,056	1,029,554	0.2
				<u>2,961,982</u>	<u>0.6</u>
SAMBIA					
Zambia Government International Bond(a)	8.97%	07/30/2027	2,380	1,606,500	0.3
				<u>248,690,616</u>	<u>51.2</u>
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	4.00%	08/11/2041	4,260	3,036,581	0.6
Banco Nacional de Panama	2.50%	08/11/2030	890	675,572	0.1
Bank Gospodarstwa Krajowego	5.38%	05/22/2033	957	945,935	0.2
Bapco Energies BSCC	7.50%	10/25/2027	4,137	4,275,331	0.9
China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd.(c)	3.08%	12/09/2025	255	244,435	0.0
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	5.13%	03/14/2028	400	395,792	0.1
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	1,189	1,119,146	0.2
Comision Federal de Electricidad	5.00%	09/29/2036	1,624	1,430,081	0.3
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.00%	09/30/2029	4,285	3,756,445	0.8
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.15%	01/14/2030	439	383,282	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031	2,500	2,208,975	0.5
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.13%	02/02/2033	4,255	3,994,977	0.8
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	01/08/2034	3,584	3,542,560	0.7
Dianjian Haiyu Ltd.(c)	4.25%	01/14/2027	1,427	1,377,940	0.3
DP World Ltd./United Arab Emirates	6.85%	07/02/2037	2,400	2,595,816	0.5
DP World Salaam(c)	6.00%	10/01/2025	2,195	2,186,484	0.5
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	4.70%	05/07/2050	1,375	1,109,453	0.2
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	5.00%	01/25/2047	240	205,111	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	1,115	1,109,470	0.2
Gaci First Investment Co.	4.75%	02/14/2030	3,457	3,359,260	0.7
Gaci First Investment Co.	4.88%	02/14/2035	1,977	1,872,700	0.4
Gaci First Investment Co.	5.25%	10/13/2032	1,134	1,135,660	0.2
Gaci First Investment Co.	5.38%	01/29/2054	3,805	3,346,802	0.7
Indonesia Asahan Aluminium PT/ Mineral Industri Indonesia Persero PT	5.45%	05/15/2030	1,480	1,448,565	0.3
Lamar Funding Ltd.	3.96%	05/07/2025	4,303	4,178,514	0.9
Magyar Export-Import Bank Zrt	6.13%	12/04/2027	1,869	1,878,158	0.4
MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt	6.50%	06/29/2028	1,892	1,919,112	0.4
Pertamina Persero PT	2.30%	02/09/2031	6,532	5,377,143	1.1
Pertamina Persero PT	6.00%	05/03/2042	220	219,175	0.0
Petroleos de Venezuela SA(a)	5.38%	04/12/2027	7,377	756,173	0.2
Petroleos de Venezuela SA(a)	5.50%	04/12/2037	8,347	880,609	0.2
Petroleos de Venezuela SA(b)	9.00%	11/17/2021	9,326	983,901	0.2
Petroleos Mexicanos	6.35%	02/12/2048	6,980	4,271,760	0.9
Petroleos Mexicanos	6.50%	03/13/2027	5,745	5,358,074	1.1
Petroleos Mexicanos	6.70%	02/16/2032	4,161	3,356,679	0.7
Petroleos Mexicanos	6.88%	08/04/2026	2,713	2,613,704	0.5
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	3,495	2,217,228	0.5
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	1,351	930,636	0.2
Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd.(c)	3.08%	04/01/2026	3,365	3,190,861	0.7
QatarEnergy	3.13%	07/12/2041	2,339	1,720,615	0.4
QatarEnergy	3.30%	07/12/2051	8,127	5,647,127	1.2
Sinochem Offshore Capital Co., Ltd., Series E	2.38%	09/23/2031	760	613,480	0.1
Southern Gas Corridor CJSC	6.88%	03/24/2026	1,681	1,701,676	0.3
TC Ziraat Bankasi AS	8.00%	01/16/2029	774	783,675	0.2
Transnet SOC Ltd.	8.25%	02/06/2028	3,042	3,024,889	0.6
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS	9.00%	01/28/2027	1,248	1,301,820	0.3
Ziraat Katilim Varlik Kiralama AS	9.38%	11/12/2026	1,350	1,429,016	0.3
				<u>100,110,398</u>	<u>20.7</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
Absa Group Ltd.(c)	6.38%	05/27/2026	638	609,290	0.1
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	865	836,861	0.2
Adani Green Energy Ltd.	4.38%	09/08/2024	1,725	1,702,454	0.3
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	3.10%	02/02/2031	285	227,287	0.0
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	3.83%	02/02/2032	335	275,045	0.1
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.38%	07/03/2029	250	223,750	0.0
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	1,162	1,128,651	0.2
Alfa Desarrollo SpA	4.55%	09/27/2051	1,660	1,232,239	0.3
Aris Mining Corp.	6.88%	08/09/2026	1,000	886,466	0.2
Autopistas del Sol SA/Costa Rica	7.38%	12/30/2030	1,774	1,702,769	0.3
Banco de Credito del Peru SA	5.85%	01/11/2029	849	857,624	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Bank Hapoalim BM	3.26%	01/21/2032	USD 734	\$ 651,043	0.1%
Bank Leumi Le-Israel BM	7.13%	07/18/2033	760	740,021	0.2
Bank of East Asia Ltd. (The), Series E	6.75%	03/15/2027	545	543,978	0.1
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	1,594	1,147,680	0.2
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	255	192,525	0.0
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	605	533,495	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	403	329,533	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	8.50%	01/12/2031	340	335,018	0.1
Buffalo Energy Mexico Holdings/ Buffalo Energy Infrastructure/Buffalo Energy	7.88%	02/15/2039	480	507,677	0.1
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	520	490,182	0.1
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	542	518,255	0.1
Canacol Energy Ltd.	5.75%	11/24/2028	2,182	1,486,107	0.3
China Great Wall International Holdings V Ltd.	2.88%	11/23/2026	294	269,010	0.1
China Modern Dairy Holdings Ltd.	2.13%	07/14/2026	630	561,684	0.1
Cometa Energia SA de CV.	6.38%	04/24/2035	440	433,390	0.1
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	1,323	1,065,015	0.2
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	146	120,600	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	449	436,787	0.1
Ecopetrol SA	8.63%	01/19/2029	5,158	5,462,322	1.1
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	914	786,168	0.2
Falabella SA.	3.75%	10/30/2027	909	821,281	0.2
First Abu Dhabi Bank PJSC.	6.32%	04/04/2034	475	485,650	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	9.38%	03/01/2029	320	331,806	0.1
GENM Capital Labuan Ltd.	3.88%	04/19/2031	1,100	951,844	0.2
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027	930	841,650	0.2
Gran Tierra Energy, Inc.	9.50%	10/15/2029	823	761,275	0.2
Greenko Dutch BV.	3.85%	03/29/2026	842	793,349	0.2
Huarong Finance 2017 Co., Ltd., Series E	4.25%	11/07/2027	212	196,407	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd., Series E	3.25%	11/13/2024	465	453,817	0.1
Huarong Finance 2019 Co., Ltd., Series E	3.75%	05/29/2024	227	225,439	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.63%	06/03/2026	574	552,194	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.88%	11/22/2026	214	205,847	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	8.55%	09/18/2033	408	431,460	0.1
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	1,455	1,329,961	0.3
Intercorp Financial Services, Inc.	4.13%	10/19/2027	673	626,227	0.1
Israel Electric Corp., Ltd., Series G	3.75%	02/22/2032	204	170,107	0.0
Joy Treasure Assets Holdings, Inc.	4.50%	03/20/2029	740	701,416	0.1
KazMunayGas National Co. JSC.	5.38%	04/24/2030	3,980	3,864,102	0.8
Lenovo Group Ltd.	3.42%	11/02/2030	600	522,504	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.75%	06/30/2030	505	462,499	0.1
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	1,756	1,603,908	0.3
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	1,381	1,356,856	0.3
Masdar Abu Dhabi Future Energy Co., Series E	4.88%	07/25/2033	1,298	1,273,870	0.3
Medco Maple Tree Pte Ltd.	8.96%	04/27/2029	673	701,266	0.1
Minejesa Capital BV	4.63%	08/10/2030	1,069	1,012,364	0.2
Minejesa Capital BV	5.63%	08/10/2037	1,015	885,588	0.2
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	943	991	0.0
OEC Finance Ltd.(d)	4.38%	10/25/2029	1,043	41,721	0.0
OEC Finance Ltd.(d)	5.25%	12/27/2033	1,771	90,298	0.0
OEC Finance Ltd.(d)	7.13%	12/26/2046	641	39,071	0.0
Prosus NV	3.06%	07/13/2031	960	772,205	0.2
Raizen Fuels Finance SA	6.45%	03/05/2034	730	738,717	0.2
Sasol Financing USA LLC.	8.75%	05/03/2029	385	385,874	0.1
Saudi Arabian Oil Co.	2.25%	11/24/2030	4,845	4,064,228	0.8
Shinhan Financial Group Co., Ltd.(c)	2.88%	05/12/2026	285	266,484	0.1
SierraCol Energy Andina LLC.	6.00%	06/15/2028	1,367	1,188,863	0.2
Standard Chartered PLC	1.46%	01/14/2027	995	915,179	0.2
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	555	487,795	0.1
Studio City Co., Ltd.	7.00%	02/15/2027	254	253,253	0.1
Studio City Finance Ltd.	6.50%	01/15/2028	830	785,388	0.2
TAV Havalimanlari Holding AS	8.50%	12/07/2028	917	943,364	0.2
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	3,772	3,084,591	0.6
TransJamaican Highway Ltd.	5.75%	10/10/2036	684	600,919	0.1
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	930	843,836	0.2
Türkiye Vakıflar Bankası TAO.	9.00%	10/12/2028	1,210	1,274,178	0.3
UEP Penonome II SA.	6.50%	10/01/2038	3,291	2,520,139	0.5
UPL Corp., Ltd.	4.50%	03/08/2028	1,100	955,911	0.2
Volcan Cia Minera SAA.	4.38%	02/11/2026	1,981	1,240,601	0.3
Woori Bank(c)	4.25%	10/04/2024	200	197,056	0.0
Xiaomi Best Time International Ltd.	3.38%	04/29/2030	610	532,606	0.1
Yapi ve Kredi Bankasi AS	9.25%	10/16/2028	1,200	1,275,216	0.3
				71,353,737	14.7

	Zinssatz	Datum	Anteile/Kontrakte/ Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
SCHATZOBLIGATIONEN						
KOLUMBIEN						
Colombian TES, Series B	7.25%	10/26/2050	COP 30,594,400	\$ 5,508,161	1.2%	
INDIEN						
India Government Bond	7.18%	08/14/2033	INR 604,940	7,358,758	1.5	
MEXIKO						
Mexican Bonos, Series M	8.00%	11/07/2047	MXN 14,753	755,830	0.2	
Mexican Bonos, Series M	8.00%	07/31/2053	50,614	2,575,810	0.5	
				3,331,640	0.7	
				16,198,559	3.4	
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2027	BRL 24,405	4,903,303	1.0	
Dominican Republic International Bond	11.25%	09/15/2035	DOP 131,500	2,457,778	0.5	
Türkiye Government Bond	26.20%	10/05/2033	TRY 36,410	1,202,544	0.2	
				8,563,625	1.7	
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN						
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS						
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S				120,265	3,249,549	0.7
REGIONALANLEIHEN						
PERU						
Credicorp Capital Sociedad Titulizadora SA	10.10%	12/15/2043	PEN 4,185	1,114,116	0.2	
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN						
SWAPTIONS						
OTC - 10 Year Interest Rate Swap Expiration: Apr 2024, Exercise Price: 4.45(e)				11,260,000	10,371	0.0
					449,290,971	92.6
GELDMARKTINSTRUMENTE						
US-SCHATZWECHSEL						
U.S. Treasury Bill	0.00%	04/16/2024	USD 2,400	2,383,793	0.5	
					451,674,764	93.1
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
STAATSANLEIHEN						
ECUADOR						
Ecuador Government International Bond	3.50%	07/31/2035	15,716	7,494,395	1.6	
Ecuador Government International Bond	6.00%	07/31/2030	2,814	1,719,313	0.4	
					9,213,708	2.0
GHANA						
Ghana Government International Bond(a)	8.63%	06/16/2049	3,367	1,401,514	0.3	
UKRAINE						
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2026	1,750	559,668	0.1	
					11,174,890	2.4
QUASI-STAATSANLEIHEN						
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2028	1,322	701,899	0.1	
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(f)	7.65%	07/19/2025	2,490	1,923,486	0.4	
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030	2,984	787,508	0.2	
					3,412,893	0.7
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
BBFI Liquidating Trust(f)	0.00%	12/30/2099	5,162	1,494,630	0.3	
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	2,442	2,564	0.0	
Tonon Luxembourg SA(a)	6.50%	10/31/2024	1,523	152	0.0	
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (f)	10.50%	01/28/2018	1,016	102	0.0	
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (f)	10.88%	01/13/2020	2,474	247	0.0	
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (f)	11.75%	02/09/2022	2,561	256	0.0	
					1,497,951	0.3
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
Jamaica Government International Bond	9.63%	11/03/2030	JMD 187,500	1,265,844	0.3	
INFLATIONSGEKÜNDIGTE WERTPAPIERE						
KOLUMBIEN						
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar	6.75%	02/15/2044	COP 4,930,528	832,319	0.2	
					18,183,897	3.9
Gesamtanlagen						
(Kosten \$549,495,300)				\$ 469,858,661	97.0%	

	Zinssatz	Datum		Wert (USD)	Nettover- mögen %
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(g)	2.90 %	–	\$	696	0.0%
ANZ, London(g)	3.15 %	–		3,564	0.0
BBH, New York(g)	0.71 %	–		1	0.0
HSBC, Hong Kong(g)	2.69 %	–		17	0.0
HSBC, Paris(g)	2.86 %	–		2,062	0.0
Scotiabank, Toronto(g)	3.83 %	–		27	0.0
SMBC, London(g)	4.15 %	–		220	0.0
SMBC, London(g)	4.68 %	–		6,402,763	1.3
Standard Chartered Bank, Johannesburg(g)	6.65 %	–		42,504	0.0
Termineinlagen insgesamt				6,451,854	1.3
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				8,256,321	1.7
Nettovermögen			\$	484,566,836	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
U.S. 10 Yr Ultra Futures	06/18/2024	97	\$ 11,065,977	\$ 11,074,672	\$ 8,695
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	06/28/2024	19	3,888,023	3,890,250	2,227
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	06/28/2024	142	15,147,024	15,180,687	33,664
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	06/18/2024	250	27,605,461	27,609,375	3,914
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	06/18/2024	154	19,538,320	19,692,750	154,430
					\$ 202,930

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Barclays Bank PLC	USD 2,363	BRL 11,768	03/04/2024	\$ 4,231
Barclays Bank PLC	BRL 11,768	USD 2,355	04/02/2024	(4,518)
BNP Paribas	COP 7,020,660	USD 1,764	03/15/2024	(21,455)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 2,001	USD 1,320	03/04/2024	19,992
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 63,897	USD 41,511	03/04/2024	(22,429)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 1,221	USD 900	03/04/2024	298
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 19	USD 21	03/04/2024	104
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 714	USD 903	03/04/2024	1,678
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 2	USD 2	03/04/2024	(4)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 3,915	USD 2,385	03/04/2024	1,689
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 3,045	USD 764	03/04/2024	1,482
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 149	USD 37	03/04/2024	(455)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 178	USD 133	03/04/2024	466
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 6,596	USD 4,898	03/04/2024	(3,824)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 568	AUD 874	03/04/2024	489
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 42,831	AUD 65,024	03/04/2024	(565,782)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 910	CAD 1,221	03/04/2024	(10,634)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 22	CHF 19	03/04/2024	(603)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 909	GBP 716	03/04/2024	(5,683)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1	NZD 2	03/04/2024	3
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,401	NZD 3,912	03/04/2024	(18,497)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 8	PLN 33	03/04/2024	33
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 792	PLN 3,161	03/04/2024	(512)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 33	SGD 44	03/04/2024	16
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,030	SGD 6,730	03/04/2024	(28,614)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 731	ZAR 14,098	03/04/2024	3,830
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 21,771	ZAR 409,602	03/04/2024	(415,518)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 5,696	USD 300	03/04/2024	3,301
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 418,003	USD 21,787	03/04/2024	(6,876)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1,701	USD 1,871	03/14/2024	31,874
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 860	USD 931	03/25/2024	701
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 87,707	EUR 81,064	03/25/2024	(16,216)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 892	USD 580	04/02/2024	(538)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 14	USD 10	04/02/2024	0*
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 0**	USD 0**	04/02/2024	2
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 3	USD 4	04/02/2024	9
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 28	USD 17	04/02/2024	10
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 43	USD 32	04/02/2024	(18)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 41,407	AUD 63,676	04/02/2024	22,123
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 894	CAD 1,213	04/02/2024	(256)

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 21	CHF 18	04/02/2024	\$ (90)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 903	GBP 714	04/02/2024	(1,715)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 2,292	NZD 3,763	04/02/2024	(1,044)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 719	PLN 2,866	04/02/2024	(1,256)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 4,899	SGD 6,588	04/02/2024	3,758
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 21,776	ZAR 418,813	04/02/2024	5,186
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR 7,988	USD 414	04/02/2024	(1,196)
Citibank NA.....	USD 377	BRL 1,878	03/04/2024	985
Citibank NA.....	USD 200	MXN 3,453	03/15/2024	1,751
Deutsche Bank AG.....	COP 3,094,485	USD 773	03/15/2024	(13,574)
HSBC Bank USA.....	IDR 56,974,149	USD 3,619	04/25/2024	(3,021)
HSBC Bank USA.....	USD 3,594	IDR 57,128,314	04/25/2024	37,269
Morgan Stanley & Co., LLC.....	BRL 13,647	USD 2,767	03/04/2024	21,595
				\$ (981,453)
			Wertsteigerung	\$ 162,875
			Wertminderung	\$ (1,144,328)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Kaufkontrakte					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-EMHYS40V1-5Y	12/20/2028	USD 8,700	\$ 664,537	\$ (97,166)
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	State of Qatar	12/20/2028	USD 36,720	(1,015,387)	(400,064)
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-EMS40V1-5Y	12/20/2028	USD 1,570	(42,814)	14,389
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Federative Republic of Brazil	12/20/2028	USD 1,610	(17,595)	13,788
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	People's Republic of China	12/20/2028	USD 1,620	23,395	(5,859)
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Colombia	12/20/2028	USD 1,660	(41,068)	25,687
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Indonesia	12/20/2028	USD 1,580	19,683	2,527
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of South Africa	12/20/2028	USD 2,010	(108,413)	586
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Turkey	12/20/2028	USD 2,130	(162,714)	31,958
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	United Mexican States	12/20/2028	USD 1,580	10,494	8,160
Insgesamt				\$ (669,882)	\$ (405,994)
				Wertsteigerung	\$ 97,095
				Wertminderung	\$ (503,089)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 20,120	10/27/2028	1 Day SOFR	4.611%	\$ 480,927
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 5,150	03/21/2033	1 Day SOFR	3.209%	(262,216)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 5,370	10/27/2053	4.353%	1 Day SOFR	(672,762)
Insgesamt					\$ (454,051)
				Wertsteigerung	\$ 480,927
				Wertminderung	\$ (934,978)
Swaps insgesamt					\$ (860,045)

* Betrag kleiner als 0.50.

** Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

- (a) Not leidend.
- (b) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (c) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (d) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (e) Ein Vertrag bezieht sich auf 1 Aktie.
- (f) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (g) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	– Australian Dollar
BRL	– Brazilian Real
CAD	– Canadian Dollar
CHF	– Swiss Franc
COP	– Colombian Peso
DOP	– Dominican Peso
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
IDR	– Indonesian Rupiah
INR	– Indian Rupee
JMD	– Jamaican Dollar
MXN	– Mexican Peso
NZD	– New Zealand Dollar
PEN	– Peruvian Sol
PLN	– Polish Zloty
SGD	– Singapore Dollar
TRY	– Turkish Lira
USD	– United States Dollar
ZAR	– South African Rand

Glossar:

CBT	– Chicago Board of Trade
CJSC	– Closed Joint Stock Company
CME	– Chicago Mercantile Exchange
INTRCONX	– Intercontinental Exchange
JSC	– Joint Stock Company
LCH	– London Clearing House
OTC	– Over-the-Counter
PJSC	– Public Joint Stock Company
SOFR	– Secured Overnight Financing Rate

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd., Series 2022-1, Class M2(a)	9.92%	01/26/2032	USD 500	\$ 504,990	0.1%
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2020-SBT1, Class 1B1(a)	12.19%	02/25/2040	1,000	1,063,320	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2B1(a)	12.04%	02/25/2040	4,000	4,282,192	0.5
Series 2020-SBT1, Class 2M2(a)	9.09%	02/25/2040	2,840	2,987,810	0.4
Series 2022-R01, Class 1M2(a)	7.22%	12/25/2041	7,215	7,264,939	0.9
Series 2022-R02, Class 2B1(a)	9.82%	01/25/2042	1,000	1,047,190	0.1
Series 2022-R02, Class 2B2(a)	12.97%	01/25/2042	1,000	1,075,623	0.1
Series 2022-R03, Class 1M1(a)	7.42%	03/25/2042	5,397	5,473,266	0.7
Series 2022-R05, Class 2B2(a)	12.32%	04/25/2042	1,000	1,084,750	0.1
Series 2022-R07, Class 1M1(a)	8.27%	06/25/2042	2,817	2,895,297	0.3
Series 2022-R08, Class 1M1(a)	7.87%	07/25/2042	3,877	3,982,097	0.5
Series 2023-R02, Class 1M2(a)	8.67%	01/25/2043	3,000	3,155,740	0.4
Series 2023-R05, Class 1B1(a)	10.07%	06/25/2043	3,000	3,230,849	0.4
Series 2023-R05, Class 1B2(a)	12.17%	06/25/2043	1,500	1,657,831	0.2
Series 2023-R06, Class 1B1(a)	9.22%	07/25/2043	6,500	6,798,796	0.8
Series 2023-R07, Class 2B1(a)	9.82%	09/25/2043	3,000	3,157,648	0.4
Series 2023-R07, Class 2M1(a)	7.27%	09/25/2043	6,690	6,749,525	0.8
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2018-HQA2, Class B2(a)	16.44%	10/25/2048	7,550	9,579,682	1.2
Series 2019-DNA4, Class B2(a)	11.69%	10/25/2049	3,850	4,249,838	0.5
Series 2019-FTR3, Class B2(a)	10.26%	09/25/2047	6,480	6,742,273	0.8
Series 2019-HQA3, Class B2(a)	12.94%	09/25/2049	3,244	3,624,427	0.4
Series 2020-DNA1, Class B2(a)	10.69%	01/25/2050	4,500	4,795,453	0.6
Series 2020-DNA2, Class B2(a)	10.24%	02/25/2050	7,151	7,580,060	0.9
Series 2020-DNA5, Class B2(a)	16.82%	10/25/2050	3,000	4,003,329	0.5
Series 2020-HQA1, Class B2(a)	10.54%	01/25/2050	5,500	5,740,584	0.7
Series 2020-HQA2, Class B2(a)	13.04%	03/25/2050	5,500	6,328,018	0.8
Series 2021-DNA1, Class B2(a)	10.07%	01/25/2051	2,000	2,080,000	0.3
Series 2021-DNA3, Class B2(a)	11.57%	10/25/2033	1,000	1,141,221	0.1
Series 2021-DNA5, Class B2(a)	10.82%	01/25/2034	3,000	3,228,750	0.4
Series 2021-DNA6, Class B2(a)	12.82%	10/25/2041	1,500	1,601,065	0.2
Series 2021-DNA7, Class B2(a)	13.12%	11/25/2041	1,000	1,072,707	0.1
Series 2021-DNA7, Class M1(a)	6.17%	11/25/2041	5,847	5,838,364	0.7
Series 2021-DNA7, Class M2(a)	7.12%	11/25/2041	4,650	4,683,392	0.6
Series 2021-HQA3, Class M1(a)	6.17%	09/25/2041	8,304	8,267,187	1.0
Series 2022-DNA1, Class B1(a)	8.72%	01/25/2042	1,000	1,020,359	0.1
Series 2022-DNA1, Class M1B(a)	7.17%	01/25/2042	7,812	7,832,144	0.9
Series 2022-DNA2, Class B1(a)	10.07%	02/25/2042	1,000	1,047,230	0.1
Series 2022-DNA2, Class M1A(a)	6.62%	02/25/2042	4,734	4,748,126	0.6
Series 2022-DNA3, Class M1A(a)	7.32%	04/25/2042	3,880	3,929,025	0.5
Series 2022-DNA7, Class M1A(a)	7.82%	03/25/2052	6,857	6,990,679	0.8
Series 2022-HQA1, Class M1A(a)	7.42%	03/25/2042	1,676	1,690,320	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2018-DNA3,					
Series 2018-DNA3, Class B2(a)	13.19%	09/25/2048	2,000	2,328,895	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2020-DNA2					
Series 2021-DNA2, Class B1(a)	8.72%	08/25/2033	2,000	2,168,784	0.3
Series 2021-DNA2, Class B2(a)	11.32%	08/25/2033	1,250	1,410,937	0.2
Series 2021-DNA2, Class M2(a)	7.62%	08/25/2033	1,717	1,751,499	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2021-HQA1,					
Series 2021-HQA1, Class M2(a)	7.57%	08/25/2033	6,160	6,275,552	0.8
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2022-DNA4,					
Series 2022-DNA4, Class M1A(a)	7.52%	05/25/2042	2,986	3,039,587	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2023-DNA1,					
Series 2023-DNA1, Class B1(a)	13.47%	03/25/2043	3,000	3,413,488	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2023-HQA3,					
Series 2023-HQA3, Class M2(a)	8.67%	11/25/2043	6,500	6,789,958	0.8
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2024-DNA1,					
Series 2024-DNA1, Class M1(a)	6.67%	02/25/2044	5,000	5,003,351	0.6
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured					
Agency Credit Risk Debt Notes 2015-DNA1					
Series 2015-DNA1, Class B(a)	14.64%	10/25/2027	6,254	6,712,623	0.8
Series 2015-DNA1, Class M3(a)	8.74%	10/25/2027	492	496,259	0.1

AB FCP I
Mortgage Income Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-DNA2, Series 2015-DNA2, Class B(a)	12.99%	12/25/2027	USD 6,223	\$ 6,583,747	0.8%
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-DNA3, Series 2015-DNA3, Class B(a)	14.79%	04/25/2028	6,410	7,071,146	0.9
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQ2, Series 2015-HQ2, Class B(a)	13.39%	05/25/2025	2,827	2,996,517	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQA1, Series 2015-HQA1, Class B(a)	14.24%	03/25/2028	3,448	3,627,060	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQA2, Series 2015-HQA2, Class B(a)	15.94%	05/25/2028	4,292	4,677,755	0.6
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA1, Series 2016-DNA1, Class B(a)	15.44%	07/25/2028	1,910	2,128,636	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA2, Series 2016-DNA2, Class B(a)	15.94%	10/25/2028	6,723	7,611,519	0.9
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA3, Series 2016-DNA3, Class B(a)	16.69%	12/25/2028	1,473	1,700,565	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA4, Series 2016-DNA4, Class B(a)	14.04%	03/25/2029	983	1,090,320	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-HQA1, Series 2016-HQA1, Class B(a)	18.19%	09/25/2028	2,478	2,909,923	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-HQA2, Series 2016-HQA2, Class B(a)	16.94%	11/25/2028	496	571,175	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI1, Series 2018-SPI1, Class B(b)	3.78%	02/25/2048	1,248	794,281	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI2, Series 2018-SPI2, Class B(b)	3.84%	05/25/2048	1,577	1,068,407	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI4, Series 2018-SPI4, Class B(b)	4.51%	11/25/2048	1,893	1,211,876	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities Series 2014-C04, Class 1M2(a)	10.34%	11/25/2024	357	366,466	0.0
Series 2016-C01, Class 1B(a)	17.19%	08/25/2028	2,680	3,078,457	0.4
Series 2016-C01, Class 2M2(a)	12.39%	08/25/2028	302	314,830	0.0
Series 2016-C02, Class 1B(a)	17.69%	09/25/2028	6,060	7,083,090	0.9
Series 2016-C03, Class 1B(a)	17.19%	10/25/2028	3,463	4,027,762	0.5
Series 2016-C03, Class 2B(a)	18.19%	10/25/2028	3,222	3,774,252	0.5
Series 2016-C04, Class 1B(a)	15.69%	01/25/2029	3,212	3,656,514	0.4
Series 2016-C05, Class 2B(a)	16.19%	01/25/2029	4,912	5,585,357	0.7
Series 2016-C06, Class 1B(a)	14.69%	04/25/2029	5,038	5,677,728	0.7
Series 2016-C07, Class 2B(a)	14.94%	05/25/2029	3,558	3,996,435	0.5
JP Morgan Madison Avenue Securities Trust Series 2014-CH1, Class M2(a)	9.69%	11/25/2024	490	502,732	0.1
Series 2015-CH1, Class M2(a)	10.94%	10/25/2025	1,143	1,167,376	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust Series 2019-3R, Class A(a)	9.14%	11/27/2031	747	745,752	0.1
Series 2020-1R, Class A(a)	8.79%	02/25/2025	1,071	1,063,505	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust, Series 2015-WF1, Class 1M2(a)	10.69%	11/25/2025	551	564,623	0.1
				<u>289,264,835</u>	<u>35.2</u>
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust, Series 2005-50CB, Class 1A1	5.50%	11/25/2035	755	602,305	0.1
Angel Oak Mortgage Trust, Series 2021-2, Class A1	0.99%	04/25/2066	2,824	2,332,069	0.3
Brean Asset Backed Securities Trust Series 2021-RM2, Class M2	1.75%	10/25/2061	1,564	1,109,496	0.1
Series 2022-RM3, Class M2	1.75%	02/25/2062	2,541	1,552,881	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Chase Mortgage Finance Trust, Series 2007-S5, Class 1A17	6.00%	07/25/2037	USD 1,588	\$ 702,387	0.1%
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2006-10, Class 1A8	6.00%	05/25/2036	1,157	521,190	0.1
CitiMortgage Alternative Loan Trust, Series 2007-A6, Class 1A11	6.00%	06/25/2037	91	78,182	0.0
JP Morgan Alternative Loan Trust, Series 2006-S4, Class A4(a)	6.46%	12/25/2036	2,088	2,055,446	0.2
JP Morgan Mortgage Trust Series 2018-3, Class B2	3.71%	09/25/2048	2,427	2,120,749	0.3
Series 2018-6, Class B2	3.89%	12/25/2048	1,513	1,348,554	0.2
Series 2018-9, Class B2	4.25%	02/25/2049	2,328	2,092,085	0.3
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, Series 2006-7, Class 4A4	6.00%	06/25/2036	397	190,319	0.0
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2005-AR5, Class 1A1	3.48%	10/25/2035	1,331	876,729	0.1
Verus Securitization Trust, Series 2022-4, Class A1	4.47%	04/25/2067	6,222	6,046,358	0.7
				<u>21,628,750</u>	<u>2.7</u>
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Alternative Loan Trust Series 2005-19CB, Class A2(a)	4.98%	06/25/2035	60	48,305	0.0
Series 2006-29T1, Class 2A11(a)	5.84%	10/25/2036	1,945	853,191	0.1
Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust Series 2005-AC7, Class A2(a)	6.58%	10/25/2035	232	174,920	0.0
Series 2005-AC9, Class A4(a)	6.47%	12/25/2035	234	134,167	0.0
Chase Mortgage Finance Corp. Series 2016-SH1, Class M4(b)	3.75%	04/25/2045	906	792,179	0.1
Series 2016-SH2, Class M4(b)	3.75%	12/25/2045	605	528,029	0.1
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates, Series 2005-9, Class 4A1(a)	4.58%	10/25/2035	46	42,252	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust, Series 2005-FA8, Class 1A12(a)	5.50%	11/25/2035	83	40,001	0.0
Lehman Mortgage Trust, Series 2007-1, Class 3A2(a) (c)	1.81%	02/25/2037	886	64,246	0.0
RBSGC Mortgage Loan Trust, Series 2007-A, Class 3A1(a)	5.79%	01/25/2037	12,113	2,860,965	0.3
Sequoia Mortgage Trust, Series 2018-7, Class B2(b)	4.26%	09/25/2048	2,193	2,015,774	0.2
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust, Series 2007-2, Class 1A9(a)	5.76%	04/25/2037	7,031	1,994,083	0.2
				<u>9,548,112</u>	<u>1.0</u>
VARIABEL VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS Series 3928, Class SE(a) (c)	1.14%	09/15/2041	2,953	296,788	0.0
Series 4416, Class BS(a) (c)	0.66%	12/15/2044	1,301	125,734	0.0
Series 4719, Class JS(a) (c)	0.71%	09/15/2047	2,494	266,687	0.0
Series 4767, Class SB(a) (c)	0.76%	03/15/2048	2,627	279,697	0.0
Federal National Mortgage Association REMICS Series 2012-122, Class MS(a) (c)	0.66%	11/25/2042	1,297	150,152	0.0
Series 2013-15, Class SA(a) (c)	0.71%	03/25/2043	3,040	333,224	0.0
Series 2014-40, Class HS(a) (c)	1.26%	07/25/2044	1,828	278,253	0.0
Series 2015-90, Class SL(a) (c)	0.71%	12/25/2045	3,492	378,530	0.0
Series 2016-106, Class ES(a) (c)	0.56%	01/25/2047	1,283	138,011	0.0
Series 2017-20, Class SJ(a) (c)	0.66%	04/25/2047	3,062	329,783	0.0
Series 2018-28, Class SB(a) (c)	0.76%	05/25/2048	3,216	342,084	0.0
Series 2018-30, Class SA(a) (c)	0.76%	05/25/2048	2,583	281,306	0.0
Series 2018-58, Class SA(a) (c)	0.76%	08/25/2048	1,630	183,450	0.0
Government National Mortgage Association Series 2014-181, Class TV(a) (c)	0.81%	02/16/2035	2,182	86,841	0.0
Series 2015-3, Class DS(a) (c)	0.17%	11/20/2041	1,672	32,233	0.0
				<u>3,502,773</u>	<u>0.0</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS, Series 5040, Class AI(d)	3.50%	11/25/2050	2,310	383,488	0.0
Federal National Mortgage Association REMICS Series 2015-30, Class EI(d)	5.00%	05/25/2045	395	60,698	0.0
Series 2016-64, Class BI(d)	5.00%	09/25/2046	3,362	454,009	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2021-117, Class MI(d)	3.50%	05/20/2042	12,832	1,990,286	0.2
				<u>2,888,481</u>	<u>0.3</u>
				<u>326,832,951</u>	<u>39.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(a)	8.48%	04/15/2034	USD 3,500	\$ 3,474,219	0.4%
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(a)	8.73%	04/15/2034	3,000	2,993,589	0.4
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(a)	11.94%	04/15/2034	1,000	975,867	0.1
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class E(a)	11.73%	07/20/2034	3,250	3,135,616	0.4
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class D(a)	9.28%	01/20/2034	4,000	4,002,124	0.5
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(a)	8.23%	04/20/2034	3,500	3,347,830	0.4
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(a)	11.33%	04/20/2034	3,250	3,113,614	0.4
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(a)	8.68%	10/20/2034	5,000	4,824,895	0.6
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class C(a)	9.18%	01/20/2034	2,000	1,994,808	0.2
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class D(a)	12.58%	01/20/2034	2,000	2,000,284	0.2
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class D(a)	11.56%	10/20/2034	2,000	1,946,336	0.2
Ballyrock CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	11.38%	04/20/2031	1,000	981,307	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(a)	7.34%	04/26/2031	5,000	4,982,690	0.6
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(a)	8.63%	07/23/2032	4,125	4,097,569	0.5
BlueMountain Fuji US CLO II Ltd., Series 2017-2A, Class D(a) ..	11.73%	10/20/2030	1,000	927,550	0.1
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd., Series 2014-1A, Class A1R2(a)	6.55%	04/17/2031	1,471	1,473,284	0.2
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd., Series 2014-3RA, Class A1A(a)	6.63%	07/27/2031	2,623	2,623,151	0.3
Cedar Funding IX CLO Ltd., Series 2018-9A, Class E(a)	10.93%	04/20/2031	875	821,081	0.1
CIFC Funding Ltd., Series 2013-3RA, Class A1(a)	6.56%	04/24/2031	1,412	1,412,948	0.2
Clover CLO LLC, Series 2021-3A, Class D(a)	8.69%	01/25/2035	3,000	2,998,239	0.4
Clover CLO LLC, Series 2021-3A, Class E(a)	12.05%	01/25/2035	3,400	3,411,767	0.4
Dryden 45 Senior Loan Fund, Series 2016-45A, Class BR(a)	7.28%	10/15/2030	2,200	2,199,853	0.3
Dryden 60 CLO Ltd., Series 2018-60A, Class A(a)	6.63%	07/15/2031	2,598	2,600,722	0.3
Dryden 64 CLO Ltd., Series 2018-64A, Class B(a)	6.96%	04/18/2031	3,800	3,771,546	0.4
Dryden 70 CLO Ltd., Series 2018-70A, Class B(a)	7.28%	01/16/2032	2,462	2,461,858	0.3
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(a)	8.63%	07/15/2030	1,500	1,478,089	0.2
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class D(a)	8.99%	04/22/2035	4,000	4,000,680	0.5
Goldentree Loan Management US CLO 7 Ltd., Series 2020-7A, Class DR(a)	8.73%	04/20/2034	1,000	997,316	0.1
Goldentree Loan Opportunities XI Ltd., Series 2015-11A, Class BR2(a)	6.91%	01/18/2031	8,000	7,969,584	1.0
GREYWOLF CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A2(a)	7.21%	04/26/2031	5,000	4,972,050	0.6
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class C(a)	8.78%	07/21/2031	2,000	1,907,966	0.2
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class B(a)	7.13%	04/15/2034	3,000	2,999,961	0.4
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	12.04%	04/15/2034	3,000	2,883,738	0.3
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(a)	8.33%	10/20/2030	2,000	1,982,546	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class DR(a)	8.48%	10/16/2033	1,875	1,851,735	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class D(a)	9.18%	01/20/2032	1,250	1,250,025	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class E(a)	12.78%	01/20/2032	2,500	2,501,837	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class E(a)	11.53%	07/16/2035	3,625	3,545,993	0.4
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 43 Ltd., Series 2021-43A, Class D(a)	8.68%	07/17/2035	3,000	2,948,007	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 44 Ltd., Series 2021-44A, Class E(a)	11.58%	10/16/2034	1,500	1,482,320	0.2
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(a)	8.93%	10/20/2034	5,000	4,999,840	0.6
New Mountain CLO 5 Ltd., Series CLO-5A, Class D	9.22%	04/20/2036	2,000	2,000,344	0.2
OCP CLO Ltd., Series 2018-15A, Class D(a)	11.43%	07/20/2031	1,000	979,181	0.1
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class D(a)	10.88%	01/17/2031	1,750	1,556,627	0.2
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	11.58%	10/20/2034	2,830	2,804,185	0.3
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class D(a)	9.15%	04/22/2034	4,000	4,001,660	0.5
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class D(a)	8.99%	02/25/2034	5,000	5,003,330	0.6
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class DR	9.49%	02/25/2037	5,000	5,000,000	0.6
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class A(a)	6.75%	07/20/2034	10,000	10,009,610	1.2
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(a)	8.68%	07/20/2034	5,000	4,981,065	0.6
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class E(a)	12.06%	10/18/2034	1,400	1,317,574	0.2
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	11.53%	07/15/2031	3,000	2,662,980	0.3
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2017-3A, Class B(a)	7.05%	10/20/2030	3,000	2,999,058	0.4
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	8.58%	05/20/2031	3,450	3,420,520	0.4
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-2A, Class B(a)	7.38%	10/20/2031	7,000	7,001,386	0.8
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	11.94%	07/20/2034	3,000	2,808,990	0.3
Silver Point CLO 4 Ltd., Series 2024-4A, Class D	9.42%	04/15/2037	3,000	3,001,605	0.4
TCW CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	11.64%	04/25/2031	2,250	2,155,889	0.3
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class AR(a)	6.78%	07/20/2031	1,807	1,809,434	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class B1R(a)	7.33%	07/20/2031	5,000	5,000,920	0.6

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class CR(a)	7.93%	07/20/2031	USD 2,000	\$ 1,975,248	0.2%
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class DR(a)	9.08%	07/20/2031	4,000	3,897,320	0.5
Trestles CLO II Ltd., Series 2018-2A, Class A2(a)	7.26%	07/25/2031	3,000	3,000,654	0.4
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(a)	9.58%	07/20/2030	1,500	1,387,793	0.2
Wehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(a)	8.67%	04/21/2035	3,000	2,981,913	0.4
				<u>196,101,720</u>	<u>23.5</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.65%	02/10/2036	2,000	1,466,152	0.2
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2013-WBRK, Class D	3.53%	03/10/2037	3,000	2,197,090	0.3
Banc of America Commercial Mortgage Trust Series 2015-UBS7, Class AS	3.99%	09/15/2048	1,140	1,088,412	0.1
Series 2015-UBS7, Class XA(d)	0.74%	09/15/2048	59,986	506,963	0.1
BANK					
Series 2017-BNK5, Class AS	3.62%	06/15/2060	2,500	2,297,336	0.3
Series 2017-BNK6, Class AS	3.74%	07/15/2060	2,500	2,304,445	0.3
Series 2018-BN13, Class AS	4.47%	08/15/2061	5,000	4,705,550	0.6
BBCMS Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class AS	3.90%	02/15/2050	2,500	2,347,644	0.3
Benchmark Mortgage Trust					
Series 2018-B1, Class AM	3.88%	01/15/2051	6,809	6,227,127	0.7
Series 2018-B2, Class AS	4.08%	02/15/2051	2,500	2,302,737	0.3
CCUBS Commercial Mortgage Trust,					
Series 2017-C1, Class XA(d)	1.01%	11/15/2050	11,959	326,877	0.0
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-GC29, Class XA(d)	1.01%	04/10/2048	6,187	47,752	0.0
Series 2016-P6, Class AS	4.03%	12/10/2049	3,360	3,012,555	0.4
Series 2017-P8, Class XA(d)	0.87%	09/15/2050	42,137	972,390	0.1
Series 2018-C6, Class XA(d)	0.75%	11/10/2051	7,544	220,203	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2010-C1, Class D	5.83%	07/10/2046	1,927	1,778,916	0.2
Series 2010-C1, Class F	4.00%	07/10/2046	3,780	3,257,545	0.4
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	1,500	712,502	0.1
Series 2013-LC6, Class D	3.96%	01/10/2046	221	207,413	0.0
Series 2014-CR16, Class D	4.92%	04/10/2047	1,841	1,435,372	0.2
Series 2014-CR19, Class XA(d)	0.82%	08/10/2047	53,468	99,874	0.0
Series 2014-CR20, Class XA(d)	0.92%	11/10/2047	7,060	12,205	0.0
Series 2014-UBS2, Class D	4.93%	03/10/2047	1,250	1,037,500	0.1
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	190	181,515	0.0
Series 2015-CR22, Class XA(d)	0.81%	03/10/2048	13,166	64,193	0.0
Series 2015-LC19, Class XA(d)	1.08%	02/10/2048	44,941	204,071	0.0
Series 2016-DC2, Class XA(d)	0.91%	02/10/2049	43,036	557,149	0.1
CSAIL Commercial Mortgage Trust,					
Series 2017-C8, Class XA(d)	1.07%	06/15/2050	51,029	1,369,737	0.2
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class C	5.15%	08/10/2044	4,850	3,609,525	0.4
Series 2013-GC13, Class C	3.84%	07/10/2046	4,537	3,671,563	0.4
Series 2013-GC13, Class D	3.84%	07/10/2046	2,190	1,052,034	0.1
Series 2014-GC22, Class A5	3.86%	06/10/2047	2,500	2,484,838	0.3
Series 2014-GC22, Class XA(d)	0.92%	06/10/2047	5,075	923	0.0
Series 2016-GS3, Class A4	2.85%	10/10/2049	2,500	2,331,977	0.3
Series 2017-GS5, Class XA(d)	0.83%	03/10/2050	50,255	997,084	0.1
Series 2017-GS6, Class AS	3.64%	05/10/2050	2,000	1,848,360	0.2
Series 2017-GS7, Class XA(d)	1.08%	08/10/2050	25,584	708,796	0.1
Series 2017-GS8, Class XA(d)	0.94%	11/10/2050	34,115	904,859	0.1
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2012-C6, Class E	4.96%	05/15/2045	2,250	1,972,580	0.2
Series 2012-C6, Class G	2.97%	05/15/2045	2,500	1,769,363	0.2
Series 2013-C10, Class D	4.07%	12/15/2047	1,550	1,330,699	0.2
Series 2014-C20, Class XA(d)	0.68%	07/15/2047	3,354	234	0.0
Series 2016-JP2, Class XA(d)	1.79%	08/15/2049	35,299	1,074,266	0.1
Series 2016-JP3, Class B	3.40%	08/15/2049	2,000	1,696,836	0.2
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C14, Class D	4.11%	08/15/2046	3,425	2,193,127	0.3
Series 2013-C17, Class D	4.70%	01/15/2047	2,535	2,395,575	0.3
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	2,000	1,912,685	0.2
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.77%	09/15/2047	76,056	64,975	0.0
Series 2014-C24, Class C	4.37%	11/15/2047	6,000	4,793,595	0.6
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(d)	1.52%	07/12/2050	24,113	887,912	0.1
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2014-C18, Class C	4.46%	10/15/2047	1,333	1,279,497	0.2
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	1,225	1,078,812	0.1
Series 2014-C19, Class XA(d)	0.95%	12/15/2047	25,066	51,455	0.0
Series 2015-C20, Class XA(d)	1.23%	02/15/2048	48,643	201,835	0.0

AB FCPI
Mortgage Income Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2015-C22, Class XA(d)	1.00%	04/15/2048	USD 44,065	\$ 251,062	0.0%
Series 2015-C25, Class XA(d)	1.03%	10/15/2048	27,581	270,392	0.0
Series 2017-C34, Class XA(d)	0.77%	11/15/2052	29,561	606,827	0.1
Morgan Stanley Capital I Trust					
Series 2016-UBS9, Class XA(d)	1.11%	03/15/2049	53,856	812,445	0.1
Series 2019-BPR, Class XCP(d)	0.00%	04/15/2024	163,600	1,636	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2017-C3, Class XA(d)	1.11%	08/15/2050	31,097	783,806	0.1
Series 2017-C4, Class XA(d)	1.09%	10/15/2050	17,061	520,042	0.1
Series 2017-C5, Class XA(d)	1.07%	11/15/2050	30,406	782,829	0.1
Series 2018-C10, Class XA(d)	0.85%	05/15/2051	71,185	2,123,758	0.3
Series 2018-C14, Class XA(d)	0.87%	12/15/2051	40,965	1,315,281	0.2
Series 2018-C15, Class XA(d)	0.88%	12/15/2051	18,783	627,748	0.1
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust,					
Series 2013-C6, Class D	3.95%	04/10/2046	3,090	2,640,436	0.3
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-C27, Class XA(d)	0.82%	02/15/2048	110,898	513,866	0.1
Series 2015-C29, Class C	4.22%	06/15/2048	3,852	3,392,444	0.4
Series 2015-C31, Class A3	3.43%	11/15/2048	1,147	1,115,701	0.1
Series 2015-NXS3, Class A4	3.62%	09/15/2057	1,425	1,375,784	0.2
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	1,313	1,261,476	0.1
Series 2016-C32, Class XA(d)	1.20%	01/15/2059	52,879	933,076	0.1
Series 2016-C33, Class XA(d)	1.56%	03/15/2059	32,906	781,466	0.1
Series 2016-C35, Class B	3.44%	07/15/2048	2,500	2,312,979	0.3
Series 2016-C36, Class XA(d)	1.16%	11/15/2059	42,818	983,181	0.1
Series 2016-LC25, Class AS(b)	3.86%	12/15/2059	2,216	2,074,401	0.2
Series 2017-C38, Class XA(d)	0.93%	07/15/2050	27,390	631,353	0.1
Series 2018-C43, Class A4	4.01%	03/15/2051	5,750	5,461,586	0.7
Series 2018-C46, Class AS	4.38%	08/15/2051	4,500	4,172,702	0.5
Series 2018-C47, Class A4	4.44%	09/15/2061	5,000	4,831,460	0.6
Series 2018-C48, Class XA(d)	0.93%	01/15/2052	41,696	1,433,931	0.2
WFRBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	4.98%	06/15/2044	713	556,140	0.1
Series 2012-C10, Class B	3.74%	12/15/2045	1,846	1,631,338	0.2
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.76%	09/15/2057	30,670	52,664	0.0
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	3,164	3,021,908	0.4
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	1,290	1,188,052	0.1
Series 2014-C25, Class XA(d)	0.78%	11/15/2047	21,366	52,095	0.0
				<u>129,768,495</u>	<u>15.7</u>
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Ashford Hospitality Trust, Series 2018-KEYS, Class A(a)	6.49%	06/15/2035	702	696,117	0.1
BHMS, Series 2018-ATLS, Class A(a)	6.86%	07/15/2035	3,000	2,990,450	0.4
Braemar Hotels & Resorts Trust, Series 2018-PRME, Class A(a)	6.31%	06/15/2035	132	131,806	0.0
BX Trust, Series 2018-BILT, Class A(a)	6.42%	05/15/2030	5,000	4,995,313	0.6
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Multifamily Structured Credit Risk,					
Series 2021-MN1, Class M2(a)	9.07%	01/25/2051	1,700	1,669,334	0.2
FS Rialto Issuer LLC, Series 2022-FL4, Class A(a)	7.22%	01/19/2039	5,000	4,996,886	0.6
HGI CRE CLO Ltd., Series 2022-FL3, Class A(a)	7.02%	04/20/2037	5,000	4,984,549	0.6
Morgan Stanley Capital I Trust					
Series 2019-BPR, Class D(a)	9.92%	05/15/2036	2,750	2,607,496	0.3
Series 2019-BPR, Class E(a)	10.67%	05/15/2036	2,250	2,028,293	0.2
RIAL Issuer Ltd., Series 2022-FL8, Class A(a)	7.57%	01/19/2037	3,000	2,992,515	0.4
				<u>28,092,759</u>	<u>3.4</u>
				<u>157,861,254</u>	<u>19.1</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2018	4.00%	10/01/2048	4,201	3,940,496	0.5
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.50%	10/01/2030	1	1,313	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.50%	06/01/2031	21	22,485	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2003	5.00%	11/01/2033	108	107,288	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2004	8.00%	09/01/2033	229	236,891	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.00%	07/01/2037	113	112,867	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.50%	05/01/2038	149	151,873	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	05/01/2039	56	55,689	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	02/01/2040	373	373,479	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	04/01/2040	570	570,420	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	12/01/2040	517	518,068	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2011	5.00%	04/01/2041	251	251,489	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/01/2044	546	546,107	0.1
Government National Mortgage Association,					
Series 2009	5.00%	10/15/2039	117	117,047	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Government National Mortgage Association, Series 2012	5.50%	06/15/2038	USD 37	\$ 37,454	0.0%
Government National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/20/2041	275	273,745	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA	5.00%	03/01/2042	18,000	17,581,225	2.1
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA	5.50%	03/15/2042	25,000	24,840,020	3.0
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2024, TBA	5.00%	03/01/2042	5,000	4,849,219	0.6
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2024, TBA	5.50%	03/01/2042	7,500	7,419,727	0.9
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2024, TBA	6.00%	03/01/2042	25,000	25,109,375	3.0
				<u>87,116,277</u>	<u>10.5</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE 15-YEAR					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	5.00%	07/01/2025	2	1,566	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2012	5.00%	06/01/2026	0*	79	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2014	3.50%	02/01/2029	269	261,087	0.0
				<u>262,732</u>	<u>0.0</u>
				<u>87,379,009</u>	<u>10.5</u>
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
TGIF Funding LLC, Series 2017-1A, Class A2	6.20%	04/30/2047	4,868	4,603,756	0.6
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Octane Receivables Trust, Series 2022-1A, Class D	5.54%	02/20/2029	3,708	3,554,182	0.4
				<u>8,157,938</u>	<u>1.0</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
FINANZEN					
Curo Group Holdings Corp.	7.50%	08/01/2028	5,323	1,470,799	0.1
				<u>777,803,671</u>	<u>93.4</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I Series 2019-24, Class PT	10.37%	08/15/2044	61	59,338	0.0
Series 2019-44, Class PT	12.44%	11/15/2044	89	85,170	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I Series 2018-20, Class PT	(25.37)%	11/16/2043	2	2,128	0.0
Series 2019-48, Class PT	14.71%	12/15/2044	79	74,774	0.0
SMB Private Education Loan Trust Series 2021-A, Class R(e)	0.00%	01/15/2053	2	4,416,700	0.5
Series 2021-C, Class R(e)	0.00%	01/15/2053	14	7,290,000	0.9
Series 2022-A, Class R(e)	0.00%	11/16/2054	3	3,048,117	0.4
				<u>14,976,227</u>	<u>1.8</u>
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Octane Receivables Trust Series 2020-1A, Class R1(e)	0.00%	03/20/2028	9	428,518	0.0
Series 2021-1A, Class R1(e)	0.00%	11/20/2028	5	694,027	0.1
Santander Consumer Auto Receivables Trust Series 2021-BA, Class R(e)	0.00%	03/15/2029	5	1,019,866	0.1
Series 2021-CA, Class R(e)	0.00%	06/15/2028	6	538,401	0.1
				<u>2,680,812</u>	<u>0.3</u>
				<u>17,657,039</u>	<u>2.1</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Commercial Mortgage Trust Series 2012-CR3, Class E	4.29%	10/15/2045	2,173	977,793	0.1
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	2,000	1,958,436	0.2
Grantor Trust COMM(e)	0.00%	03/10/2047	14	170,047	0.0
Grantor Trust CSAIL(e)	4.00%	04/15/2050	226	2,542,387	0.4
Grantor Trust JPMBB(e)	4.00%	11/15/2047	210	1,309,780	0.1
Grantor Trust WFRBS(e)	3.40%	10/15/2057	217	3,532,268	0.4
GS Mortgage Securities Trust, Series 2011-GC5, Class D	5.15%	08/10/2044	493	178,600	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2012-C6, Class E	4.53%	11/15/2045	425	204,002	0.0
				<u>10,873,313</u>	<u>1.2</u>
NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS					
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2017-SCH, Class AF(a)	6.37%	11/15/2033	3,000	2,688,581	0.3
				<u>13,561,894</u>	<u>1.5</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
FINANZEN					
Curo SPV LLC(e)	18.00%	08/02/2027	USD 1,804	\$ 1,493,910	0.2%
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Residential Accredit Loans, Inc. Trust, Series 2006-QO3, Class A1(a)	5.86%	04/25/2046	2,333	625,569	0.1
STAMMAKTIEN					
Mt. Logan Re, Ltd. Special Investment, Series 4, December 2021 - Class U-1(e)			632	181,919	0.0
Mt. Logan Re, Ltd. Special Investment, Series 4, December 2022 - Class U-1(e)			924	431,935	0.1
				613,854	0.1
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Virgolino de Oliveira Finance SA(e) (f)	10.88%	01/13/2020	USD 1,665	167	0.0
				33,952,433	4.0
Gesamtanlagen				\$ 811,756,104	97.4%
(Kosten \$952,611,308)					
Termineinlagen					
ANZ, London(g)	3.15 %	–		23,225	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	2.58 %	–		13	0.0
HSBC, Hong Kong(g)	2.69 %	–		34,004	0.0
HSBC, Paris(g)	2.86 %	–		17	0.0
Scotiabank, Toronto(g)	4.68 %	–		83,380,387	10.0
SMBC, London(g)	4.68 %	–		19,790,199	2.4
Standard Chartered Bank, Johannesburg(g)	6.65 %	–		142,374	0.0
Termineinlagen insgesamt				103,370,219	12.4
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(81,544,059)	(9.8)
Nettovermögen				\$ 833,582,264	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 812	USD 537	03/04/2024	\$ 8,595
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 32,001	USD 20,789	03/04/2024	(11,236)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1,317	USD 1,424	03/04/2024	1,193
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 204	USD 220	03/04/2024	(507)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 32	USD 41	03/04/2024	75
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 8	USD 6	03/04/2024	45
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 842	USD 625	03/04/2024	(488)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 275	AUD 424	03/04/2024	237
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 21,326	AUD 32,389	03/04/2024	(272,945)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 20	EUR 19	03/04/2024	52
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,629	EUR 1,502	03/04/2024	(6,106)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 41	GBP 32	03/04/2024	(256)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 15	SGD 20	03/04/2024	15
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 620	SGD 829	03/04/2024	(3,528)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 856	ZAR 16,507	03/04/2024	4,726
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 7,879	ZAR 148,232	03/04/2024	(150,432)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 7,708	USD 404	03/04/2024	1,677
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 157,031	USD 8,185	03/04/2024	(2,560)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 115	USD 16	03/11/2024	23
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 854	USD 119	03/11/2024	(65)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 22	USD 24	03/11/2024	69
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 166	USD 179	03/11/2024	(389)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,420	CNH 17,401	03/11/2024	(3,998)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,008	EUR 934	03/11/2024	2,379
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 9	EUR 9	03/11/2024	(15)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 55	USD 8	03/25/2024	11
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 273	USD 38	03/25/2024	(22)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 35	USD 38	03/25/2024	87
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,337	CNH 16,783	03/25/2024	(4,139)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,057	EUR 977	03/25/2024	(161)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 424	USD 276	04/02/2024	(258)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 8	USD 8	04/02/2024	23

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP	0**	USD	0**	04/02/2024	\$ 0***
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	5	USD	4	04/02/2024	(2)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	20,707	AUD	31,844	04/02/2024	11,064
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	986	EUR	911	04/02/2024	(667)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	41	GBP	32	04/02/2024	(77)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	625	SGD	841	04/02/2024	480
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	8,185	ZAR	157,413	04/02/2024	1,949
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	2,820	USD	146	04/02/2024	(422)
						\$ (425,573)
					Wertsteigerung	\$ 32,700
					Wertminderung	\$ (458,273)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 4,720	01/12/2026	4.183%	1 Day SOFR	\$ 34,948
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 6,340	01/29/2026	4.161%	1 Day SOFR	48,197
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 4,390	02/26/2026	4.576%	1 Day SOFR	(2,426)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 14,760	04/25/2027	2.774%	1 Day SOFR	627,466
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 14,760	04/25/2027	1 Day SOFR	2.774%	20,612
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 11,380	07/01/2027	2.937%	1 Day SOFR	443,567
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 12,630	10/04/2027	3.737%	1 Day SOFR	177,358
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 12,570	10/11/2027	3.795%	1 Day SOFR	151,994
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 17,100	11/10/2027	4.092%	1 Day SOFR	32,488
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 1,726	03/16/2028	1 Day SOFR	3.583%	(32,800)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 5,980	08/11/2028	3.887%	1 Day SOFR	41,855
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 6,080	09/15/2028	4.171%	1 Day SOFR	(29,533)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 4,470	01/10/2029	3.672%	1 Day SOFR	67,982
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 3,120	01/12/2029	3.678%	1 Day SOFR	46,688
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 3,040	01/29/2029	3.752%	1 Day SOFR	35,353
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 1,860	02/26/2029	4.074%	1 Day SOFR	(5,485)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 3,370	04/25/2032	2.719%	1 Day SOFR	274,463
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 2,040	07/01/2032	2.914%	1 Day SOFR	141,582
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 3,940	03/03/2033	3.740%	1 Day SOFR	42,341
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 1,560	01/12/2034	3.630%	1 Day SOFR	30,964
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 1,950	01/29/2034	3.752%	1 Day SOFR	19,231
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 2,040	02/26/2034	3.962%	1 Day SOFR	(15,191)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 390	01/12/2044	3.652%	1 Day SOFR	9,773
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 580	01/29/2044	3.806%	1 Day SOFR	2,132
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 610	02/26/2044	3.925%	1 Day SOFR	(7,843)
Insgesamt					\$ 2,155,716
				Wertsteigerung	\$ 2,248,994
				Wertminderung	\$ (93,278)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 921	\$ (116,269)	\$ (102,977)	\$ (13,292)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 370	(46,740)	(27,071)	(19,669)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,152	(145,336)	(58,825)	(86,511)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 948	(119,583)	(113,473)	(6,110)
Insgesamt				\$ (427,928)	\$ (302,346)	\$ (125,582)
Swaps insgesamt						\$ 2,030,134

- * Kapitalbetrag geringer als 500.
- ** Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.
- *** Betrag kleiner als 0.50.
- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 29. Februar 2024.
- (b) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 29. Februar 2024.
- (c) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (d) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (f) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (g) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

- ABS – Asset-Backed Securities
- CDX-CMBX.NA. – North American Commercial Mortgage-Backed Index
- CLO – Collateralized Loan Obligations
- CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities
- CME – Chicago Mercantile Exchange
- LCH – London Clearing House
- REMICS – Real Estate Mortgage Investment Conduits
- SOFR – Secured Overnight Financing Rate
- SPI – Share Price Index

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS

29. Februar 2024

AB FCPI

	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Emerging Markets Growth Portfolio (USD)	Asia Ex-Japan Equity Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	\$ 92,223,617	\$ 585,274,445	\$ 300,370,297
Termineinlagen.	2,997,947	4,249,591	3,429,957
Dividenden- und Zinsforderungen.	99,182	690,637	798,739
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital.	15,763	903,866	1,657,761
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel.	564,981	1,709,705	3,994,913
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	580,701	-0-	2,289,039
Zinsforderungen aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	107,842	6,002	53,227
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren.	-0-	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	-0-	-0-	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe	104	16,735	-0-
Sonstige Forderungen	-0-	-0-	-0-
	<u>96,590,137</u>	<u>592,850,981</u>	<u>312,593,933</u>
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere.	512,085	-0-	8,769,423
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar.	49,390	-0-	-0-
Zu zahlende Dividenden.	-0-	2,679	507,255
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital.	115,669	885,363	2,298,430
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	-0-	-0-	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften.	125,825	48,672	583,901
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps	-0-	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	-0-	-0-	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	217,709	1,059,882	1,847,214
	<u>1,020,678</u>	<u>1,996,596</u>	<u>14,006,223</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>\$ 95,569,459</u>	<u>\$ 590,854,385</u>	<u>\$ 298,587,710</u>

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

Japan Strategic Value Portfolio (JPY)	China Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Short Duration Bond Portfolio (USD)	Global High Yield Portfolio (USD)	American Income Portfolio (USD)	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)
¥ 8,689,135,208	\$ 62,268,055	\$ 444,282,952	\$ 14,395,849,346	\$ 23,619,021,277	€ 1,146,802,847	\$ 469,858,661
39,199,839	1,882,828	4,546,197	230,299,104	201,818,527	14,957,854	6,451,854
9,378,136	-0-	4,466,900	205,470,555	275,721,465	17,311,391	6,670,827
305,888,073	56,163	1,120,439	82,938,104	197,722,290	14,058,833	1,504,731
-0-	29,334	4,900,643	96,708,573	22,339,843	12,839,849	9,638,232
-0-	-0-	221,108	70,059,418	68,299,198	-0-	578,022
3,219,978	135,840	7,592,297	22,556,366	75,308,915	1,194,755	-0-
-0-	-0-	95,221	12,560,858	26,008,655	-0-	611,036
29,926,391	30,325	473,493	10,329,363	21,453,084	1,302,354	162,875
-0-	-0-	-0-	17,306,041	8,339,071	-0-	810,447
-0-	-0-	32,126	3,239,976	14,946,603	792,410	202,930
449,968	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
<u>9,077,197,593</u>	<u>64,402,545</u>	<u>467,731,376</u>	<u>15,147,317,704</u>	<u>24,530,978,928</u>	<u>1,209,260,293</u>	<u>496,489,615</u>
18,261,730	-0-	20,876,778	137,120,924	209,540,333	5,646,653	4,752,332
219,236,520	-0-	1,124,203	191,571,999	120,031,443	11,926,550	40,000
6,207,979	114,135	593,547	94,535,223	103,069,553	3,723,635	1,660,605
28,525,229	363,626	1,622,687	16,061,046	46,982,137	4,239,750	442,284
-0-	-0-	-0-	38,584,986	30,947,476	1,813,574	1,074,335
10,323,948	317,233	1,481,128	25,188,673	32,555,470	2,045,336	1,144,328
-0-	-0-	-0-	4,497,135	24,436,425	1,506,830	1,438,067
-0-	-0-	93,501	-0-	12,170,858	420,801	803,955
-0-	-0-	179,194	882,156	3,723,609	1,862,510	-0-
<u>24,164,988</u>	<u>213,125</u>	<u>557,551</u>	<u>19,347,146</u>	<u>25,521,466</u>	<u>1,338,182</u>	<u>566,873</u>
<u>306,720,394</u>	<u>1,008,119</u>	<u>26,528,589</u>	<u>527,789,288</u>	<u>608,978,770</u>	<u>34,523,821</u>	<u>11,922,779</u>
<u>¥ 8,770,477,199</u>	<u>\$ 63,394,426</u>	<u>\$ 441,202,787</u>	<u>\$ 14,619,528,416</u>	<u>\$ 23,922,000,158</u>	<u>€ 1,174,736,472</u>	<u>\$ 484,566,836</u>

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)

29. Februar 2024

AB FCPI

	Mortgage Income Portfolio (USD)	Kombiniert (USD)
VERMÖGENSWERTE		
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	\$ 811,756,104	\$ 42,030,704,922*
Termineinlagen	103,370,219	575,475,312
Dividenden- und Zinsforderungen	5,025,785	517,412,105*
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	8,065,356	311,228,710
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	4,361,438	158,124,971
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	2,248,994	141,406,740
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	1,198,515	110,974,538
Zinsforderungen aus Swaps	3,237,145	42,512,915
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	32,700	34,257,002
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	-0	26,455,559
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	-0	19,278,072
Forderungen aus der Wertpapierleihe	-0	19,854
Sonstige Forderungen	46,552	46,552
	<u>939,342,808</u>	<u>43,967,897,252*</u>
VERBINDLICHKEITEN		
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	91,931,319	479,728,450
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	4,383,744	331,559,879
Zu zahlende Dividenden	2,499,935	206,744,060*
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	1,844,228	75,388,911
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	951,958	73,518,865
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	458,273	64,183,273
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	218,860	32,219,069
Zinsaufwand für Swaps	2,572,505	16,095,621
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	-0	6,797,960
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	899,722	51,838,901
	<u>105,760,544</u>	<u>1,338,074,989*</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>\$ 833,582,264</u>	<u>\$ 42,629,822,263*</u>

* Die Anlagetätigkeit innerhalb des American Income Portfolio in Bezug auf dessen Anlage in das Emerging Markets Debt Portfolio wurde im Rahmen des konsolidierten Abschlusses zu Darstellungszwecken nicht berücksichtigt.

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS

Für den Zeitraum zum 29. Februar 2024

AB FCPI

	Dynamic Diversified Portfolio (USD) (a)	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Emerging Markets Growth Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Zinsen	\$ 43,316	\$ 45,654	\$ 305,098
Swap-Erträge	918	-0-	-0-
Dividenden, netto	8,755	487,941	3,552,688
Erträge auf aus Wertpapierleihe, netto	-0-	3,052	41,087
	<u>52,989</u>	<u>536,647</u>	<u>3,898,873</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	14,887	371,441	4,262,277
Aufwendungen für Swaps	144	-0-	-0-
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	1,066	14,685	233,859
Transferstelle	1,119	21,500	145,789
Vertriebsgebühr	320	2,055	4,935
Steuern	-0-	17,156	174,443
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	15,000	51,072	102,151
Depotbankgebühren	-0-	13,428	125,508
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	-0-	17,182	44,294
Druckkosten	-0-	546	4,085
Sonstige Aufwendungen	2,337	18,037	48,888
	<u>34,873</u>	<u>527,102</u>	<u>5,146,229</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	<u>(11,516)</u>	<u>(62,634)</u>	<u>-0-</u>
Nettoaufwendungen	23,357	464,468	5,146,229
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	<u>29,632</u>	<u>72,179</u>	<u>(1,247,356)</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	744,601	(12,602)	(28,938,521)
Kapitalertragsteuer	-0-	(20,222)	(1,344)
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	(815,454)	7,053,555	53,741,724
Aus Finanzterminkontrakten	(199,501)	-0-	-0-
Aus Devisentermingeschäften	(15,163)	(153,137)	(1,157)
Aus Swaps	(6,836)	-0-	-0-
Auf Fremdwährung	<u>(4,579)</u>	<u>5,933</u>	<u>4,221</u>
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	(267,300)	6,945,706	23,557,567
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	(24,623,806)	(6,373,704)	(36,472,124)
Ausschüttungen	-0-	-0-	(18,608)
NETTOVERMÖGEN			
Beginn des Berichtszeitraums	24,891,106	94,997,457	603,787,550
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Ende des Berichtszeitraums	<u>\$ -0-</u>	<u>\$ 95,569,459</u>	<u>\$ 590,854,385</u>

(a) Die Finanzinformationen für das Dynamic Diversified Portfolio beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. September 2023 bis zum 19. September 2023. Siehe Anmerkung A.

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

Asia Ex-Japan Equity Portfolio (USD)	Japan Strategic Value Portfolio (JPY)	China Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Short Duration Bond Portfolio (USD)	Global High Yield Portfolio (USD)	American Income Portfolio (USD)	European Income Portfolio (EUR)
\$ 132,818	¥ 3,663,196	\$ 154,229	\$ 10,961,518	\$ 509,072,850	\$ 631,863,035	€ 32,064,590
-0-	-0-	-0-	424,738	40,115,120	80,497,669	203,599
3,010,205	67,735,768	767,442	-0-	16,563,120	17,094,552	-0-
105	2,207,539	177	-0-	-0-	-0-	-0-
3,143,128	73,606,503	921,848	11,386,256	565,751,090	729,455,256	32,268,189
1,702,557	30,777,804	605,234	1,370,734	92,416,810	106,934,005	4,888,295
-0-	-0-	-0-	433,665	3,018,870	28,515,030	913,474
50,577	1,018,304	16,912	195,969	6,112,360	9,610,012	455,267
85,670	1,027,109	39,582	134,488	4,239,057	5,392,978	250,882
46,322	-0-	1,745	-0-	4,309,003	5,822,946	2,244
48,664	-0-	17,838	95,641	2,394,965	4,987,347	210,010
127,177	4,804,276	36,147	147,129	436,635	437,189	140,452
120,544	5,118,958	36,428	74,946	295,957	487,773	126,530
25,431	322,035	10,880	40,542	201,175	201,175	62,591
7,550	-0-	1,692	-0-	72,500	108,645	8,050
65,439	1,107,049	26,923	31,430	350,312	501,191	68,464
2,279,931	44,175,535	793,381	2,524,544	113,847,644	162,998,291	7,126,259
(51,049)	(7,132,079)	(70,265)	(67,255)	-0-	(17)	-0-
2,228,882	37,043,456	723,116	2,457,289	113,847,644	162,998,274	7,126,259
914,246	36,563,047	198,732	8,928,967	451,903,446	566,456,982	25,141,930
(3,494,009)	515,813,866	(11,636,481)	(15,205,748)	(139,037,542)	(283,247,349)	(8,223,400)
(988,451)	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
25,870,008	425,927,373	6,647,108	19,033,044	555,872,479	518,272,998	64,743,790
-0-	-0-	-0-	(402,404)	683,664	(28,730,523)	(57,419)
(355,711)	2,182,410	(298,090)	863,891	(16,942,143)	(14,434,264)	(5,422,940)
-0-	-0-	-0-	802,814	43,592,847	48,849,228	(989,698)
9,221	746,637	(2,354)	67,627	(2,059,779)	(75,939)	(46)
21,955,304	981,233,333	(5,091,085)	14,088,191	894,012,972	807,091,133	75,192,217
(41,337,067)	485,812,367	(51,398,106)	(107,575,456)	683,178,930	2,777,777,349	(354,173)
(3,132,163)	(37,863,871)	(810,321)	(3,766,840)	(547,446,219)	(562,863,301)	(21,873,948)
321,101,636	7,341,295,370	120,693,938	538,456,892	13,589,782,733	20,899,994,977	1,121,772,376
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
\$ 298,587,710	¥ 8,770,477,199	\$ 63,394,426	\$ 441,202,787	\$ 14,619,528,416	\$ 23,922,000,158	€ 1,174,736,472

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS**(Fortsetzung)****Für den Zeitraum zum 29. Februar 2024****AB FCPI**

	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)	Mortgage Income Portfolio (USD)	Kombiniert (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Zinsen	\$ 19,178,049	\$ 36,675,253	\$ 1,243,019,151
Swap-Erträge	664,818	2,748,623	124,671,345
Dividenden, netto	-0-	613,854	40,729,342*
Erträge auf aus Wertpapierleihe, netto	-0-	-0-	59,432
	<u>19,842,867</u>	<u>40,037,730</u>	<u>1,408,479,270*</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	1,729,408	3,204,907	218,090,642
Aufwendungen für Swaps	833,549	1,897,210	35,683,102
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	85,684	160,794	16,979,575
Transferstelle	158,342	213,540	10,709,475
Vertriebsgebühr	41,077	519	10,231,341
Steuern	89,420	161,598	8,213,442
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	108,257	135,148	1,779,967
Depotbankgebühren	59,868	50,378	1,436,025
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	38,751	55,058	704,145
Druckkosten	3,946	4,886	212,527
Sonstige Aufwendungen	36,499	39,921	1,202,302
	<u>3,184,801</u>	<u>5,923,959</u>	<u>305,242,543</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	-0-	(1,303)	(312,537)
Nettoaufwendungen	3,184,801	5,922,656	304,930,006
Netto-Anlageertrag	<u>16,658,066</u>	<u>34,115,074</u>	<u>1,103,549,264*</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	(15,277,706)	(2,678,850)	(504,140,676)
Kapitalertragsteuer	-0-	-0-	(1,010,017)
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	31,807,027	12,253,230	1,300,644,095*
Aus Finanzterminkontrakten	(476,523)	-0-	(29,187,179)
Aus Devisentermingeschäften	437,424	(28,450)	(36,757,347)
Aus Swaps	(587,790)	273,711	91,857,179
Auf Fremdwährung	(289,975)	(1,195)	(2,341,791)
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	<u>32,270,523</u>	<u>43,933,520</u>	<u>1,922,613,528*</u>
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	(20,045,187)	59,413,790	3,235,466,381
Ausschüttungen	(9,924,959)	(14,480,079)	(1,164,448,074)*
NETTOVERMÖGEN			
Beginn des Berichtszeitraums	482,266,459	744,715,033	38,641,686,390
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	(5,495,962)*
Ende des Berichtszeitraums	<u>\$ 484,566,836</u>	<u>\$ 833,582,264</u>	<u>\$ 42,629,822,263*</u>

* Die Anlagetätigkeit innerhalb des American Income Portfolio in Bezug auf dessen Anlage in das Emerging Markets Debt Portfolio wurde im Rahmen des konsolidierten Abschlusses zu Darstellungszwecken nicht berücksichtigt.

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

KLASSE	Global Equity Blend Portfolio	Emerging Markets Growth Portfolio	Asia Ex-Japan Equity Portfolio
A	435,390	10,146,838	618,455
A AUD H	-0-	135,842	212,524
A EUR	16,176	139,791	1,085,951
A EUR H	185,753	-0-	-0-
A HKD	-0-	10,373	33,720
A PLN H	-0-	35,353	-0-
A SGD	58,086	1,467	-0-
A SGD H	-0-	2,373	3,953
AD	-0-	35,945	1,608,325
AD AUD H	-0-	-0-	2,173,656
AD CAD H	-0-	-0-	480,697
AD EUR	-0-	-0-	46,755
AD EUR H	-0-	-0-	30,132
AD GBP H	-0-	-0-	319,994
AD HKD	-0-	-0-	990,340
AD NZD H	-0-	-0-	475,073
AD ZAR H	-0-	-0-	1,821,701
AY JPY	-0-	-0-	104,501,449
B	15,736	13,082	-0-
B SGD	2,153	-0-	-0-
BY JPY	-0-	-0-	612,181,001
C	115,455	154,248	625
C EUR	107	959	1,345
ED	-0-	39,631	96,590
ED AUD H	-0-	-0-	2,494
I	22,127	428,978	777,048
I AUD H	-0-	133,635	-0-
I EUR	20,012	21,609	5,830
I GBP	-0-	-0-	382
N	-0-	7,726	-0-
S	-0-	-0-	530,928
S HKD	363,365	-0-	448,219
S1	259,574	2,048,377	2,646,258
S1 EUR	272	6,195	311
S1 GBP	277	131	-0-
S1 SGD	1,369,254	-0-	-0-
SD	-0-	-0-	545,510

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

29. Februar 2024

AB FCPI

KLASSE	Japan Volatility Equity Portfolio	China Low Volatility Equity Portfolio	Short Duration Bond Portfolio
A	37,181	548,793	2,508,940
A CZK H	397	-0-	-0-
A EUR	36,020	25,956	48,910
A EUR H	52,248	-0-	-0-
A HKD	-0-	29,263	-0-
A PLN H	-0-	17,417	-0-
A SGD	2,326	-0-	-0-
A SGD H	14,721	-0-	-0-
A USD	32,318	-0-	-0-
A USD H	67,118	-0-	-0-
A2	-0-	-0-	8,473,455
A2 EUR	-0-	-0-	78,966
A2 EUR H	-0-	-0-	7,803
A2 HKD	-0-	-0-	8,658
A2 SGD H	-0-	-0-	53
AA	-0-	-0-	319,961
AA AUD H	-0-	-0-	691,331
AA CAD H	-0-	-0-	292,070
AA GBP H	-0-	-0-	173,267
AA HKD	-0-	-0-	274,188
AA SGD H	-0-	-0-	24,495
AD	8,864	446,382	-0-
AD AUD H	209,550	965,218	-0-
AD CAD H	-0-	65,984	-0-
AD EUR H	-0-	20,846	-0-
AD GBP H	-0-	44,593	-0-
AD HKD	-0-	145,104	-0-
AD NZD H	21,083	142,595	-0-
AD SGD H	-0-	7,060	-0-
AD USD H	47,070	-0-	-0-
AD ZAR H	37,207	2,948,127	-0-
AJ	-0-	-0-	3,326,092
AT	-0-	-0-	4,616,046
AT AUD H	-0-	-0-	332,050
AT CAD H	-0-	-0-	42,473
AT EUR	-0-	-0-	111,399
AT EUR H	-0-	-0-	10,048
AT GBP H	-0-	-0-	86,064
AT HKD	-0-	-0-	302,975
AT NZD H	-0-	-0-	40,395
AT SGD H	-0-	-0-	27,133
AX	-0-	-0-	16,134
B	-0-	10,894	-0-
B EUR	-0-	282	-0-
C	232	5,467	175,041
C EUR	100	1,258	-0-
C EUR H	521	-0-	-0-
C USD	500	-0-	-0-
C2	-0-	-0-	217,073
I	6,359	1,367	764,956
I EUR	23,369	292	-0-
I EUR H	367	-0-	-0-
I USD	33,892	-0-	-0-
I USD H	14,101	-0-	-0-
I2	-0-	-0-	718,603
I2 EUR H	-0-	-0-	2,582,552
IT	-0-	-0-	78,980
N2	-0-	-0-	343,034
NT	-0-	-0-	24,997

KLASSE	Japan Volatility Equity Portfolio	China Low Volatility Equity Portfolio	Short Duration Bond Portfolio
S	-0-	-0-	896,549
S1	-0-	241,153	121,229
S1 2	-0-	-0-	1,090,177
S1 2 EUR	-0-	-0-	567
S1 EUR	74	98	-0-
S1 EUR H	-0-	-0-	3,653
S1 USD	153,573	-0-	-0-
SA	-0-	-0-	32,824
SD	69,108	-0-	-0-

KLASSE	Global High Yield Portfolio	American Income Portfolio	European Income Portfolio
A	123,447,921	162,468,546	1,928,081
A EUR	1,012,869	604,000	-0-
A USD	-0-	-0-	445,467
A2	35,902,850	61,722,001	2,421,120
A2 CHF H	6,575	307,904	4,845
A2 DUR PH	-0-	729	-0-
A2 EUR	742,711	1,083,867	-0-
A2 EUR H	3,278,005	1,912,077	-0-
A2 HKD	205,694	1,032,950	-0-
A2 PLN H	113,067	804,990	110,894
A2 SGD	7,460	16,469	-0-
A2 SGD H	650,664	1,100,756	-0-
A2 USD	-0-	-0-	328,457
A2 USD H	-0-	-0-	339,887
AA	389,612,907	165,904,390	1,948,212
AA AUD H	144,799,270	51,584,497	7,820,079
AA CAD H	2,670,678	7,446,374	-0-
AA DUR PH	-0-	478,619	-0-
AA EUR H	2,496,398	3,798,417	-0-
AA GBP H	6,731,095	11,341,432	-0-
AA HKD	28,141,461	80,416,583	-0-
AA HKD H	-0-	-0-	3,805,119
AA NZD H	3,168,430	7,784,397	-0-
AA RMB H	5,938,684	21,313,688	598,230
AA SGD H	1,841,494	2,742,621	81,500
AA USD H	-0-	-0-	33,489,753
AA ZAR H	243,254,724	24,006,210	-0-
AK	13,318	29,260	127,789
AK EUR	164,802	28,906	-0-
AK EUR H	3,457	15,120	-0-
AR	-0-	-0-	2,868,969
AR EUR	-0-	4,486	-0-
AR EUR H	28,020	156,497	-0-
AT	1,235,436,663	950,294,033	12,846,198
AT AUD H	68,540,308	114,423,603	3,511,420
AT CAD H	7,383,438	34,078,187	-0-
AT DUR PH	-0-	38,141	-0-
AT EUR	8,919,110	5,222,329	-0-
AT EUR H	4,920,390	13,480,737	-0-
AT GBP H	3,777,883	25,750,762	-0-
AT HKD	82,049,462	368,483,001	-0-
AT NZD H	10,572,831	18,071,979	-0-
AT RMB H	2,721,910	10,265,030	-0-
AT SGD	3,303,722	2,169,961	-0-

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

29. Februar 2024

AB FCPI

	Global High Yield Portfolio	American Income Portfolio	European Income Portfolio
KLASSE			
AT SGD H.....	16,941,846	42,203,348	509,151
AT USD.....	-0-	-0-	497,423
AT USD H.....	-0-	-0-	9,518,071
B.....	758,126	505,952	-0-
B USD.....	-0-	-0-	107,008
B2.....	2,028	33,947	680
B2 USD.....	-0-	-0-	1,300
BT.....	280,440	552,625	-0-
BT AUD H.....	12,484	-0-	-0-
C.....	15,345,382	19,399,166	564,619
C EUR.....	29,381	28,518	-0-
C USD.....	-0-	-0-	91,631
C2.....	1,405,236	5,156,218	105,234
C2 EUR.....	6,515	63,073	-0-
C2 EUR H.....	9,191	46,471	-0-
C2 USD.....	-0-	-0-	9,837
C2 USD H.....	-0-	-0-	77,984
CK.....	-0-	-0-	56,972
CT.....	19,083	150,883	-0-
CT USD H.....	-0-	-0-	47,601
EA.....	183,314,316	148,598,351	-0-
EA AUD H.....	12,051,280	10,480,606	-0-
EA ZAR H.....	26,743,712	8,533,407	-0-
I.....	13,901,025	52,762,212	1,849,040
I EUR.....	86,808	68,244	-0-
I USD.....	-0-	-0-	389,879
I2.....	7,572,220	40,252,188	7,952,328
I2 AUD H.....	4,448	3,339,487	152,336
I2 CHF H.....	2,993	166,642	633
I2 EUR.....	23,672	485,483	-0-
I2 EUR H.....	226,123	1,452,279	-0-
I2 HKD.....	-0-	254	-0-
I2 SGD.....	31,721	-0-	-0-
I2 SGD H.....	28,547	250,523	-0-
I2 USD.....	-0-	-0-	225,573
I2 USD H.....	-0-	-0-	255,792
IA.....	-0-	365,678	74,652
IA AUD H.....	215,618	2,675,628	-0-
IA HKD H.....	-0-	-0-	1,308
IA USD H.....	-0-	-0-	1,156
IQD.....	20,184	-0-	-0-
IT.....	2,857,960	19,288,766	227,650
IT AUD H.....	748,282	313,489	-0-
IT CAD H.....	30,605	419,569	-0-
IT EUR H.....	20,086	109,551	-0-
IT GBP H.....	18,272	359,919	-0-
IT HKD.....	116,844	661,191	-0-
IT JPY.....	-0-	309,364	-0-
IT JPY H.....	-0-	334,380	-0-
IT NZD H.....	-0-	35,400	-0-
IT RMB H.....	12,142	241,214	-0-
IT SGD.....	-0-	31,303	-0-
IT SGD H.....	-0-	4,011,057	-0-
IT USD H.....	-0-	-0-	134,299
J.....	4,533,873	123,699,214	-0-
N2.....	370,751	3,780,463	-0-
NT.....	1,617,364	3,223,880	-0-
NT USD H.....	-0-	-0-	54,978
S.....	-0-	1,188,575	-0-

	Global High Yield Portfolio	American Income Portfolio	European Income Portfolio
KLASSE			
S1	14,025,702	56,797,306	188,653
S1 EUR H	421	-0-	-0-
S1 USD	-0-	-0-	349
S1 USD H	-0-	-0-	5,954,243
S1D	29,278,305	29,079,602	298,073
S1D2	168,020	1,542,927	-0-
S1L GBP H	754	-0-	-0-
SA	512,742	4,497,776	-0-
SA USD H	-0-	-0-	1,012,475
SHK	143,100	2,625,103	67,901
SK	9,560,625	-0-	-0-
W	28,291	3,361,875	-0-
W EUR	799	-0-	-0-
W2	76,238	3,965,559	214,010
W2 CHF H	7,008	120,764	29,660
W2 EUR H	14,299	157,650	-0-
W2 USD H	-0-	-0-	5,667
WA	-0-	-0-	410,646
WA USD H	-0-	-0-	286,890
WT	188,740	6,797,096	61,462
WT AUD H	164,108	1,184,042	-0-
WT CAD H	39,435	-0-	-0-
WT EUR H	43,378	581,337	-0-
WT GBP H	3,688	356,315	-0-
WT HKD	-0-	916,453	-0-
WT RMB H	8,356	-0-	-0-
WT SGD H	-0-	1,563,788	-0-
WT USD H	-0-	-0-	4,234

	Emerging Markets Debt Portfolio	Mortgage Income Portfolio
KLASSE		
A	851,138	8,607,070
A EUR	595	-0-
A2	403,510	5,178,750
A2 CHF H	729	-0-
A2 EUR	140,128	92,453
A2 EUR H	12,121	-0-
A2 HKD	8,132	6,223
A2 PLN H	28,956	-0-
A2 SGD H	235,437	-0-
A2X	-0-	143,168
A2X EUR	-0-	26,154
AA	3,925,686	7,678,189
AA AUD H	2,472,261	2,840,536
AA CAD H	13,129	-0-
AA EUR H	1,267	-0-
AA GBP H	54,852	-0-
AA HKD	410,317	3,793,612
AA NZD H	44,729	-0-
AA RMB H	-0-	489,896
AA SGD H	-0-	52,020
AA ZAR H	7,049,789	2,303,717
AI	21,952	-0-
AI AUD H	2,589	-0-
AR EUR	1,050	-0-

	Emerging Markets Debt Portfolio	Mortgage Income Portfolio
KLASSE		
AR EUR H	-0-	31,095
AT	5,409,222	1,864,521
AT AUD H	4,049,866	225,018
AT CAD H	126,954	-0-
AT EUR	35,986	19,586
AT EUR H	221,273	-0-
AT GBP H	31,114	2,668
AT HKD	443,024	71,715
AT NZD H	405,750	-0-
AT SGD H	219,843	29,013
AX	-0-	461,735
AX EUR	-0-	4,354
BT	18,790	-0-
BX	-0-	34,951
BX EUR	-0-	3,298
C	165,974	1,181,722
C EUR	616	-0-
C2	78,343	972,980
C2 EUR	547	507
C2 EUR H	541	-0-
CT	1,173	-0-
CX	-0-	17,800
EA	628,067	-0-
EA AUD H	151,401	-0-
EA ZAR H	234,959	-0-
EI	189,858	-0-
EI AUD H	10,066	-0-
I	201,871	3,624,732
I EUR	-0-	3,381
I2	44,465	8,586,825
I2 AUD H	218,790	-0-
I2 CHF H	600	-0-
I2 EUR	179,742	191,722
I2 EUR H	3,325,969	141,477
IT AUD H	1,398	-0-
IT EUR H	1,333,333	1,829
IX	-0-	88,229
N2	10,640	180,960
NT	69,881	329,743
S	275	1,342
S1	-0-	7,551,971
S1 2	3,110,716	-0-
S1 AUD H	-0-	16,123
S1 EUR H	521	90
S1 GBPH	431	-0-
S1L	12,727	2,190
SA	955,582	317,689

	Dynamic Diversified Portfolio (1)		
	19. September 19 2023 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 6,785,711	\$ 24,891,106	\$ 35,394,677
Klasse			
A.....	\$ 20.75	\$ 21.04	\$ 20.28
A EUR.....	€ 19.43	€ 19.41	€ 20.18
A EUR H.....	€ 17.26	€ 17.52	€ 17.41
AX.....	\$ 25.04	\$ 25.39	\$ 24.45
AX EUR.....	€ 23.44	€ 23.41	€ 24.33
AX SGD.....	SGD 34.18	SGD 34.33	SGD 34.20
BX.....	\$ 20.75	\$ 21.06	\$ 20.49
BX SGD.....	N/A	N/A	SGD 28.69
C.....	\$ 20.09	\$ 20.38	\$ 19.70
C EUR.....	€ 18.81	€ 18.79	€ 19.60
C EUR H.....	€ 16.70	€ 16.96	€ 16.89
CX.....	\$ 23.78	\$ 24.12	\$ 23.30
I.....	\$ 22.46	\$ 22.77	\$ 21.79
I EUR.....	€ 21.02	€ 20.99	€ 21.68
I EUR H (2).....	N/A	€ 18.95	€ 18.71
IX (3).....	N/A	\$ 28.71	\$ 27.46

	Global Equity Blend Portfolio		
	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 95,569,459	\$ 94,997,457	\$ 92,151,147
Klasse			
A.....	\$ 27.29	\$ 25.44	\$ 23.07
A EUR.....	€ 25.25	€ 23.46	€ 22.96
A EUR H.....	€ 22.88	€ 21.55	€ 20.21
A SGD.....	SGD 36.75	SGD 34.41	SGD 32.27
B.....	\$ 22.23	\$ 20.83	\$ 19.08
B SGD.....	SGD 29.95	SGD 28.18	SGD 26.69
C.....	\$ 25.15	\$ 23.50	\$ 21.41
C EUR.....	€ 14.81	€ 13.79	€ 13.54
I.....	\$ 32.25	\$ 29.94	\$ 26.94
I EUR.....	€ 29.83	€ 27.61	€ 26.80
S HKD.....	HKD 315.06	HKD 291.30	HKD 259.26
S1.....	\$ 35.44	\$ 32.82	\$ 29.40
S1 EUR.....	€ 32.78	€ 30.27	€ 29.25
S1 GBP.....	£ 28.08	£ 25.92	£ 25.31
S1 SGD.....	SGD 47.73	SGD 44.40	SGD 41.12

	Emerging Markets Growth Portfolio		
	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 590,854,385	\$ 603,787,550	\$ 546,098,583
Klasse			
A.....	\$ 42.87	\$ 41.22	\$ 42.46
A AUD H.....	AUD 17.75	AUD 17.24	AUD 18.31
A EUR.....	€ 39.66	€ 38.00	€ 42.24
A HKD.....	HKD 335.72	HKD 323.30	HKD 333.27
A PLN H.....	PLN 97.96	PLN 94.33	PLN 94.78
A SGD.....	SGD 57.74	SGD 55.76	SGD 59.38
A SGD H.....	SGD 14.17	SGD 13.76	SGD 14.42
AD.....	\$ 15.04	\$ 14.75	\$ 15.78
B.....	\$ 31.55	\$ 30.48	\$ 31.72
C.....	\$ 34.87	\$ 33.60	\$ 34.77
C EUR.....	€ 32.27	€ 30.99	€ 34.59
ED.....	\$ 10.82	\$ 10.60	\$ 11.34
I.....	\$ 53.21	\$ 50.95	\$ 52.07
I AUD H.....	AUD 19.62	AUD 18.98	AUD 19.98
I EUR.....	€ 49.23	€ 46.99	€ 51.80
N.....	\$ 20.88	\$ 20.12	\$ 20.81
S1.....	\$ 55.60	\$ 53.19	\$ 54.26
S1 EUR.....	€ 51.51	€ 49.12	€ 54.03
S1 GBP.....	£ 44.13	£ 42.07	£ 46.77

	Asia Ex-Japan Equity Portfolio		
	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 298,587,710	\$ 321,101,636	\$ 495,340,478
Klasse			
A.....	\$ 23.03	\$ 21.56	\$ 21.89
A AUD H.....	AUD 21.92	AUD 20.67	AUD 21.66
A EUR.....	€ 21.30	€ 19.87	€ 21.77
A HKD.....	HKD 180.36	HKD 169.06	HKD 171.82
A SGD H.....	SGD 16.06	SGD 15.16	SGD 15.69
AD.....	\$ 13.59	\$ 12.99	\$ 13.74
AD AUD H.....	AUD 11.34	AUD 10.86	AUD 11.75
AD CAD H.....	CAD 9.81	CAD 9.38	CAD 10.04
AD EUR.....	€ 12.70	€ 12.07	€ 13.71
AD EUR H.....	€ 12.16	€ 11.63	€ 12.46
AD GBP H.....	£ 12.06	£ 11.55	£ 12.39
AD HKD.....	HKD 106.50	HKD 101.92	HKD 107.91
AD NZD H.....	NZD 12.41	NZD 11.88	NZD 12.84
AD RMB H (4).....	N/A	CNH 79.22	CNH 85.40
AD ZAR H.....	R 88.11	R 84.28	R 90.69
AY JPY.....	¥ 2.49	¥ 2.26	¥ 2.19
BD.....	N/A	N/A	\$ 13.65
BD AUD H.....	N/A	N/A	AUD 11.74
BD HKD.....	N/A	N/A	HKD 107.18
BY JPY.....	¥ 2.35	¥ 2.14	¥ 2.08

Asia Ex-Japan Equity Portfolio (Fortsetzung)

	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
C.....	\$ 21.60	\$ 20.26	\$ 20.67
C EUR	€ 19.96	€ 18.67	€ 20.57
ED	\$ 11.73	\$ 11.18	\$ 11.79
ED AUD H.....	AUD 13.57	AUD 12.97	AUD 13.98
I	\$ 25.83	\$ 24.08	\$ 24.25
I AUD H (5)	N/A	AUD 23.42	AUD 24.34
I EUR.....	€ 23.89	€ 22.19	€ 24.13
I GBP.....	£ 22.97	£ 21.34	£ 23.45
S.....	\$ 30.11	\$ 27.93	\$ 27.85
S HKD	HKD235.79	HKD219.06	HKD 218.61
S1	\$ 26.43	\$ 24.63	\$ 24.78
S1 EUR	€ 24.47	€ 22.72	€ 24.66
SD	\$ 92.73	\$ 88.86	\$ 94.48

Japan Strategic Value Portfolio

	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	¥ 8,770,477,199	¥ 7,341,295,370	¥ 6,696,083,364
Klasse			
A.....	¥ 15,916.00	¥ 14,251.00	¥ 12,031.00
A CZK H	CZK1,479.56	CZK1,279.17	CZK1,009.83
A EUR	€ 98.33	€ 90.44	€ 86.22
A EUR H	€ 37.99	€ 33.37	€ 27.64
A PLN (6)	N/A	PLN 404.26	PLN 407.17
A SGD	SGD 142.92	SGD 132.43	SGD 121.07
A SGD H	SGD 24.14	SGD 21.21	SGD 17.29
A USD	\$ 106.25	\$ 97.99	\$ 86.63
A USD H	\$ 48.76	\$ 42.49	\$ 34.28
AD	¥ 15,168.00	¥ 13,728.00	¥ 11,876.00
AD AUD H	AUD 19.69	AUD 17.81	AUD 15.49
AD NZD H.....	NZD 20.41	NZD 18.46	NZD 15.97
AD USD H.....	\$ 19.90	\$ 17.98	\$ 15.52
AD ZAR H.....	R 140.23	R 126.43	R 109.05
C.....	¥ 14,552.00	¥ 13,074.00	¥ 11,128.00
C EUR	€ 89.95	€ 83.00	€ 79.82
C EUR H	€ 35.06	€ 30.90	€ 25.81
C USD	\$ 97.11	\$ 89.91	\$ 80.16
I	¥ 18,291.00	¥ 16,313.00	¥ 13,666.00
I EUR.....	€ 113.07	€ 103.56	€ 98.03
I EUR H	€ 42.33	€ 37.04	€ 30.46
I SGD.....	N/A	N/A	SGD1 37.54
I USD.....	\$ 122.10	\$ 112.21	\$ 98.42
I USD H	\$ 53.74	\$ 46.65	\$ 37.36
S EUR H (7)	N/A	€ 37.32	€ 30.46
S1 EUR	€ 120.34	€ 110.17	€ 104.16
S1 USD	\$ 129.98	\$ 119.39	\$ 104.61
SD	¥ 16,641.00	¥ 15,019.00	¥ 12,939.00

	China Low Volatility Equity Portfolio		
	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 63,394,426	\$ 120,693,938	\$ 121,824,745
Klasse			
A.....	\$ 40.88	\$ 41.95	\$ 47.68
A EUR.....	€ 37.82	€ 38.68	€ 47.44
A HKD.....	HKD 320.07	HKD 328.99	HKD 374.26
A PLN H.....	PLN 70.65	PLN 72.32	PLN 80.57
AD.....	\$ 10.78	\$ 11.33	\$ 13.51
AD AUD H.....	AUD 9.36	AUD 9.85	AUD 12.03
AD CAD H.....	CAD 9.86	CAD 10.36	CAD 12.47
AD EUR H.....	€ 10.15	€ 10.68	€ 12.87
AD GBP H.....	£ 9.97	£ 10.49	£ 12.65
AD HKD.....	HKD 84.48	HKD 88.96	HKD 106.05
AD NZD H.....	NZD 9.64	NZD 10.15	NZD 12.39
AD SGD H.....	SGD 10.06	SGD 10.59	SGD 12.77
AD ZAR H.....	R 62.63	R 65.99	R 80.64
B.....	\$ 31.41	\$ 32.39	\$ 37.19
B EUR.....	€ 29.06	€ 29.87	€ 37.00
BD NZD H.....	N/A	N/A	NZD 12.46
C.....	\$ 37.86	\$ 38.94	\$ 44.46
C EUR.....	€ 35.02	€ 35.91	€ 44.24
I.....	\$ 50.30	\$ 51.41	\$ 57.96
I EUR.....	€ 46.52	€ 47.40	€ 57.67
S (8).....	N/A	\$ 65.80	\$ 73.44
S1.....	\$ 56.68	\$ 57.85	\$ 65.05
S1 EUR.....	€ 52.45	€ 53.36	€ 64.74

	Short Duration Bond Portfolio		
	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 441,202,787	\$ 538,456,892	\$ 479,574,798
Klasse			
A.....	\$ 7.15	\$ 7.06	\$ 7.13
A EUR.....	€ 6.62	€ 6.52	€ 7.11
A2.....	\$ 18.52	\$ 18.05	\$ 17.74
A2 EUR.....	€ 17.15	€ 16.65	€ 17.66
A2 EUR H.....	€ 13.87	€ 13.63	€ 13.73
A2 HKD.....	HKD 145.12	HKD 141.60	HKD 139.28
A2 SGD H (9).....	SGD 15.30	N/A	N/A
AA.....	\$ 10.52	\$ 10.47	\$ 10.70
AA AUD H.....	AUD 10.28	AUD 10.24	AUD 10.51
AA CAD H.....	CAD 10.54	CAD 10.50	CAD 10.75
AA GBP H.....	£ 10.48	£ 10.44	£ 10.69
AA HKD.....	HKD 82.42	HKD 82.13	HKD 84.03
AA SGD H.....	SGD 10.48	SGD 10.45	SGD 10.71
AJ.....	\$ 6.87	\$ 6.79	\$ 6.86
AT.....	\$ 7.13	\$ 7.05	\$ 7.12
AT AUD H.....	AUD 11.03	AUD 10.92	AUD 11.07
AT CAD H.....	CAD 11.25	CAD 11.13	CAD 11.26
AT EUR.....	€ 6.61	€ 6.52	€ 7.11
AT EUR H.....	€ 10.87	€ 10.76	€ 10.89
AT GBP H.....	£ 11.30	£ 11.19	£ 11.32
AT HKD.....	HKD 55.91	HKD 55.38	HKD 55.98
AT NZD H.....	NZD 11.43	NZD 11.31	NZD 11.44
AT SGD H.....	SGD 11.58	SGD 11.48	SGD 11.62
AX.....	\$ 5.71	\$ 5.65	\$ 5.70
B.....	N/A	N/A	\$ 7.14
C.....	\$ 7.15	\$ 7.07	\$ 7.14
C2.....	\$ 15.12	\$ 14.75	\$ 14.56
C2 EUR H (10).....	N/A	€ 12.84	€ 12.98
I.....	\$ 7.15	\$ 7.07	\$ 7.14
I EUR (11).....	N/A	€ 6.52	€ 7.12
I2.....	\$ 13.59	\$ 13.20	\$ 12.90
I2 EUR (12).....	N/A	€ 12.17	€ 12.83
I2 EUR H.....	€ 14.98	€ 14.67	€ 14.70
IT.....	\$ 11.73	\$ 11.60	\$ 11.72
N2.....	\$ 14.61	\$ 14.27	\$ 14.09
NT.....	\$ 11.57	\$ 11.45	\$ 11.56
S.....	\$ 92.76	\$ 91.73	\$ 92.67
S1.....	\$ 101.40	\$ 100.27	N/A
S1 2.....	\$ 17.30	\$ 16.79	\$ 16.36
S1 2 EUR.....	€ 16.01	€ 15.48	€ 16.28
S1 EUR H.....	€ 102.57	€ 100.33	N/A
SA.....	\$ 80.32	\$ 79.47	\$ 80.36

	Global High Yield Portfolio		
	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 14,619,528,416	\$ 13,589,782,733	\$ 14,421,357,362
Klasse			
A.....	\$ 3.15	\$ 3.06	\$ 3.09
A EUR.....	€ 2.95	€ 2.85	€ 3.08
A2.....	\$ 17.28	\$ 16.18	\$ 15.12
A2 CHF H.....	CHF 15.13	CHF 14.46	CHF 14.11
A2 EUR.....	€ 15.99	€ 14.92	€ 15.04
A2 EUR H.....	€ 23.46	€ 22.17	€ 21.32
A2 HKD.....	HKD 135.33	HKD 126.89	HKD 118.67
A2 PLN H.....	PLN 112.50	PLN 105.04	PLN 95.78
A2 SGD.....	SGD 23.27	SGD 21.88	SGD 21.14
A2 SGD H.....	SGD 21.92	SGD 20.71	SGD 19.62
AA.....	\$ 8.12	\$ 8.00	\$ 8.28
AA AUD H.....	AUD 7.51	AUD 7.43	AUD 7.76
AA CAD H.....	CAD 7.66	CAD 7.56	CAD 7.87
AA EUR H.....	€ 7.78	€ 7.68	€ 8.00
AA GBP H.....	£ 7.60	£ 7.51	£ 7.83
AA HKD.....	HKD 63.66	HKD 62.81	HKD 65.01
AA NZD H.....	NZD 7.63	NZD 7.54	NZD 7.85
AA RMB H.....	CNH 52.63	CNH 52.01	CNH 54.32
AA SGD H.....	SGD 7.86	SGD 7.77	SGD 8.09
AA ZAR H.....	R 51.98	R 51.28	R 53.40
AK.....	\$ 10.20	\$ 9.92	\$ 10.01
AK EUR.....	€ 9.55	€ 9.23	€ 10.01
AK EUR H.....	€ 9.94	€ 9.68	€ 9.84
AR EUR H.....	€ 8.56	€ 8.09	€ 8.50
AT.....	\$ 3.12	\$ 3.03	\$ 3.05
AT AUD H.....	AUD 10.28	AUD 10.02	AUD 10.20
AT CAD H.....	CAD 9.48	CAD 9.23	CAD 9.35
AT EUR.....	€ 2.92	€ 2.82	€ 3.05
AT EUR H.....	€ 10.54	€ 10.26	€ 10.41
AT GBP H.....	£ 10.41	£ 10.15	£ 10.31
AT HKD.....	HKD 24.47	HKD 23.80	HKD 23.99
AT NZD H.....	NZD 9.53	NZD 9.28	NZD 9.42
AT RMB H.....	CNH 68.61	CNH 66.84	CNH 67.98
AT SGD.....	SGD 4.21	SGD 4.11	SGD 4.28
AT SGD H.....	SGD 9.63	SGD 9.39	SGD 9.52
B.....	\$ 3.17	\$ 3.07	\$ 3.09
B2.....	\$ 24.12	\$ 22.70	\$ 21.42
BA.....	N/A	N/A	\$ 7.54
BAAUD H.....	N/A	N/A	AUD 7.05
BT.....	\$ 3.20	\$ 3.10	\$ 3.12
BT AUD H.....	AUD 10.35	AUD 10.07	AUD 10.22
BT HKD.....	N/A	N/A	HKD 24.48
BT NZD H.....	N/A	N/A	NZD 9.56
C.....	\$ 3.16	\$ 3.07	\$ 3.09
C EUR.....	€ 2.95	€ 2.85	€ 3.08
C2.....	\$ 24.00	\$ 22.53	\$ 21.15
C2 EUR.....	€ 22.21	€ 20.77	€ 21.05

Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)

	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
C2 EUR H	€ 18.29	€ 17.33	€ 16.75
CK (13)	N/A	\$ 9.91	\$ 9.99
CK EUR H (14)	N/A	€ 9.70	€ 9.85
CT	\$ 10.64	\$ 10.33	\$ 10.39
EA	\$ 9.67	\$ 9.56	\$ 9.95
EA AUD H	AUD 9.85	AUD 9.77	AUD 10.26
EA ZAR H	R 67.12	R 66.44	R 69.54
I	\$ 3.15	\$ 3.06	\$ 3.09
I EUR	€ 2.95	€ 2.85	€ 3.08
I2	\$ 11.19	\$ 10.44	\$ 9.71
I2 AUD H	AUD 28.97	AUD 27.29	AUD 25.89
I2 CHF H	CHF 15.85	CHF 15.12	CHF 14.66
I2 EUR	€ 10.35	€ 9.63	€ 9.66
I2 EUR H	€ 25.18	€ 23.75	€ 22.72
I2 SGD	SGD 15.06	SGD 14.13	SGD 13.58
I2 SGD H	SGD 19.21	SGD 18.11	SGD 17.06
IA AUD H	AUD 9.65	AUD 9.52	AUD 9.90
IQD	\$ 10.03	\$ 9.73	\$ 9.80
IQD EUR	N/A	N/A	€ 9.82
IT	\$ 9.78	\$ 9.51	\$ 9.59
IT AUD H	AUD 9.11	AUD 8.88	AUD 9.05
IT CAD H	CAD 11.27	CAD 10.98	CAD 11.14
IT EUR H	€ 10.43	€ 10.16	€ 10.32
IT GBP H	£ 11.17	£ 10.88	£ 11.07
IT HKD	HKD 76.65	HKD 74.61	HKD 75.28
IT RMB H	CNH 65.39	CNH 63.72	CNH 64.89
J	\$ 3.41	\$ 3.31	\$ 3.32
N2	\$ 19.75	\$ 18.54	\$ 17.42
NT	\$ 10.07	\$ 9.78	\$ 9.84
S1	\$ 30.20	\$ 28.17	\$ 26.14
S1 EUR (15)	N/A	€ 25.99	€ 26.02
S1 EUR H	€ 106.63	€ 100.43	N/A
S1D	\$ 15.90	\$ 15.24	\$ 14.96
S1D2	\$ 106.40	\$ 103.33	N/A
S1L GBP H	£ 105.78	£ 101.57	N/A
SA	\$ 64.98	\$ 63.41	\$ 64.44
SHK	\$ 71.90	\$ 70.16	\$ 71.27
SK	\$ 40.82	\$ 38.03	\$ 35.21
W	\$ 11.87	\$ 11.53	\$ 11.63
W EUR	€ 11.11	€ 10.73	€ 11.61
W2	\$ 17.35	\$ 16.19	\$ 15.03
W2 CHF H	CHF 14.49	CHF 13.81	CHF 13.38
W2 EUR H	€ 15.20	€ 14.32	€ 13.68
WT	\$ 10.79	\$ 10.48	\$ 10.57
WT AUD H	AUD 10.14	AUD 9.88	AUD 10.06
WT CAD H	CAD 11.45	CAD 11.15	CAD 11.31
WT EUR H	€ 10.48	€ 10.21	€ 10.36
WT GBP H	£ 11.30	£ 11.02	£ 11.21
WT RMB H	CNH 77.19	CNH 75.23	CNH 76.63

	American Income Portfolio		
	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 23,922,000,158	\$ 20,899,994,977	\$ 16,566,716,085
Klasse			
A.....	\$ 6.44	\$ 6.39	\$ 6.69
A EUR.....	€ 6.05	€ 5.96	€ 6.68
A2.....	\$ 30.11	\$ 28.98	\$ 28.52
A2 CHF H.....	CHF 14.45	CHF 14.22	CHF 14.64
A2 DUR PH.....	\$ 20.77	\$ 19.67	\$ 17.99
A2 EUR.....	€ 27.86	€ 26.72	€ 28.37
A2 EUR H.....	€ 17.72	€ 17.22	€ 17.47
A2 HKD.....	HKD 235.79	HKD 227.27	HKD 223.83
A2 PLN H.....	PLN 105.64	PLN 101.52	PLN 97.57
A2 SGD.....	SGD 40.55	SGD 39.19	SGD 39.88
A2 SGD H.....	SGD 19.95	SGD 19.38	SGD 19.33
AA.....	\$ 9.55	\$ 9.55	\$ 10.14
AA AUD H.....	AUD 9.05	AUD 9.07	AUD 9.73
AA CAD H.....	CAD 9.06	CAD 9.07	CAD 9.68
AA DUR PH.....	\$ 10.71	\$ 10.52	\$ 10.34
AA EUR H.....	€ 9.05	€ 9.07	€ 9.70
AA GBP H.....	£ 8.92	£ 8.95	£ 9.58
AA HKD.....	HKD 74.80	HKD 74.91	HKD 79.60
AA NZD H.....	NZD 9.01	NZD 9.04	NZD 9.67
AA RMB H.....	CNH 61.49	CNH 61.63	CNH 66.07
AA SGD H.....	SGD 9.24	SGD 9.26	SGD 9.89
AA ZAR H.....	R 62.62	R 62.67	R 66.91
AK.....	\$ 10.67	\$ 10.59	\$ 11.10
AK EUR.....	€ 10.06	€ 9.92	€ 11.13
AK EUR H.....	€ 10.42	€ 10.37	€ 10.96
AR EUR.....	€ 10.33	€ 9.91	€ 11.38
AR EUR H.....	€ 9.51	€ 9.25	€ 9.95
AT.....	\$ 6.43	\$ 6.38	\$ 6.68
AT AUD H.....	AUD 10.49	AUD 10.45	AUD 11.04
AT CAD H.....	CAD 10.53	CAD 10.47	CAD 11.01
AT DUR PH.....	\$ 12.54	\$ 12.18	\$ 11.74
AT EUR.....	€ 6.04	€ 5.96	€ 6.68
AT EUR H.....	€ 10.51	€ 10.45	€ 11.02
AT GBP H.....	£ 10.39	£ 10.34	£ 10.91
AT HKD.....	HKD 50.42	HKD 50.11	HKD 52.44
AT NZD H.....	NZD 10.03	NZD 9.98	NZD 10.52
AT RMB H.....	CNH 71.11	CNH 70.77	CNH 74.80
AT SGD.....	SGD 8.68	SGD 8.65	SGD 9.35
AT SGD H.....	SGD 10.60	SGD 10.56	SGD 11.10
B.....	\$ 6.47	\$ 6.41	\$ 6.69
B2.....	\$ 23.51	\$ 22.70	\$ 22.50
B2 HKD.....	N/A	N/A	HKD 176.60
BA.....	N/A	N/A	\$ 9.51
BA AUD H.....	N/A	N/A	AUD 9.10
BT.....	\$ 6.51	\$ 6.45	\$ 6.74
BT AUD H.....	N/A	N/A	AUD 11.12
BT CAD H.....	N/A	N/A	CAD 10.94
BT EUR H.....	N/A	N/A	€ 11.03

American Income Portfolio (Fortsetzung)

	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
BT GBP H	N/A	N/A	£ 11.00
BT HKD	N/A	N/A	HKD 52.91
BT NZD H	N/A	N/A	NZD 10.59
C	\$ 6.46	\$ 6.41	\$ 6.69
C EUR	€ 6.06	€ 5.98	€ 6.69
C2	\$ 36.21	\$ 34.92	\$ 34.52
C2 DUR PH	N/A	N/A	\$ 17.25
C2 EUR	€ 33.50	€ 32.20	€ 34.34
C2 EUR H	€ 16.71	€ 16.27	€ 16.58
CT	\$ 10.80	\$ 10.71	\$ 11.19
EA	\$ 10.84	\$ 10.86	\$ 11.59
EA AUD H	AUD 10.36	AUD 10.42	AUD 11.23
EA ZAR H	R 71.42	R 71.63	R 76.85
I	\$ 6.42	\$ 6.38	\$ 6.69
I EUR	€ 6.04	€ 5.96	€ 6.68
I2	\$ 18.23	\$ 17.49	\$ 17.12
I2 AUD H	AUD 15.50	AUD 15.01	AUD 14.97
I2 CHF H	CHF 15.38	CHF 15.08	CHF 15.44
I2 DUR PH (16)	N/A	\$ 20.56	\$ 18.70
I2 EUR	€ 16.86	€ 16.13	€ 17.03
I2 EUR H	€ 19.46	€ 18.86	€ 19.03
I2 HKD	HKD 142.90	HKD 137.34	HKD 134.36
I2 SGD (17)	N/A	SGD 23.67	SGD 23.95
I2 SGD H	SGD 18.11	SGD 17.54	SGD 17.39
IA	\$ 11.08	\$ 11.05	\$ 11.66
IA AUD H	AUD 10.55	AUD 10.55	AUD 11.25
IT	\$ 10.47	\$ 10.40	\$ 10.90
IT AUD H	AUD 9.79	AUD 9.75	AUD 10.32
IT CAD H	CAD 11.46	CAD 11.40	CAD 12.01
IT EUR H	€ 11.40	€ 11.36	€ 12.00
IT GBP H	£ 11.30	£ 11.27	£ 11.91
IT HKD	HKD 82.06	HKD 81.64	HKD 85.57
IT JPY	¥ 11,111.00	¥ 10,600.00	¥ 10,425.00
IT JPY H	¥ 6,629.00	¥ 6,609.00	¥ 7,002.00
IT NZD H	NZD 11.34	NZD 11.30	NZD 11.94
IT RMB H	CNH 77.20	CNH 76.90	CNH 81.38
IT SGD (18)	SGD 15.58	N/A	SGD 15.26
IT SGD H	SGD 10.69	SGD 10.65	SGD 11.23
J	\$ 6.59	\$ 6.54	\$ 6.82
L2 (19)	N/A	\$ 14.38	\$ 14.12
LT (20)	N/A	\$ 11.52	\$ 12.06
N2	\$ 17.53	\$ 16.91	\$ 16.73
NT	\$ 10.50	\$ 10.41	\$ 10.88
S	\$ 21.44	\$ 20.50	\$ 19.92
S1	\$ 23.68	\$ 22.70	\$ 22.16
S1 EUR	N/A	N/A	€ 22.05
S1D	\$ 13.44	\$ 13.25	\$ 13.66
S1D2	\$ 75.89	\$ 75.41	\$ 79.07
SA	\$ 72.47	\$ 71.95	\$ 75.39
SHK	\$ 75.35	\$ 74.82	\$ 78.38

	American Income Portfolio (Fortsetzung)		
	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
W	\$ 11.55	\$ 11.48	\$ 12.03
W2	\$ 16.87	\$ 16.17	\$ 15.80
W2 CHF H	CHF 14.04	CHF 13.76	CHF 14.06
W2 EUR H	€ 14.65	€ 14.19	€ 14.29
WT	\$ 11.55	\$ 11.48	\$ 12.04
WT AUD H	AUD 11.01	AUD 10.98	AUD 11.62
WT EUR H	€ 11.46	€ 11.42	€ 12.06
WT GBP H	£ 11.29	£ 11.25	£ 11.88
WT HKD	HKD 90.61	HKD 90.15	HKD 94.52
WT SGD H	SGD 11.34	SGD 11.31	SGD 11.92
	European Income Portfolio		
	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen	€ 1,174,736,472	€ 1,121,772,376	€ 1,411,076,501
Klasse			
A	€ 5.87	€ 5.65	€ 5.76
A USD	\$ 6.28	\$ 6.08	\$ 5.77
A2	€ 20.80	€ 19.63	€ 19.23
A2 CHF H	CHF 15.46	CHF 14.78	CHF 14.70
A2 PLN H	PLN 115.35	PLN 107.74	PLN 100.08
A2 USD	\$ 22.48	\$ 21.29	\$ 19.33
A2 USD H	\$ 19.66	\$ 18.40	\$ 17.53
AA	€ 10.44	€ 10.11	€ 10.44
AA AUD H	AUD 10.16	AUD 9.85	AUD 10.21
AA HKD H	HKD 69.67	HKD 67.44	HKD 69.43
AA RMB H	CNH 69.45	CNH 67.29	CNH 69.66
AA SGD H	SGD 10.37	SGD 10.05	SGD 10.37
AA USD H	\$ 10.65	\$ 10.29	\$ 10.57
AK	€ 12.35	€ 11.89	€ 12.12
AR	€ 10.55	€ 9.96	€ 10.29
AT	€ 5.88	€ 5.65	€ 5.76
AT AUD H	AUD 12.48	AUD 12.02	AUD 12.29
AT SGD H	SGD 11.97	SGD 11.53	SGD 11.75
AT USD	\$ 6.28	\$ 6.08	\$ 5.77
AT USD H	\$ 13.01	\$ 12.50	\$ 12.67
B USD	\$ 6.31	\$ 6.10	\$ 5.78
B2	€ 17.52	€ 16.60	€ 16.37
B2 USD	\$ 18.94	\$ 17.99	\$ 16.45
BA AUD H	N/A	N/A	AUD 9.59
BA USD H	N/A	N/A	\$ 9.94
BT	N/A	N/A	€ 5.77
BT AUD H	N/A	N/A	AUD 12.34
BT USD H	N/A	N/A	\$ 12.67
C	€ 5.89	€ 5.66	€ 5.77
C USD	\$ 6.30	\$ 6.09	\$ 5.78
C2	€ 19.45	€ 18.40	€ 18.11
C2 USD	\$ 21.03	\$ 19.96	\$ 18.20
C2 USD H	\$ 18.55	\$ 17.40	\$ 16.65
CK	€ 12.37	€ 11.89	€ 12.12

European Income Portfolio (Fortsetzung)

	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
CT USD H	\$ 11.99	\$ 11.52	\$ 11.67
I	€ 5.86	€ 5.65	€ 5.76
I USD	\$ 6.25	\$ 6.06	\$ 5.77
I2	€ 14.13	€ 13.30	€ 12.96
I2 AUD H	AUD 30.89	AUD 29.06	AUD 28.05
I2 CHF H	CHF 15.97	CHF 15.23	CHF 15.06
I2 USD	\$ 15.28	\$ 14.43	\$ 13.03
I2 USD H	\$ 28.38	\$ 26.48	\$ 25.09
IA	€ 11.62	€ 11.22	€ 11.52
IA HKD H	HKD 78.18	HKD 75.47	HKD 77.21
IA SGD H (21)	N/A	SGD 11.23	SGD 11.52
IA USD H	\$ 11.83	\$ 11.40	\$ 11.72
IT	€ 12.41	€ 11.95	€ 12.19
IT SGD H (22)	N/A	SGD 11.98	SGD 12.21
IT USD H	\$ 12.33	\$ 11.85	\$ 12.02
NT USD H	\$ 12.60	\$ 12.10	\$ 12.27
S1	€ 23.27	€ 21.88	€ 21.27
S1 USD	\$ 25.16	\$ 23.73	\$ 21.38
S1 USD H	\$ 26.73	\$ 24.91	\$ 23.56
S1D	€ 12.25	€ 11.80	€ 12.05
SA USD H	\$ 81.64	\$ 78.43	\$ 79.48
SHK	€ 81.12	€ 78.01	€ 79.48
W2	€ 15.29	€ 14.38	€ 13.98
W2 CHF H	CHF 15.42	CHF 14.69	CHF 14.51
W2 USD H	\$ 16.59	\$ 15.47	\$ 14.63
WA	€ 12.32	€ 11.88	€ 12.18
WA HKD H (23)	N/A	HKD 79.83	HKD 81.55
WA USD H	\$ 12.53	\$ 12.06	\$ 12.29
WT	€ 12.63	€ 12.17	€ 12.42
WT SGD H (24)	N/A	SGD 12.22	SGD 12.47
WT USD H	\$ 12.84	\$ 12.34	\$ 12.53

Emerging Markets Debt Portfolio

	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen	\$ 484,566,836	\$ 482,266,459	\$ 502,511,882
Klasse			
A	\$ 10.81	\$ 10.41	\$ 10.53
A EUR	€ 10.16	€ 9.71	€ 10.53
A2	\$ 31.43	\$ 29.28	\$ 27.73
A2 CHF H	CHF 13.14	CHF 12.52	CHF 12.38
A2 EUR	€ 29.08	€ 27.00	€ 27.59
A2 EUR H	€ 18.25	€ 17.18	€ 16.78
A2 HKD	HKD 246.10	HKD 229.66	HKD 217.64
A2 PLN (25)	N/A	PLN 120.83	PLN 130.32
A2 PLN H	PLN 99.28	PLN 92.70	PLN 85.54
A2 SGD H	SGD 19.16	SGD 18.03	SGD 17.30
AA	\$ 8.74	\$ 8.48	\$ 8.70
AA AUD H	AUD 8.05	AUD 7.84	AUD 8.14
AA CAD H	CAD 7.99	CAD 7.77	CAD 8.01
AA EUR H	€ 8.07	€ 7.85	€ 8.12

	Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)		
	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
AA GBP H	£ 7.89	£ 7.68	£ 7.97
AA HKD	HKD 68.44	HKD 66.48	HKD 68.29
AA NZD H	NZD 7.86	NZD 7.64	NZD 7.93
AA RMB H (26)	N/A	CNH 58.79	CNH 61.00
AA SGD H (27)	N/A	SGD 8.19	SGD 8.45
AA ZAR H	R 55.62	R 54.00	R 55.89
AI	\$ 50.26	\$ 48.85	\$ 51.66
AI AUD H	AUD 48.98	AUD 47.79	AUD 51.10
AR EUR	€ 9.62	€ 8.94	€ 9.93
AT	\$ 10.85	\$ 10.44	\$ 10.57
AT AUD H	AUD 9.35	AUD 9.03	AUD 9.25
AT CAD H	CAD 8.67	CAD 8.36	CAD 8.51
AT EUR	€ 10.20	€ 9.75	€ 10.57
AT EUR H	€ 9.76	€ 9.43	€ 9.63
AT GBP H	£ 8.62	£ 8.33	£ 8.51
AT HKD	HKD 85.04	HKD 81.98	HKD 82.98
AT NZD H	NZD 8.38	NZD 8.09	NZD 8.28
AT SGD H	SGD 9.42	SGD 9.10	SGD 9.27
B2 HKD	N/A	N/A	HKD 184.66
BT	\$ 10.91	\$ 10.48	\$ 10.56
C	\$ 10.85	\$ 10.44	\$ 10.54
C EUR	€ 10.19	€ 9.74	€ 10.53
C2	\$ 28.97	\$ 27.05	\$ 25.73
C2 EUR	€ 26.80	€ 24.94	€ 25.60
C2 EUR H	€ 17.22	€ 16.25	€ 15.94
CT	\$ 9.22	\$ 8.87	\$ 8.95
EA	\$ 10.15	\$ 9.87	\$ 10.19
EA AUD H	AUD 9.59	AUD 9.36	AUD 9.77
EA ZAR H	R 65.58	R 63.86	R 66.43
EI	\$ 49.46	\$ 48.19	\$ 51.24
EI AUD H	AUD 48.15	AUD 47.10	AUD 50.69
I	\$ 10.77	\$ 10.38	\$ 10.52
I2	\$ 34.66	\$ 32.21	\$ 30.33
I2 AUD H	AUD 15.46	AUD 14.50	AUD 13.94
I2 CHF H	CHF 13.98	CHF 13.28	CHF 13.06
I2 EUR	€ 32.07	€ 29.70	€ 30.18
I2 EUR H	€ 19.77	€ 18.56	€ 18.03
IT AUD H	AUD 8.39	AUD 8.11	AUD 8.30
IT EUR H	€ 9.33	€ 9.01	€ 9.20
N2	\$ 16.00	\$ 14.95	\$ 14.24
NT	\$ 8.97	\$ 8.62	\$ 8.70
S	\$ 34.81	\$ 32.23	\$ 30.13
S1 2	\$ 32.28	\$ 29.97	\$ 28.18
S1 2 EUR (28)	N/A	€ 27.66	€ 28.06
S1 EUR H	€ 19.19	€ 18.00	€ 17.45
S1 GBP H	£ 20.93	£ 19.52	£ 18.67
S1L	\$ 104.88	\$ 100.49	N/A
SA	\$ 66.35	\$ 63.89	\$ 64.72

	Mortgage Income Portfolio		
	29. Februar 2024 (ungeprüft)	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 833,582,264	\$ 744,715,033	\$ 829,713,296
Klasse			
A.....	\$ 11.49	\$ 11.31	\$ 11.22
A2.....	\$ 20.48	\$ 19.37	\$ 17.83
A2 EUR.....	€ 18.95	€ 17.86	€ 17.74
A2 HKD.....	HKD 160.33	HKD 151.89	HKD 139.98
A2 SGD (29).....	N/A	SGD 26.21	SGD 24.94
A2X.....	\$ 14.70	\$ 13.89	\$ 12.78
A2X EUR.....	€ 13.60	€ 12.81	€ 12.71
AA.....	\$ 9.92	\$ 9.83	\$ 9.89
AA AUD H.....	AUD 9.51	AUD 9.44	AUD 9.53
AA HKD.....	HKD 77.69	HKD 77.14	HKD 77.67
AA RMB H.....	CNH 67.15	CNH 66.68	CNH 67.55
AA SGD H.....	SGD 9.76	SGD 9.70	SGD 9.78
AA ZAR H.....	R 66.41	R 65.83	R 66.17
AR EUR H.....	€ 10.00	€ 9.54	€ 9.70
AT.....	\$ 11.51	\$ 11.33	\$ 11.24
AT AUD H.....	AUD 11.08	AUD 10.92	AUD 10.87
AT EUR.....	€ 10.64	€ 10.44	€ 11.23
AT GBP H.....	£ 11.94	£ 11.77	£ 11.72
AT HKD.....	HKD 90.14	HKD 88.88	HKD 88.26
AT SGD (30).....	N/A	SGD 15.28	SGD 15.73
AT SGD H.....	SGD 11.31	SGD 11.16	SGD 11.09
AX.....	\$ 5.56	\$ 5.48	\$ 5.43
AX EUR.....	€ 5.14	€ 5.04	€ 5.43
BX.....	\$ 5.57	\$ 5.48	\$ 5.43
BX EUR.....	€ 5.14	€ 5.04	€ 5.42
C.....	\$ 11.51	\$ 11.33	\$ 11.23
C2.....	\$ 19.54	\$ 18.53	\$ 17.13
C2 EUR.....	€ 18.09	€ 17.09	€ 17.05
CX.....	\$ 5.57	\$ 5.48	\$ 5.43
I.....	\$ 11.49	\$ 11.31	\$ 11.22
I EUR.....	€ 10.62	€ 10.41	€ 11.20
I2.....	\$ 21.63	\$ 20.40	\$ 18.68
I2 EUR.....	€ 20.03	€ 18.83	€ 18.59
I2 EUR H.....	€ 16.12	€ 15.32	€ 14.40
IT EUR H.....	€ 12.07	€ 11.89	€ 11.83
IX.....	\$ 5.56	\$ 5.48	\$ 5.43
N2.....	\$ 16.99	\$ 16.11	\$ 14.91
NT.....	\$ 12.26	\$ 12.06	\$ 11.96
S.....	\$ 11.46	\$ 11.28	\$ 11.19
S1.....	\$ 20.20	\$ 19.04	\$ 17.40
S1 AUD H.....	AUD 115.94	AUD 109.99	N/A
S1 EUR (31).....	N/A	€ 17.57	€ 17.32
S1 EUR H.....	€ 105.73	€ 100.44	€ 94.16
S1 JPY (32).....	N/A	¥ 14,584.00	¥ 12,733.00
SIL.....	\$ 103.49	\$ 101.43	N/A
SA.....	\$ 75.03	\$ 73.90	\$ 73.40

- (1) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 19. September 2023. Siehe Anmerkung A.
- (2) Aufgelöst am 8. September 2023 mit einem abschließenden NAV von €18.74
- (3) Aufgelöst am 18. September 2023 mit einem abschließenden NAV von \$28.43
- (4) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von CNH78.89
- (5) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von AUD23.47
- (6) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von PLN383.99
- (7) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €37.67
- (8) Aufgelöst am 15. Dezember 2023 mit einem abschließenden NAV von \$61.65
- (9) Auflegungsdatum 16. Oktober 2023
- (10) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €12.94
- (11) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €6.51
- (12) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €12.25
- (13) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von \$10.03
- (14) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €9.77
- (15) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €26.22
- (16) Aufgelöst am 26. Februar 2023 mit einem abschließenden NAV von \$21.79
- (17) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD23.51
- (18) Auflegungsdatum 19. Oktober 2023
- (19) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von \$14.42
- (20) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von \$11.41
- (21) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD11.29
- (22) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD12.05
- (23) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von HKD80.37
- (24) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD12.30
- (25) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von PLN118.18
- (26) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von CHN58.34
- (27) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD8.11
- (28) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €27.72
- (29) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD26.34
- (30) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD15.15
- (31) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €17.75
- (32) Aufgelöst am 8. November 2023 mit einem abschließenden NAV von ¥15,264.00

ANMERKUNG A: Allgemeine Informationen

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

Der Fonds besteht aus getrennten Anlagevermögen mit derzeit 11 aktiven Portefeuilles (einzeln das „Portefeuille“ und zusammengekommen die „Portefeuilles“). Jede Anteilklasse stellt eine Beteiligung an den Anlagewertpapieren sowie anderen Nettovermögenswerten des entsprechenden Portefeuilles dar. Alle Anteile einer Klasse haben dieselben Rechte in Bezug auf Ausschüttungen und Rücknahmen.

Das Portfolio AB FCPI – Dynamic Diversified Portfolio wurde aufgelöst. Der letzte offizielle Nettoinventarwert („NIW“) wurde am 19. September 2023 berechnet. Zum 29. Februar 2024 belief sich der Barsaldo für das Portfolio auf 3.089 USD.

Die folgende Tabelle zeigt den Beginn der Geschäftstätigkeit der einzelnen Portfolios sowie die zum 29. Februar 2024 angebotenen Anteilklassen:

AB FCPI–	Geschäftsaufnahme	Angebote Anteilklassen
Global Equity Blend Portfolio	29. August 2003	A, A EUR, A EUR H, A SGD, B, B SGD, C, C EUR, I, I EUR, S HKD, S1, S1 EUR, S1 GBP & S1 SGD
Emerging Markets Growth Portfolio	29. Oktober 1992	A, A AUD H, A EUR, A HKD, A PLN H, A SGD, A SGD H, AD, B, C, C EUR, ED, I, I AUD H, I EUR, N, S1, S1 EUR & S1 GBP
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	27. November 2009	A, A AUD H, A EUR, A HKD, A SGD H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR, AD EUR H, AD GBP H, AD HKD, AD NZD H, AD ZAR H, AY JPY, BY JPY, C, C EUR, ED, ED AUD H, I, I EUR, I GBP, S, S HKD, S1, S1 EUR & SD
Japan Strategic Value Portfolio	14. Dezember 2005	A, A CZK H, A EUR, A EUR H, A SGD, A SGD H, A USD, A USD H, AD, AD AUD H, AD NZD H, AD USD H, AD ZAR H, C, C EUR, C EUR H, C USD, I, I EUR, I EUR H, I USD, I USD H, S1 EUR, S1 USD & SD
China Low Volatility Equity Portfolio	31. Januar 2007	A, A EUR, A HKD, A PLN H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR H, AD GBP H, AD HKD, AD NZD H, AD SGD H, AD ZAR H, B, B EUR, C, C EUR, I, I EUR, S1 & S1 EUR
Short Duration Bond Portfolio	13. September 1996	A, A EUR, A2, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA GBP H, AA HKD, AA SGD H, AJ, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT SGD H, AX, C, C2, I, I2, I2 EUR H, IT, N2, NT, S, S1, S1 2, S1 2 EUR, S1 EUR H & SA

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
Global High Yield Portfolio	19. September 1997	A, A EUR, A2, A2 CHF H, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, A2 PLN H, A2 SGD, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA EUR H, AA GBP H, AA HKD, AA NZD H, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AK, AK EUR, AK EUR H, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT RMB H, AT SGD, AT SGD H, B, B2, BT, BT AUD H, C, C EUR, C2, C2 EUR, C2 EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, I, I EUR, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 EUR, I2 EUR H, I2 SGD, I2 SGD H, IA AUD H, IQD, IT, IT AUD H, IT CAD H, IT EUR H, IT GBP H, IT HKD, IT RMB H, J, N2, NT, S1, S1 EUR H, S1D, S1D2, S1L GBP H, SA, SHK, SK, W, W EUR, W2, W2 CHF H, W2 EUR H, WT, WT AUD H, WT CAD H, WT EUR H, WT GBP H & WT RMB H
American Income Portfolio	30. Juni 1993	A, A EUR, A2, A2 CHF H, A2 DUR PH, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, A2 PLN H, A2 SGD, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA DUR PH, AA EUR H, AA GBP H, AA HKD, AA NZD H, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AK, AK EUR, AK EUR H, AR EUR, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT DUR PH, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT RMB H, AT SGD, AT SGD H, B, B2, BT, C, C EUR, C2, C2 EUR, C2 EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, I, I EUR, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 EUR, I2 EUR H, I2 HKD, I2 SGD H, IA, IA AUD H, IT, IT AUD H, IT CAD H, IT EUR H, IT GBP H, IT HKD, IT JPY, IT JPY H, IT NZD H, IT RMB H, IT SGD, IT SGD H, J, N2, NT, S, S1, S1D, S1D2, SA, SHK, W, W2, W2 CHF H, W2 EUR H, WT, WT AUD H, WT EUR H, WT GBP H, WT HKD & WT SGD H
European Income Portfolio	25. Februar 1999	A, A USD, A2, A2 CHF H, A2 PLN H, A2 USD, A2 USD H, AA, AA AUD H, AA HKD H, AA RMB H, AA SGD H, AA USD H, AK, AR, AT, AT AUD H, AT SGD H, AT USD, AT USD H, B USD, B2, B2 USD, C, C USD, C2, C2 USD, C2 USD H, CK, CT USD H, I, I USD, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 USD, I2 USD H, IA, IA HKD H, IA USD H, IT, IT USD H, NT USD H, S1, S1 USD, S1 USD H, S1D, SA USD H, SHK, W2, W2 CHF H, W2 USD H, WA, WA USD H, WT & WT USD H

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
Emerging Markets Debt Portfolio	22. März 2006	A, A EUR, A2, A2 CHF H, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, A2 PLN H, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA EUR H, AA GBP H, AA HKD, AA NZD H, AA ZAR H, AI, AI AUD H, AR EUR, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT SGD H, BT, C, C EUR, C2, C2 EUR, C2 EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, EI, EI AUD H, I, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 EUR, I2 EUR H, IT AUD H, IT EUR H, N2, NT, S, S1 2, S1 EUR H, S1 GBP H, S1L & SA
Mortgage Income Portfolio	26. September 1994	A, A2, A2 EUR, A2 HKD, A2X, A2X EUR, AA, AA AUD H, AA HKD, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT EUR, AT GBP H, AT HKD, AT SGD H, AX, AX EUR, BX, BX EUR, C, C2, C2 EUR, CX, I, I EUR, I2, I2 EUR, I2 EUR H, IT EUR H, IX, N2, NT, S, S1, S1 AUD H, S1 EUR H, S1L & SA

ANMERKUNG B: Relevante Bilanzierungsgrundsätze

Der Jahresabschluss wurde im Einklang mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und behördlichen Vorschriften und nach dem Fortführungsprinzip erstellt. Es folgt eine Zusammenfassung der relevanten Bilanzierungsgrundsätze der Portefeuilles.

1. Bewertung

1.1 Anlagen in Wertpapiere

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

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

Wertpapiere werden zu ihrem aktuellen Marktwert auf Basis der Marktnotierungen oder, wenn keine Marktnotierungen verfügbar sind oder diese als unzuverlässig gelten, zum „angemessenen Marktwert“ entsprechend den Verfahren bewertet, die vom und unter der allgemeinen Aufsicht des Verwaltungsrats festgelegt werden. Angemessene Bewertungsverfahren sollen die Schlusskurse der Wertpapiere des Portefeuilles so berichtigen, dass sie den zum Bewertungszeitpunkt des Portefeuilles als angemessen erachteten Wert jener Wertpapiere widerspiegeln.

Wenn hinsichtlich eines bestimmten Portefeuille-Wertpapiers Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts eingesetzt werden, können eine Reihe objektiver und subjektiver Faktoren berücksichtigt werden, darunter z. B. Entwicklungen seit der letzten Kursnotierung des Wertpapiers, die sich auf das

Wertpapier bzw. auf einen gesamten Markt auswirken, aktuelle Bewertungen entsprechender Aktienindizes oder Äußerungen bestimmter Regierungsbehörden. Soweit verfügbar, können die angemessenen Werte verwendet werden, die von den Bewertungsmodellen dritter Händler ermittelt werden. Wenn Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts eingesetzt werden, können die Kurse einzelner Portefeuille-Wertpapiere, die zur Berechnung des Nettoinventarwerts („NAV“) des Portefeuilles verwendet werden, daher von den notierten oder veröffentlichten Kursen derselben Wertpapiere abweichen. Derzeit werden Marktwertanpassungen nur bei bestimmten Aktienwerten und Terminkontrakten vorgenommen.

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

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

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

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

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

1.2 Bewertung von Optionsscheinen

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

1.3 Finanzterminkontrakte

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

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

1.4 Devisentermingeschäfte

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

1.5 Gekaufte und verkaufte Optionen

Wenn eine Option gekauft wird, wird ein dem bezahlten Preis entsprechender Betrag als Anlage verbucht und im Folgenden dem aktuellen Marktwert der gekauften Option angepasst. Der Preis, der für den Kauf von Optionen bezahlt wurde, die verfallen, ohne ausgeübt zu werden, wird am Verfallsdatum als realisierter Verlust verbucht. Wenn eine gekaufte Verkaufsoption ausgeübt wird, wird der Optionspreis vom Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung abgezogen, um festzustellen, ob das jeweilige Portefeuille einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wenn eine gekaufte Kaufoption ausgeübt wird, erhöht der Optionspreis die Kostenbasis des Wertpapiers oder der vom jeweiligen Portefeuille gekauften Fremdwährung. Wenn eine Option verkauft wird, wird ein dem erhaltenen Preis entsprechender Betrag als Verbindlichkeit verbucht und im Folgenden dem aktuellen Marktwert der verkauften Option angepasst. Der Preis, der für verkaufte Optionen erhalten wird, die verfallen, ohne ausgeübt zu werden, wird vom jeweiligen Portefeuille am Verfallsdatum als realisierter Gewinn verbucht. Wenn eine verkaufte Kaufoption ausgeübt wird, wird der Preis zum Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung hinzuaddiert, um festzustellen, ob das jeweilige Portefeuille einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wenn eine verkaufte Verkaufsoption ausgeübt wird, senkt der Optionspreis die Kostenbasis des vom jeweiligen Portefeuille gekauften Wertpapiers oder der Fremdwährung. Börsennotierte Kauf- und Verkaufsoptionen eines Portefeuilles werden zum letzten Verkaufspreis bewertet. Falls an dem Tag kein Verkauf stattgefunden hat, werden die Wertpapiere zum letzten Rücknahmepreis an dem Tag bewertet.

1.6 Anlagen in anderen Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“)

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

1.7 Swap-Vereinbarungen

Für Zwischenzahlungen auf Swap-Kontrakte nehmen die Portefeuilles täglich Rückstellungen innerhalb der Erträge und Aufwendungen vor. Swap-Kontrakte werden täglich zum letzten Börsenkurs bewertet, wobei Wertschwankungen in der Zusammensetzung des Fondsvermögens als „Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung) aus Swaps“ und in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens als „Änderung der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps“ ausgewiesen werden. Bei Fälligkeit oder Verkauf eines Swap-Kontrakts wird der Nettobetrag in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens

unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ ausgewiesen. Die bezahlten oder erhaltenen Vorabgebühren werden in der Zusammensetzung des Fondsvermögens als Kosten oder Erlöse ausgewiesen und über die Laufzeit des Kontrakts linear abgeschrieben. Aufgelaufene, abgeschriebene Vorabgebühren für Credit-Default-Swaps sind solange im „Swap-Ertrag“ enthalten, bis die Position verkauft wird, danach werden die abgeschriebenen Vorabgebühren unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ verbucht. Bei allen anderen Swap-Arten werden die abgeschriebenen Vorabgebühren unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ ausgewiesen. Schwankungen des Werts von Swap-Kontrakten werden als eine Komponente der Änderungen der nicht realisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesen.

In der Zusammensetzung des Fondsvermögens ausgewiesene „Für Swap-Kontrakte bezahlte (erhaltene) Vorabgebühren“ enthalten im Freiverkehr für Credit-Default-Swaps bezahlte (erhaltene) Gebühren sowie eine Marge, die noch für die zentral abgerechneten Credit-Default-Swaps beglichen werden muss.

2. Gründungskosten

Die Gründungskosten aller bestehenden Portefeuilles wurden in früheren Jahren vollständig abgeschrieben.

3. Zuteilungsmethode

Die Erträge und Aufwendungen (mit Ausnahme der klassenspezifischen Verwaltungs- und Vertriebsgebühren) der „Renten“- und „Misch“-Portefeuilles werden täglich auf Basis einer „gemischten Zuteilungs-Rechnung“ zugewiesen. Diese Zuteilungs-Rechnung basiert auf dem prozentualen Verhältnis zwischen dem Wert der abgerechneten Anteile einer Anteilklasse mit täglicher Feststellung einer Ausschüttung und dem Wert der umlaufenden Anteile, die entweder auf monatlicher Basis Ausschüttungen ausbezahlen oder keine Ausschüttungen tätigen. Erträge und Aufwendungen der „Aktien“-Portefeuilles des Fonds werden täglich auf Basis ihres prozentualen Verhältnisses nach dem Wert ihrer umlaufenden Anteile zugewiesen. Für alle Portefeuilles werden die realisierten und unrealisierten Gewinne und Verluste des Fonds täglich auf Basis ihres prozentualen Verhältnisses nach dem Wert ihrer umlaufenden Anteile zugewiesen. Klassenspezifische Verwaltungs-, Verwaltungsgesellschafts- und Vertriebsgebühren sowie unrealisierte Gewinne und Verluste aus Devisentermingeschäften, die sich auf die währungsabgesicherten Anteilklassen beziehen, werden der jeweiligen Anteilklasse direkt berechnet/zugewiesen.

Aufgrund des stark institutionellen Charakters aller Arten von Anteilen der Klasse S der Portefeuilles werden bestimmte Kosten des Fonds auf Grundlage der minimalen Aktivität der Anteilinhaber und Anforderungen des Kontostandes ggf. den entsprechenden Anteilen der Klasse S zugewiesen.

4. Währungsumrechnung

Werte, die in einer anderen Währung ausgedrückt sind als der Währung, in der das Portefeuille laut Vertragsbedingungen denominiert ist, werden unter Anwendung des Mittelwerts zwischen dem letzten erhältlichen Kauf- und Verkaufspreis umgerechnet. Transaktionen in Fremdwährungen werden zu dem am Transaktionsdatum geltenden Wechselkurs in die

Währung des jeweiligen Portefeuilles umgerechnet.

Die kombinierte Zusammensetzung des Fondsvermögens wird in US-Dollar zu den am Datum der kombinierten Zusammensetzung des Fondsvermögens geltenden Wechselkursen dargestellt, während die kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens in US-Dollar zu den durchschnittlichen, während des Berichtszeitraums geltenden Wechselkursen dargestellt wird.

Dem Halbjahresabschluss (Jahresabschluss) wurden folgende Kurse zugrunde gelegt: Kassakurs von 1.0808 und Mittelkurs von 1.0779 für die Umrechnung von EUR in USD, Kassakurs von 0.0067 und Mittelkurs von 0.0068 für die Umrechnung von JPY in USD.

Die in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesene „Anpassung aus Währungsumrechnung“ ergibt sich aus den unterschiedlichen Wechselkursen, die zur Umrechnung des kombinierten Nettovermögens zu Beginn des Jahres, der kombinierten Zusammensetzung des Fondsvermögens und der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens verwendet wurden.

5. Anlageerträge und Anlagetransaktionen

Dividendenerträge werden am Tag der Notierung ex Dividende verbucht. Zinserträge werden tagesgenau verbucht. Die Anlagegewinne und -verluste für die Portefeuilles werden anhand der durchschnittlichen Kostenbasis festgestellt. Der Fonds verbucht Disagios und amortisiert Prämien als Wertberichtigungen der Zinserträge. Anlagegeschäfte werden am Transaktionsstag zuzüglich eines Tages verbucht.

6. Schätzungen

Bei der Erstellung des Abschlusses im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen muss die Fondsverwaltung Schätzungen und Annahmen erstellen, die sich auf den Betrag der berichteten Aktiva und Passiva und die Offenlegung der Eventualaktiva und -passiva zum Zeitpunkt des Halbjahresabschlusses sowie die berichteten Einnahmen und Auslagen während des Berichtszeitraums auswirken. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen.

7. Swing Pricing-Anpassung

(Die folgenden Ausführungen gelten für alle Portefeuilles, mit Ausnahme des Global Equity Blend Portfolio und Short Duration Bond Portfolio)

Der Fonds hat mit Wirkung zum 2. November 2015 eine NIW-Anpassungsrichtlinie eingeführt, die auch als „Swing Pricing“ bezeichnet wird. Gemäß dieser Richtlinie kann der NAV eines Portefeuilles angepasst werden, um die Auswirkungen der geschätzten Transaktionskosten, Preisabschläge und Gebühren, die durch die Kauf- und Rücknahmeaktivitäten der Anteilinhaber entstehen, widerzuspiegeln. Swing Pricing kommt automatisch zur Anwendung, wenn die täglichen Nettozeichnungen oder -rücknahmen einen Schwellenwert überschreiten, der vom Swing-Pricing-Komitee unter Aufsicht des Verwaltungsrats festgelegt wurde.

Wenn Swing Pricing zur Anwendung kommt, wird der NAV der Anteile des jeweiligen Portefeuilles um einen Betrag nach oben oder unten korrigiert, der im Allgemeinen höchstens 2% des jeweiligen NAV entspricht, so dass die Transaktionskosten, die

aufgrund der Kauf- und Rücknahmeaktivität entstehen, nicht vom Portefeuille selbst, sondern von den Anlegern getragen werden, die mit den Portefeuilleanteilen handeln. Diese Anpassung soll die Verwässerung des Werts der Anteilinhaber-Investitionen in Anteile eines Portefeuilles, die durch Transaktionen mit Portefeuilleanteilen hervorgerufen wird, minimieren.

Der in den statistischen Angaben offengelegte NAV je Anteil und das Gesamtnettovermögen sind der veröffentlichte NAV je Anteil und das Gesamtnettovermögen, wohingegen das in der Zusammensetzung des Fondsvermögens sowie in der Ertrags-

und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesene Gesamtnettovermögen der Gesamt-NAV ohne Swing-Anpassungen zum Ende eines Berichtszeitraums ist.

Alle Portefeuilles, die dem „Swing Pricing“ unterliegen, mit Ausnahme des Dynamic Diversified Portfolio haben im Berichtszeitraum den Swing-Pricing-Mechanismus auf den jeweiligen NAV angewandt, und zum 29. Februar 2024, hat das folgende Portefeuille den Swing-Pricing-Mechanismus auf den NAV angewandt:

ANMERKUNG C: Steuern

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

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

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

ANMERKUNG D: Ausschüttungen

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

Für das Dynamic Diversified Portfolio (bis zum Liquidationsdatum):

- Für Anteile der Klasse Class AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Ausschüttungen können aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.
- Für Anteile der Klassen A, C, I, S, S1, SP, S1P, AX, BX, CX und IX (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das Emerging Markets Growth Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, N, S, S1 und W (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD und ED (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je

Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Asia Ex-Japan Equity Portfolio:

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

Für das Japan Strategic Value Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, C, I, S, S1 und 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle

Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widerspiegelt.

- Für Anteile der Klassen AD und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das China Low Volatility Equity Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S und S1 beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen NAV widerspiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Short Duration Bond Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, AX, C, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H, sofern nicht anders angegeben) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AJ, AT, CT, IT und NT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den

Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klassen A2, C2, I2, N2, S2 und S1 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) und Klassen S EUR H, S1 EUR H, S SGD H beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widerspiegelt.

Für das Global High Yield Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, JA, J und W (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT, S1D, S1D2 und WT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen IQD und S1QD beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind. Für Anteile der Klasse SK kann die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem Ermessen Dividenden erklären und ausschütten.
- Für Anteile der Klassen AK und (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, EA, IA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse SHK beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und monatlich vorzunehmen. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse

zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klassen class S1L (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, eine monatlich Dividende auszuschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entspricht, die dieser Anteilklasse zuzurechnen sind. Diese Dividenden werden nicht aus dem der Anteilklasse zuzurechnenden Kapital gezahlt.
- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, E2, I2, N2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das American Income Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, JA, J und W (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, LT, NT, S1D, S1D2, WT und ZT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AK und CK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, EA, IA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse SHK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und monatlich vorzunehmen. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die

Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klasse S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, E2, I2, L2, N2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das European Income Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C und I beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, CT, IT, NT, S1D und WT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AK und CK beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, IA, SA und WA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse SHK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und monatlich vorzunehmen. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, E2, I2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widerspiegelt.

Für das Emerging Markets Debt Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, C und I (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT und ZT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, EA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen AI und EI (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und möglicherweise in erheblichem Umfang aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren. Falls der Nettoinventarwert je Anteil unter 1 USD bzw. 1 AUD fällt, wird die Verwaltungsgesellschaft in ihrem alleinigen Ermessen erwägen, entweder (i) die Anteilklasse umzustrukturieren, auch durch die Zusammenlegung mit einer Anteilklasse mit ähnlichen Merkmalen, oder (ii) die Anteilklasse zu liquidieren. Dividenden können auf Wunsch der Anteilinhaber automatisch wiederangelegt werden.

- Für Anteile der Klassen class S1L beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, eine monatlich Dividende auszuschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entspricht, die dieser Anteilklasse zuzurechnen sind. Diese Dividenden werden nicht aus dem der Anteilklasse zuzurechnenden Kapital gezahlt.

- Für Anteile der Klassen A2, C2, E2, I2, N2, S, S1 und S1 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widerspiegelt.

- Für Anteile der Klassen S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.

Für das Mortgage Income Portfolio:

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

- Für Anteile der Klassen AT, ATX, IT, NT und ZT beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.

- Für Anteile der Klassen AA, EA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klassen S1L beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, eine monatlich Dividende auszuschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entspricht, die dieser Anteilklasse zuzurechnen sind. Diese Dividenden werden nicht aus dem der Anteilklasse zuzurechnenden Kapital gezahlt.

- Für Anteile der Klassen A2, A2X, C2, C2X, E2, I2, I2X, N2, S1 und S2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht,

Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt. Die Verwaltungsgesellschaft kann außerdem festlegen, ob und in welchem Maße die bezahlten Dividenden realisierte Kapitalgewinne beinhalten und/oder aus dem Kapital bezahlt werden, das der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen ist.

Soweit die Nettoerträge und die realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuweisen sind, den auszuschüttenden Betrag übersteigen, wird die überschüssige Rendite im jeweiligen Nettoinventarwert dieser Anteile widergespiegelt.

Dividenden können auf Wunsch der Anteilinhaber automatisch wiederangelegt werden.

ANMERKUNG E: Verwaltungsgebühren und andere Transaktionen mit verbundenen Unternehmen

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

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

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

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Dynamic Diversified		
Portfolio(a)	Klasse A	1.95%
	Klasse A EUR	1.95%
	Klasse A EUR H	1.95%
	Klasse AX	1.90%
	Klasse AX EUR	1.90%
	Klasse AX SGD	1.90%
	Klasse BX	2.90%
	Klasse C	2.25%
	Klasse C EUR	2.25%
	Klasse C EUR H	2.25%
	Klasse CX	2.20%
	Klasse I	1.25%
	Klasse I EUR	1.25%
	Klasse I EUR H(b)	1.25%
	Klasse IX(c)	1.20%
Global Equity Blend		
Portfolio	Klasse A	2.10%
	Klasse A EUR	2.10%
	Klasse A EUR H	2.10%
	Klasse A SGD	2.10%
	Klasse B	3.10%
	Klasse B SGD	3.10%
	Klasse C	2.55%
	Klasse C EUR	2.55%
	Klasse I	1.30%
	Klasse I EUR	1.30%
	Klasse S HKD	0.10%
	Klasse S1	0.80%
	Klasse S1 EUR	0.80%
	Klasse S1 GBP	0.80%
	Klasse S1 SGD	0.80%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Emerging Markets Growth		
Portfolio	Klasse S1	1.20%
	Klasse S1 EUR	1.20%
	Klasse S1 GBP	1.20%
Asia Ex-Japan Equity		
Portfolio	Klasse A	2.05%
	Klasse A AUD H	2.05%
	Klasse A EUR	2.05%
	Klasse A HKD	2.05%
	Klasse A SGD H	2.05%
	Klasse AD	2.05%
	Klasse AD AUD H	2.05%
	Klasse AD CAD H	2.05%
	Klasse AD EUR	2.05%
	Klasse AD EUR H	2.05%
	Klasse AD GBP H	2.05%
	Klasse AD HKD	2.05%
	Klasse AD NZD H	2.05%
	Klasse AD RMB H(d)	2.05%
	Klasse AD ZAR H	2.05%
	Klasse AY JPY	2.05%
	Klasse BY JPY	2.52%
	Klasse C	2.50%
	Klasse C EUR	2.50%
	Klasse ED	3.05%
	Klasse ED AUD H	3.05%
	Klasse I	1.25%
	Klasse I AUD H(d)	1.25%
	Klasse I EUR	1.25%
	Klasse I GBP	1.25%
	Klasse S	0.30%
	Klasse S HKD	0.30%
	Klasse S1	1.20%
	Klasse S1 EUR	1.20%
	Klasse SD	0.30%
Japan Strategic Value		
Portfolio	Klasse A	1.70%
	Klasse A CZK H	1.70%
	Klasse A EUR	1.70%
	Klasse A EUR H	1.70%
	Klasse A PLN(d)	1.70%
	Klasse A SGD	1.70%
	Klasse A SGD H	1.70%
	Klasse A USD	1.70%
	Klasse A USD H	1.70%
	Klasse AD	1.70%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Japan Strategic Value			Short Duration Bond		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse AD AUD H	1.70%	Portfolio (Fortsetzung)	Klasse AA SGD H	1.20%
	Klasse AD NZD H	1.70%		Klasse AJ	1.00%
	Klasse AD USD H	1.70%		Klasse AT	1.20%
	Klasse AD ZAR H	1.70%		Klasse AT AUD H	1.20%
	Klasse C	2.60%		Klasse AT CAD H	1.20%
	Klasse C EUR	2.60%		Klasse AT EUR	1.20%
	Klasse C EUR H	2.60%		Klasse AT EUR H	1.20%
	Klasse C USD	2.60%		Klasse AT GBP H	1.20%
	Klasse I	0.90%		Klasse AT HKD	1.20%
	Klasse I EUR	0.90%		Klasse AT NZD H	1.20%
	Klasse I EUR H	0.90%		Klasse AT SGD H	1.20%
	Klasse I USD	0.90%		Klasse AX	1.00%
	Klasse I USD H	0.90%		Klasse C	1.60%
	Klasse S EUR H(d)	0.15%		Klasse C2	1.60%
	Klasse S1 EUR	0.80%		Klasse C2 EUR H(d)	1.60%
	Klasse S1 USD	0.80%		Klasse I	0.575%
	Klasse SD	0.15%		Klasse I EUR(d)	0.575%
China Low Volatility Equity				Klasse I2	0.575%
Portfolio	Klasse A	1.99%		Klasse I2 EUR(d)	0.575%
	Klasse A EUR	1.99%		Klasse I2 EUR H	0.575%
	Klasse A HKD	1.99%		Klasse IT	0.575%
	Klasse A PLN H	1.99%		Klasse N2	1.70%
	Klasse AD	1.99%		Klasse NT	1.70%
	Klasse AD AUD H	1.99%		Klasse S	0.10%
	Klasse AD CAD H	1.99%		Klasse S1	0.35%
	Klasse AD EUR H	1.99%		Klasse S1 2	0.35%
	Klasse AD GBP H	1.99%		Klasse S1 2 EUR	0.35%
	Klasse AD HKD	1.99%		Klasse S1 EUR H	0.35%
	Klasse AD NZD H	1.99%		Klasse SA	0.10%
	Klasse AD SGD H	1.99%			
	Klasse AD ZAR H	1.99%	Global High Yield Portfolio	Klasse S1	1.00%
	Klasse B	2.99%		Klasse S1 EUR(d)	1.00%
	Klasse B EUR	2.99%		Klasse S1 EUR H	1.00%
	Klasse C	2.44%		Klasse S1D	1.00%
	Klasse C EUR	2.44%		Klasse S1D2	1.00%
	Klasse I	1.19%		Klasse S1L GBP H	1.00%
	Klasse I EUR	1.19%		Klasse SA	0.10%
	Klasse S(e)	0.16%		Klasse SHK	0.10%
	Klasse S1	0.91%		Klasse SK	0.75%
	Klasse S1 EUR	0.91%			
Short Duration Bond			American Income Portfolio	Klasse A	1.50%
Portfolio	Klasse A	1.20%		Klasse A EUR	1.50%
	Klasse A EUR	1.20%		Klasse A2	1.50%
	Klasse A2	1.20%		Klasse A2 CHF H	1.50%
	Klasse A2 EUR	1.20%		Klasse A2 DUR PH	1.50%
	Klasse A2 EUR H	1.20%		Klasse A2 EUR	1.50%
	Klasse A2 HKD	1.20%		Klasse A2 EUR H	1.50%
	Klasse A2 SGD H	1.20%		Klasse A2 HKD	1.50%
	Klasse AA	1.20%		Klasse A2 PLN H	1.50%
	Klasse AA AUD H	1.20%		Klasse A2 SGD	1.50%
	Klasse AA CAD H	1.20%		Klasse A2 SGD H	1.50%
	Klasse AA GBP H	1.20%		Klasse AA	1.50%
	Klasse AA HKD	1.20%		Klasse AA AUD H	1.50%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
American Income Portfolio			American Income Portfolio		
(Fortsetzung)	Klasse AA CAD H	1.50%	(Fortsetzung)	Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse AA DUR PH	1.50%		Klasse IT GBP H	0.95%
	Klasse AA EUR H	1.50%		Klasse IT HKD	0.95%
	Klasse AA GBP H	1.50%		Klasse IT JPY	0.95%
	Klasse AA HKD	1.50%		Klasse IT JPY H	0.95%
	Klasse AA NZD H	1.50%		Klasse IT NZD H	0.95%
	Klasse AA RMB H	1.50%		Klasse IT RMB H	0.95%
	Klasse AA SGD H	1.50%		Klasse IT SGD	0.95%
	Klasse AA ZAR H	1.50%		Klasse IT SGD H	0.95%
	Klasse AK	1.50%		Klasse L2(d)	1.05%
	Klasse AK EUR	1.50%		Klasse LT(d)	1.05%
	Klasse AK EUR H	1.50%		Klasse N2	2.05%
	Klasse AR EUR	1.50%		Klasse NT	2.05%
	Klasse AR EUR H	1.50%		Klasse S	0.15%
	Klasse AT	1.50%		Klasse S1	0.65%
	Klasse AT AUD H	1.50%		Klasse S1D	0.65%
	Klasse AT CAD H	1.50%		Klasse S1D2	0.65%
	Klasse AT DUR PH	1.50%		Klasse SA	0.15%
	Klasse AT EUR	1.50%		Klasse SHK	0.15%
	Klasse AT EUR H	1.50%		Klasse W	0.95%
	Klasse AT GBP H	1.50%		Klasse W2	0.95%
	Klasse AT HKD	1.50%		Klasse W2 CHF H	0.95%
	Klasse AT NZD H	1.50%		Klasse W2 EUR H	0.95%
	Klasse AT RMB H	1.50%		Klasse WT	0.95%
	Klasse AT SGD	1.50%		Klasse WT AUD H	0.95%
	Klasse AT SGD H	1.50%		Klasse WT EUR H	0.95%
	Klasse B	2.20%		Klasse WT GBP H	0.95%
	Klasse B2	2.20%		Klasse WT HKD	0.95%
	Klasse BT	2.20%		Klasse WT SGD H	0.95%
	Klasse C	1.95%			
	Klasse C EUR	1.95%	European Income Portfolio	Klasse A	1.41%
	Klasse C2	1.95%		Klasse A USD	1.41%
	Klasse C2 EUR	1.95%		Klasse A2	1.41%
	Klasse C2 EUR H	1.95%		Klasse A2 CHF H	1.41%
	Klasse CT	1.95%		Klasse A2 PLN H	1.41%
	Klasse EA	2.00%		Klasse A2 USD	1.41%
	Klasse EA AUD H	2.00%		Klasse A2 USD H	1.41%
	Klasse EA ZAR H	2.00%		Klasse AA	1.41%
	Klasse I	0.95%		Klasse AA AUD H	1.41%
	Klasse I EUR	0.95%		Klasse AA HKD H	1.41%
	Klasse I2	0.95%		Klasse AA RMB H	1.41%
	Klasse I2 AUD H	0.95%		Klasse AA SGD H	1.41%
	Klasse I2 CHF H	0.95%		Klasse AA USD H	1.41%
	Klasse I2 DUR PH(f)	0.95%		Klasse AK	1.41%
	Klasse I2 EUR	0.95%		Klasse AR	1.41%
	Klasse I2 EUR H	0.95%		Klasse AT	1.41%
	Klasse I2 HKD	0.95%		Klasse AT AUD H	1.41%
	Klasse I2 SGD(d)	0.95%		Klasse AT SGD H	1.41%
	Klasse I2 SGD H	0.95%		Klasse AT USD	1.41%
	Klasse IA	0.95%		Klasse AT USD H	1.41%
	Klasse IA AUD H	0.95%		Klasse B USD	2.11%
	Klasse IT	0.95%		Klasse B2	2.11%
	Klasse IT AUD H	0.95%		Klasse B2 USD	2.11%
	Klasse IT CAD H	0.95%		Klasse C	1.86%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
European Income Portfolio			Emerging Markets Debt		
(Fortsetzung)	Klasse C USD	1.86%	Portfolio (Fortsetzung)	Klasse AA RMB H(d)	1.50%
	Klasse C2	1.86%		Klasse AA SGD H(d)	1.50%
	Klasse C2 USD	1.86%		Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse C2 USD H	1.86%		Klasse AI	1.50%
	Klasse CK	1.86%		Klasse AI AUD H	1.50%
	Klasse CT USD H	1.86%		Klasse AR EUR	1.50%
	Klasse I	0.86%		Klasse AT	1.50%
	Klasse I USD	0.86%		Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse I2	0.86%		Klasse AT CAD H	1.50%
	Klasse I2 AUD H	0.86%		Klasse AT EUR	1.50%
	Klasse I2 CHF H	0.86%		Klasse AT EUR H	1.50%
	Klasse I2 USD	0.86%		Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse I2 USD H	0.86%		Klasse AT HKD	1.50%
	Klasse IA	0.86%		Klasse C EUR	1.95%
	Klasse IA HKD H	0.86%		Klasse AT NZD H	1.50%
	Klasse IA SGD H(d)	0.86%		Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse IA USD H	0.86%		Klasse BT	2.50%
	Klasse IT	0.86%		Klasse C	1.95%
	Klasse IT SGD H(d)	0.86%		Klasse C2	1.95%
	Klasse IT USD H	0.86%		Klasse C2 EUR	1.95%
	Klasse NT USD H	1.96%		Klasse C2 EUR H	1.95%
	Klasse S1	0.65%		Klasse CT	1.95%
	Klasse S1 USD	0.65%		Klasse EA	2.00%
	Klasse S1 USD H	0.65%		Klasse EA AUD H	2.00%
	Klasse S1D	0.65%		Klasse EA ZAR H	2.00%
	Klasse SA USD H	0.15%		Klasse EI	2.00%
	Klasse SHK	0.15%		Klasse EI AUD H	2.00%
	Klasse W2	0.86%		Klasse I	0.95%
	Klasse W2 CHF H	0.86%		Klasse I2	0.95%
	Klasse W2 USD H	0.86%		Klasse I2 AUD H	0.95%
	Klasse WA	0.86%		Klasse I2 CHF H	0.95%
	Klasse WA HKD H(d)	0.86%		Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse WA USD H	0.86%		Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse WT	0.86%		Klasse IT AUD H	0.95%
	Klasse WT SGD H(d)	0.86%		Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse WT USD H	0.86%		Klasse N2	2.05%
Emerging Markets Debt				Klasse NT	2.05%
Portfolio	Klasse A	1.50%		Klasse S	0.15%
	Klasse A EUR	1.50%		Klasse S1 2	0.70%
	Klasse A2	1.50%		Klasse S1 2 EUR(d)	0.70%
	Klasse A2 CHF H	1.50%		Klasse S1 EUR H	0.70%
	Klasse A2 EUR	1.50%		Klasse S1 GBP H	0.70%
	Klasse A2 EUR H	1.50%		Klasse S1L	0.70%
	Klasse A2 HKD	1.50%		Klasse SA	0.15%
	Klasse A2 PLN(d)	1.50%			
	Klasse A2 PLN H	1.50%	Mortgage Income Portfolio	Klasse A	1.50%
	Klasse A2 SGD H	1.50%		Klasse A2	1.50%
	Klasse AA	1.50%		Klasse A2 EUR	1.50%
	Klasse AA AUD H	1.50%		Klasse A2 HKD	1.50%
	Klasse AA CAD H	1.50%		Klasse A2 SGD(d)	1.50%
	Klasse AA EUR H	1.50%		Klasse A2X	1.25%
	Klasse AA GBP H	1.50%		Klasse A2X EUR	1.25%
	Klasse AA HKD	1.50%		Klasse AA	1.50%
	Klasse AA NZD H	1.50%		Klasse AA AUD H	1.50%

AB FCPI –	Anteilklasse	%
Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)	Klasse AA HKD	1.50%
	Klasse AA RMB H	1.50%
	Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse AR EUR H	1.50%
	Klasse AT	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse AT EUR	1.50%
	Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse AT HKD	1.50%
	Klasse AT SGD(d)	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse AX	1.25%
	Klasse AX EUR	1.25%
	Klasse BX	1.70%
	Klasse BX EUR	1.70%
	Klasse C	1.95%
	Klasse C2	1.95%
	Klasse C2 EUR	1.95%
	Klasse CX	1.70%
	Klasse I	0.95%
	Klasse I EUR	0.95%
	Klasse I2	0.95%
	Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse IX	0.70%
	Klasse N2	2.05%
	Klasse NT	2.05%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 AUD H	0.65%
	Klasse S1 EUR(d)	0.65%
	Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse S1 JPY(g)	0.65%
	Klasse S1L	0.65%
	Klasse SA	0.15%

- (a) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 19. September 2023.
(b) Die Anteilklasse wurde am 8. September 2023 aufgelöst.
(c) Die Anteilklasse wurde am 18. September 2023 aufgelöst.
(d) Die Anteilklasse wurde am 21. November 2023 aufgelöst.
(e) Die Anteilklasse wurde am 15. Dezember 2023 aufgelöst.
(f) Die Anteilklasse wurde am 26. Februar 2024 aufgelöst.
(g) Die Anteilklasse wurde am 8. November 2023 aufgelöst.

Folgende Tabelle gibt Aufschluss über die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen während des Berichtszeitraums zum 29. Februar 2024 und die Forderungen aus Aufwandsersatzung zum 29. Februar 2024:

AB FCPI –	Getragene Aufwendungen	Forderungen aus Aufwandsersatzung
Dynamic Diversified Portfolio	\$ 11,516	–
Global Equity Blend Portfolio	\$ 62,634	6,456

AB FCPI –	Getragene Aufwendungen	Forderungen aus Aufwandsersatzung
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	\$ 51,049	1,384
Japan Strategic Value Portfolio	¥ 7,132,079	1,678,069
China Low Volatility Equity Portfolio	\$ 70,265	14,462
Short Duration Bond Portfolio	\$ 67,255	5,952
American Income Portfolio	\$ 17	–
European Income Portfolio	€ –	29
Mortgage Income Portfolio	\$ 1,303	44

Die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen“ verbucht. Forderungen aus Aufwandsersatzung werden in der Zusammensetzung des Fondsvermögens „Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten“ verbucht. Der Fonds zahlt der Verwaltungsgesellschaft außerdem eine Verwaltungsgesellschaftsgebühr.

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

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

Die Jahressätze der betreffenden Gebühren für die einzelnen Portefeuilles sind in Tabelle 1 (auf Seite 168 bis 178) aufgeführt.

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

Der Fonds zahlt seiner Registrier- und Transferstelle AllianceBernstein Investor Services, einem Geschäftsbereich der Verwaltungsgesellschaft, eine Vergütung dafür, dass sie Personal und Räumlichkeiten im Rahmen der Erbringung von Dienstleistungen als Registrier- und Transferstelle des Fonds zur Verfügung stellt. Für den Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024 belief sich dieser Betrag auf \$10,709,475.

Der Fonds vergütet dem Anlageverwalter bestimmte Dienstleistungen, die dieser dem Fonds im Zusammenhang mit der Registrierung des Fonds zum Vertrieb in bestimmten Hoheitsgebieten außerhalb von Luxemburg vorbehaltlich bestimmter Bedingungen erbringt.

Für den Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024 belief sich dieser Betrag auf 363,722. Der Betrag ist in der Gebühr für professionelle Dienstleistungen in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten.

Der Fonds vergütet seinem Rechtsberater Elvinger Hoss Prussen, *société anonyme* gegenüber dem Fonds erbrachte Rechtsdienste.

Für den Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024 wurde eine Vergütung in Höhe von €3,691 entrichtet, die in der Gebühr für professionelle Dienstleistungen in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten ist.

Der Anlageverwalter hat keine Geschäfte bezüglich einer Platzierung und/oder Neuemission abgeschlossen, an der eine verbundene Person als Mitglied des Übernahmekonsortiums wesentlich beteiligt war. Alle im Namen des Fonds abgeschlossenen Geschäfte wurden im Verlauf der regulären Geschäftstätigkeit und/oder zu den handelsüblichen Bedingungen getätigt. Für den Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024 wurden keine Provisionen für Wertpapiertransaktionen unter Beanspruchung der Dienste der Tochtergesellschaften, Sanford C. Bernstein & Co., LLC and Bernstein Autonomous LLP., gezahlt. Mehrere Verwaltungsratsmitglieder des Fonds sind Mitarbeiter und/oder leitende Angestellte des Anlageverwalters und/oder seiner verbundenen Unternehmen.

Das Global High Yield Portfolio investiert in das AB SICAV I – Emerging Market Corporate Debt Portfolio, das AB SICAV I –

Sustainable Euro High Yield Portfolio, das AB SICAV I – Asia Income Opportunities Portfolio, das AB SICAV I – Emerging Market Local Currency Debt Portfolio und das AB SICAV I – US High Yield Portfolio, die von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden. Das American Income Portfolio invests in AB SICAV I – US High Yield Portfolio, das AB SICAV I – Asia Income Opportunities Portfolio, das AB SICAV I – Global Income Portfolio und das AB SICAV I – Sustainable Income Portfolio die von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden. Das Emerging Markets Debt Portfolio investiert in das AB SICAV I – Emerging Market Corporate Debt Portfolio das von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet wird.

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

ANMERKUNG F: Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen und Transaktionskosten

Im Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024, haben der Anlageverwalter und eventuelle verbundene Unteranlageverwalter, soweit nach geltendem Recht zulässig, Ausgleichsprovisionen/-vereinbarungen mit Brokern in Bezug auf Portefeuilles des Fonds erhalten bzw. abgeschlossen, die in Aktienwerten anlegen, für welche bestimmte Güter und Dienstleistungen zur Unterstützung des Anlageentscheidungsprozesses erhalten wurden. Die Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen wurden auf Grundlage der Voraussetzung abgeschlossen, dass die Abwicklung von Transaktionen für den Fonds im Einklang mit den Standards zur bestmöglichen Abwicklung erfolgt und der Anlageverwalter beim Abschluss von Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen zahlreiche Faktoren hinsichtlich der Standards zur bestmöglichen Abwicklung berücksichtigt, wie beispielsweise Umfang und Art der Brokergebühren. Darüber hinaus können aufgrund der Art der Anlagestrategie bestimmter Portefeuilles, einschließlich der Fälle, in denen der Anlageverwalter Anlageverwaltungsdienstleistungen an AllianceBernstein, alle Kosten im Zusammenhang mit Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen „entflochten“ und vom Anlageverwalter oder seinen Unterbeauftragten getragen werden, falls dies nach geltendem Recht erforderlich ist.

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

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

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

Transaktionskosten sind Kosten, die bei dem Erwerb, der Ausgabe oder der Veräußerung von übertragbaren Wertpapie-

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

In der folgenden Tabelle sind die Transaktionskosten, die für die einzelnen Portefeuilles im Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024 angefallen sind, aufgeführt:

AB FCPI-	Transaktionskosten
Dynamic Diversified Portfolio(a)	\$ 2,730
Global Equity Blend Portfolio	\$ 29,447
Emerging Markets Growth Portfolio	\$ 556,911
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	\$ 500,223
Japan Strategic Value Portfolio	¥ 2,284,605
China Low Volatility Equity Portfolio	\$ 112,096
Short Duration Bond Portfolio.....	\$ 13,407
Global High Yield Portfolio	\$ 141,946
American Income Portfolio.....	\$ 1,380,701
European Income Portfolio	€ 12,451
Emerging Markets Debt Portfolio.....	\$ 6,150
Mortgage Income Portfolio.....	\$ -0-

(a) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 19. September 2023. Siehe Anmerkung A.

ANMERKUNG G: Devisentermingeschäfte

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

Wertschwankungen offener Devisenterminkontrakte werden zu Finanzberichterstattungszwecken unter „Unrealisierte Wertschöpfung (-minderung) aus Devisenterminkontrakten“ in der Vermögensaufstellung berücksichtigt.

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

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

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

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

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

Die Wertpapiere im Fonds werden als Sicherheit für Devisentermingeschäfte verwendet.

ANMERKUNG H: Pensionsgeschäfte

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

Zum 29. Februar 2024 gab es keine Pensionsgeschäfte.

Während des Berichtszeitraums zum 29. Februar 2024 wurden keine Zinserträge aus Pensionsgeschäften verzeichnet.

ANMERKUNG I: Umgekehrte Pensionsgeschäfte

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

zurückverlangen und gleichzeitig die Zinserträge, die mit diesen Portfeuille-Wertpapieren verbunden sind, behalten.

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

Zum 29. Februar 2024 bestanden keine umgekehrten Pensionsgeschäfte

Während des Berichtszeitraums zum 29. Februar 2024 wurden keine Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften verzeichnet.

ANMERKUNG J: Finanzterminkontrakte

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

Zu dem Zeitpunkt, an dem der Fonds einen Finanzterminkontrakt abschließt, hinterlegt und hält er beim Broker die von der Börse, an der der Kontrakt abgeschlossen wird, erforderte Sicherheitsleistung in Form einer Einschusszahlung.

Der Fonds erklärt sich nach dem Kontrakt einverstanden, einen Bargeldbetrag vom Broker in Empfang zu nehmen oder diesem zu bezahlen, der den täglichen Wertschwankungen des Kontrakts entspricht.

Dieser Zahlungsempfang bzw. diese Zahlung wird als Einschusszahlung bezeichnet und vom Fonds als unrealisierter Gewinn bzw. Verlust verbucht. Nach der Glattstellung des Kontrakts weist der Fonds in Höhe des Unterschieds zwischen dem Wert des Kontrakts bei Abschluss und bei der Glattstellung einen realisierten Gewinn bzw. Verlust aus.

ANMERKUNG K: Swap-Geschäfte

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

Zentral abgerechnete Credit-Default-Swaps

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

Zentral abgerechnete Zinsswaps

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

ANMERKUNG L: Optionsgeschäfte

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

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

Für verkaufte Optionen erhaltene Prämien, die auslaufen, ohne ausgeübt zu werden, werden vom Fonds am Verfallstermin als realisierter Gewinn aus verkauften Optionen verbucht. Die Differenz zwischen der erhaltenen Prämie und dem gezahlten Betrag bei Ausführung einer Glatstellungstransaktion, einschließlich Händlerprovisionen, wird ebenfalls als realisierter Gewinn behandelt, bzw. als realisierter Verlust, wenn die erhaltene Prämie geringer ist als der bezahlte Betrag für die Glatstellungstransaktion.

Total-Return-Swaps

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

Credit-Default-Swaps

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

Zinsswaps

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

Inflationsswap

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

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

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

ANMERKUNG M: Sicherheiten

In der folgenden Tabelle sind die Barsicherheiten aufgeführt, die zum 29. Februar 2024 für bestimmte derivative Finanzinstrumente vom Broker gehalten wurden bzw. diesem zu entrichten waren:

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
Global Equity Blend Portfolio . . .		
Bank of America	\$ 12,037	–
Barclays	\$ 4,295	–
Citibank	\$ –	49,390
Short Duration Bond Portfolio . . .		
Citibank	\$ 1,211,282	1,024,716
Morgan Stanley	\$ 3,640,597	99,487
Global High Yield Portfolio		
Citibank	\$ –	649,073
Credit Suisse	\$ 250,000	–
JPMorgan Chase	\$ 11,347,000	–
Morgan Stanley	\$ 85,111,573	180,556,222
American Income Portfolio		
Citibank	\$ –	76,660,900
JPMorgan Chase	\$ 9,965,000	–
Morgan Stanley	\$ 12,374,843	–
European Income Portfolio		
Citibank	€ 5,665,307	–
Goldman Sachs	€ 7,174,542	204,970
Emerging Markets Debt Portfolio		
Deutsche Bank	\$ –	40,000
Goldman Sachs	\$ 2,243,019	–
Morgan Stanley	\$ 4,613,201	–
Mortgage Income Portfolio		
Citibank	\$ 240,705	–
Credit Suisse	\$ 351,400	–
JPMorgan Chase	\$ 248,000	–
Morgan Stanley	\$ 3,521,333	3,386,639

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

In Bezug auf die am 29. Februar 2024 von den einzelnen Portefeuilles 29. Februar 2024 gehaltenen Derivate sind in der folgenden Tabelle aus Wertpapieren bestehende Sicherheiten aufgeführt:

AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
Global High Yield Portfolio		
Citibank		
U.S. Treasury Notes, 4.00%, 06/30/2028	\$ 14,274,609	–
Credit Suisse		
U.S. Treasury Notes, 4.38%, 10/31/2024	\$ 7,809,424	–
Deutsche Bank		
U.S. Treasury Notes, 4.38%, 10/31/2024	\$ 1,535,613	–
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Notes, 4.38%, 10/31/2024	\$ 10,667,754	–
HSBC Bank		
U.S. Treasury Notes, 4.00%, 06/30/2028	\$ 348,489	–
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bonds, 6.75%, 08/15/2026	\$ 149,228,070	–
U.S. Treasury Notes, 4.00%, 06/30/2028	\$ 7,690,354	–
American Income Portfolio		
Barclays		
U.S. Treasury Notes, 4.63%, 06/30/2025	\$ 1,576,562	–
Citibank		
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 08/15/2029	\$ 170,685,361	–
U.S. Treasury Notes, 4.63%, 06/30/2025	\$ 23,224,490	–
Credit Suisse		
U.S. Treasury Notes, 4.13%, 10/31/2027	\$ 162,591	–
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Notes, 4.63%, 06/30/2025	\$ 315,711	–
U.S. Treasury Notes, 4.13%, 10/31/2027	\$ 6,664,530	–
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 164,019,469	–
U.S. Treasury Notes, 4.63%, 06/30/2025	\$ 2,335,743	–

ANMERKUNG N: Verleih von Portefeuille-Wertpapieren

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

jeglicher Sicherheiten, der nach dem Zahlungsverzug des Entleihers realisiert wird, nicht ausreicht, um die verliehenen Wertpapiere zu ersetzen.

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

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

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

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

Für den Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024 erwirtschafteten die Portefeuilles Nettogebühreneinnahmen, die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen sind.

Für den Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024 verdiente Brown Brothers Harriman & Co. (in seiner Funktion als Wertpapierleihstelle) ein Honorar von \$14,858 für die Bereitstellung

von Wertpapierleihdiensten. Dieses Honorar ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen. Die zum 29. Februar 2024 verliehenen Wertpapiere und die entsprechenden ausstehenden Sicherheiten haben folgenden Wert. Die Sicherheiten beziehen sich auf die in den Portefeuilles gehaltenen Wertpapiere.

AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Global Equity Blend		
Portfolio.....		
UBS AG	\$ 384,494	403,765
Societe Generale	\$ 232,486	244,114
Emerging Markets Growth		
Portfolio.....		
Merrill Lynch	\$ 6,930,474	7,278,673
Barclays	\$ 2,959,814	3,107,963
Japan Strategic Value		
Portfolio.....		
Merrill Lynch	¥ 435,816,092	457,712,310
Citigroup Global Markets Limited	¥ 90,716,064	95,280,157
JPMorgan Chase	¥ 59,982,434	62,992,698

ANMERKUNG O: Bankkredite

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

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

ANMERKUNG P: Gemeinsame Verwaltung von Vermögenswerten

Zum Zwecke der effizienten Verwaltung kann die Verwaltungsgesellschaft Vermögenswerte bestimmter Portefeuilles innerhalb oder außerhalb des Fonds gemeinsam verwalten, wenn dies gemäß der Anlagepolitik des jeweiligen Portefeuilles gestattet ist. In diesem Fall werden die Vermögenswerte verschiedener Portefeuilles gemeinsam verwaltet. Auf gemeinsam verwaltete Vermögenswerte wird als „Pool“ Bezug genommen. Diese Pool-Vereinbarungen dienen dazu, die operativen und anderen Aufwendungen zu reduzieren; die gesetzlichen Rechte und Pflichten der Anteilinhaber ändern sich dadurch nicht. Die Pools sind keine separaten juristischen Personen; Anleger können nicht direkt auf diese Pools zugreifen. Jedes Portefeuille behält das Anrecht auf seine eigenen spezifischen Vermögenswerte.

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

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

Zum 29. Februar 2024 verwaltet der Fonds die Vermögenswerte bestimmter Portefeuilles innerhalb des Fonds unter Verwendung der folgenden Pools gemeinsam:

Asset Pool

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

Participating Portfolios

Global Equity Blend Portfolio
Global Equity Blend Portfolio

ANMERKUNG Q: Spätere Ereignisse

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, die Restrukturierung des AB FCP I - China Low Volatility Portfolio in das

AB SICAV I - All China Equity Portfolio mit Wirkung zum 8. März 2024 zu genehmigen.

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
<u>Dynamic Diversified Portfolio(a)</u>				
Klasse				
A	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
A EUR	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
A EUR H	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
AX	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
AX EUR	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
AX SGD	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
BX	1.40%	0.10%	1.00%	2.90%
C	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
C EUR	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
C EUR H	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
CX	1.70%	0.10%	N/A	2.20%
I	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
I EUR	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
I EUR H(b)	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
IX(c)	0.70%	0.10%	N/A	1.20%
<u>Global Equity Blend Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.60%	0.10%	N/A	2.10%
A EUR	1.60%	0.10%	N/A	2.10%
A EUR H	1.60%	0.10%	N/A	2.10%
A SGD	1.60%	0.10%	N/A	2.10%
B	1.60%	0.10%	1.00%	3.10%
B SGD	1.60%	0.10%	1.00%	3.10%
C	2.05%	0.10%	N/A	2.55%
C EUR	2.05%	0.10%	N/A	2.48%
I	0.80%	0.10%	N/A	1.29%
I EUR	0.80%	0.10%	N/A	1.30%
S HKD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S1	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 EUR	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 GBP	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 SGD	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
<u>Emerging Markets Growth Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.70%	0.10%	N/A	2.04%
A AUD H	1.70%	0.10%	N/A	2.04%
A EUR	1.70%	0.10%	N/A	2.04%
A HKD	1.70%	0.10%	N/A	2.04%
A PLN H	1.70%	0.10%	N/A	2.04%
A SGD	1.70%	0.10%	N/A	2.04%
A SGD H	1.70%	0.10%	N/A	2.03%
AD	1.70%	0.10%	N/A	2.04%
B	1.70%	0.10%	1.00%	3.04%
C	2.15%	0.10%	N/A	2.49%
C EUR	2.15%	0.10%	N/A	2.48%
ED	1.70%	0.10%	1.00%	3.03%
I	0.90%	0.10%	N/A	1.23%
I AUD H	0.90%	0.10%	N/A	1.24%
I EUR	0.90%	0.10%	N/A	1.22%
N	2.15%	0.10%	N/A	2.49%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.06%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Emerging Markets Growth Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S1 EUR	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.07%
S1 GBP	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.03%

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Klasse				
A	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A AUD H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A EUR	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A HKD	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A SGD H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD AUD H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD CAD H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD EUR	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD EUR H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD GBP H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD HKD	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD NZD H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD RMB H(d)	1.70%	0.05%	N/A	2.02%
AD ZAR H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AY JPY	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
BY JPY	1.45%	0.05%	0.72%	2.52%
C	2.15%	0.05%	N/A	2.50%
C EUR	2.15%	0.05%	N/A	2.48%
ED	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
ED AUD H	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
I	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
I AUD H(d)	0.90%	0.05%	N/A	1.23%
I EUR	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
I GBP	0.90%	0.05%	N/A	1.18%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.25%
S HKD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.25%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.15%
S1 EUR	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.12%
SD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.25%

Japan Strategic Value Portfolio

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Klasse				
A	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A CZK H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A EUR	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A PLN(d)	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A SGD	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A USD	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A USD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD AUD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD NZD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD USD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD ZAR H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
C	1.95%	0.05%	N/A	2.39%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Japan Strategic Value Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
C EUR	1.95%	0.05%	N/A	2.39%
C EUR H	1.95%	0.05%	N/A	2.39%
C USD	1.95%	0.05%	N/A	2.40%
I	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I EUR	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I EUR H	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I USD	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I USD H	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
S EUR H(d)	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%
S1 EUR	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 USD	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
SD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%
China Low Volatility Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A EUR	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A HKD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A PLN H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD AUD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD CAD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD EUR H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD GBP H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD HKD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD NZD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD SGD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD ZAR H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
B	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
B EUR	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
C	2.15%	0.05%	N/A	2.44%
C EUR	2.15%	0.05%	N/A	2.44%
I	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
I EUR	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
S(e)	N/A	0.01%(8)	N/A	0.16%
S1	0.75%	0.01%(8)	N/A	0.91%
S1 EUR	0.75%	0.01%(8)	N/A	0.91%
Short Duration Bond Portfolio				
Klasse				
A	0.85%	0.10%	N/A	1.19%
A EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
A2	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
A2 EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
A2 EUR H	0.85%	0.10%	N/A	1.19%
A2 HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
A2 SGD H	0.85%	0.10%	N/A	0.61%
AA	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AA AUD H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AA CAD H	0.85%	0.10%	N/A	1.19%
AA GBP H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AA HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AA SGD H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AJ	0.65%	0.10%	N/A	0.99%
AT	0.85%	0.10%	N/A	1.19%
AT AUD H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT CAD H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT EUR H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT GBP H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT NZD H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT SGD H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AX	0.65%	0.10%	N/A	0.98%
C	1.25%	0.10%	N/A	1.60%
C2	1.25%	0.10%	N/A	1.58%
C2 EUR H(d)	1.25%	0.10%	N/A	1.55%
I	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I EUR(d)	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2 EUR(d)	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2 EUR H	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
IT	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
N2	1.35%	0.10%	N/A	1.68%
NT	1.35%	0.10%	N/A	1.69%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S1	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
S1 2	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
S1 2 EUR	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
S1 EUR H	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%

Global High Yield Portfolio**

Klasse				
A	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
A EUR	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
A2	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
A2 CHF H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
A2 EUR	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
A2 EUR H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.62%
A2 HKD	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
A2 PLN H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
A2 SGD	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
A2 SGD H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AA	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AA AUD H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AA CAD H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AA EUR H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AA GBP H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AA HKD	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AA NZD H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AA RMB H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AA SGD H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AA ZAR H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AK	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AK EUR	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AK EUR H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Global High Yield Portfolio** (Fortsetzung)				
Klasse				
AR EUR H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AT	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AT AUD H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AT CAD H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AT EUR	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AT EUR H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AT GBP H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AT HKD	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AT NZD H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AT RMB H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AT SGD	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AT SGD H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
B	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.63%
B2	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.62%
BT	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.63%
BT AUD H	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.63%
C	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.13%
C EUR	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.11%
C2	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.13%
C2 EUR	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.13%
C2 EUR H	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.13%
CK(d)	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.08%
CK EUR H(d)	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.09%
CT	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.13%
EA	1.41%(1)	0.10%	0.50%	2.13%
EA AUD H	1.41%(1)	0.10%	0.50%	2.13%
EA ZAR H	1.41%(1)	0.10%	0.50%	2.13%
I	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
I EUR	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.10%
I2	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
I2 AUD H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
I2 CHF H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
I2 EUR	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
I2 EUR H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.12%
I2 SGD	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
I2 SGD H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
IA AUD H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
IQD	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
IT	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
IT AUD H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
IT CAD H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
IT EUR H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
IT GBP H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IT HKD	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.15%
IT RMB H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
J	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.63%
N2	1.96%(4)	0.10%	N/A	2.18%
NT	1.96%(4)	0.10%	N/A	2.18%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.93%
S1 EUR(d)	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.91%
S1 EUR H	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.94%
S1D	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.93%
S1D2	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.93%
S1L GBP H	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.99%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Global High Yield Portfolio** (Fortsetzung)				
Klasse				
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
SK	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.68%
W	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W EUR	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.96%
W2	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W2 CHF H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W2 EUR H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT AUD H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT CAD H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT EUR H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT GBP H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT RMB H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.93%
American Income Portfolio**				
Klasse				
A	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 CHF H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
A2 DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
A2 EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 HKD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 PLN H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 SGD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA CAD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA GBP H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA HKD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA NZD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA ZAR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AK	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AK EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AK EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AR EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AR EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.34%
AT	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT CAD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT GBP H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT HKD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT NZD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
American Income Portfolio** (Fortsetzung)				
Klasse				
AT SGD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
B	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
B2	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
BT	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
C	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C EUR	1.55%	0.10%	N/A	1.78%
C2	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2 EUR	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2 EUR H	1.55%	0.10%	N/A	1.76%
CT	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
EA	1.10%	0.10%	0.50%	1.82%
EA AUD H	1.10%	0.10%	0.50%	1.82%
EA ZAR H	1.10%	0.10%	0.50%	1.82%
I	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I EUR	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 CHF H	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
I2 DUR PH(f)	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 EUR	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 EUR H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 HKD	0.55%	0.10%	N/A	0.74%
I2 SGD(d)	0.55%	0.10%	N/A	0.73%
I2 SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IA	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IA AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT CAD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT EUR H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT GBP H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT HKD	0.55%	0.10%	N/A	0.84%
IT JPY	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT JPY H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT NZD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT RMB H	0.55%	0.10%	N/A	0.78%
IT SGD	0.55%	0.10%	N/A	0.79%
IT SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
J	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
L2(d)	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT(d)	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
N2	1.65%	0.10%	N/A	1.87%
NT	1.65%	0.10%	N/A	1.87%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
S1D	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
S1D2	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
W	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
W2	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
W2 CHF H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
W2 EUR H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
American Income Portfolio** (Fortsetzung)				
Klasse				
WT	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WT AUD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WT EUR H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT GBP H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WT HKD	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT SGD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
European Income Portfolio				
Klasse				
A	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A USD	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A2	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A2 CHF H	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
A2 PLN H	1.10%	0.10%	N/A	1.38%
A2 USD	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A2 USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA HKD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AK	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AR	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT USD	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
B USD	1.10%	0.10%	0.70%	2.07%
B2	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
B2 USD	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
C	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
C USD	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
C2	1.55%	0.10%	N/A	1.83%
C2 USD	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
C2 USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.81%
CK	1.55%	0.10%	N/A	1.84%
CT USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
I	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I USD	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
I2	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I2 AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I2 CHF H	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
I2 USD	0.55%	0.10%	N/A	0.83%
I2 USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.84%
IA	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
IA HKD H	0.55%	0.10%	N/A	0.83%
IA SGD H(d)	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IA USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IT	0.55%	0.10%	N/A	0.83%
IT SGD H(d)	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IT USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
NT USD H	1.65%	0.10%	N/A	1.92%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
European Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1 USD	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.56%
S1 USD H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1D	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.60%
SA USD H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
W2	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
W2 CHF H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.64%
W2 USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.65%
WA	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.65%
WA HKD H(d)	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.58%
WA USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.65%
WT	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.64%
WT SGD H(d)	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.59%
WT USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.65%
Emerging Markets Debt Portfolio**				
Klasse				
A	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.38%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 CHF H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
A2 EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 PLN(d)	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 PLN H	1.10%	0.05%	N/A	1.39%
A2 SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.39%
AA GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.41%
AA HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.41%
AA NZD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA RMB H(d)	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA SGD H(d)	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA ZAR H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AI	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AI AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AR EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT NZD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
BT	1.10%	0.05%	1.00%	2.40%
C	1.55%	0.05%	N/A	1.85%
C EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.81%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.85%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Emerging Markets Debt Portfolio** (Fortsetzung)				
Klasse				
C2 EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.83%
C2 EUR H	1.55%	0.05%	N/A	1.84%
CT	1.55%	0.05%	N/A	1.81%
EA	1.10%	0.05%	0.50%	1.90%
EA AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.89%
EA ZAR H	1.10%	0.05%	0.50%	1.89%
EI	1.10%	0.05%	0.50%	1.90%
EI AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.90%
I	0.55%	0.05%	N/A	0.83%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 CHF H	0.55%	0.05%	N/A	0.82%
I2 EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.82%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
IT AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S1 2	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.68%
S1 2 EUR(d)	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.62%
S1 EUR H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.63%
S1 GBP H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.64%
S1L	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.69%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.13%

Mortgage Income Portfolio

Klasse				
A	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2 HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 SGD(d)	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2X	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
A2X EUR	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA RMB H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA ZAR H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AR EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT SGD(d)	1.10%	0.05%	N/A	1.29%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AX	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
AX EUR	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
BX	1.05%(5)	0.05%	0.45%	1.70%
BX EUR	1.05%(5)	0.05%	0.45%	1.70%
C	1.55%	0.05%	N/A	1.79%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.79%
C2 EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.75%
CX	1.50%(6)	0.05%	N/A	1.70%
I	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
I EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
I2 EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.82%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
IX	0.50%(7)	0.05%	N/A	0.70%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.89%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.89%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.61%
S1 AUD H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.60%
S1 EUR(d)	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.55%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.57%
S1 JPY(g)	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1L	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.11%

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

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

- (a) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 19. September 2023. Siehe Anmerkung A.
- (b) Die Anteilklasse wurde am 8. September 2023 aufgelöst.
- (c) Die Anteilklasse wurde am 18. September 2023 aufgelöst.
- (d) Die Anteilklasse wurde am 21. November 2023 aufgelöst.
- (e) Die Anteilklasse wurde am 15. Dezember 2023 aufgelöst.
- (f) Die Anteilklasse wurde am 26. Februar 2024 aufgelöst.
- (g) Die Anteilklasse wurde am 8. November 2023 aufgelöst.

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

- (1) Max 1.45% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 1.25% bei über \$15,000,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- (2) Max 1.95% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 1.75% bei über \$15,000,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- (3) Max 0.95% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 0.75% bei über \$15,000,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- (4) Max 2.00% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 1.85% bei über \$15,000,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- (5) 1.05% bis zu \$100,000,000, 1.00% für die nächsten \$100,000,000 und 0.95% bei über \$200,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- (6) 1.50% bis zu \$100,000,000, 1.45% für die nächsten \$100,000,000 und 1.40% bei über \$200,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- (7) 0.50% bis zu \$100,000,000, 0.45% für die nächsten \$100,000,000 und 0.40% bei über \$200,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

Verwaltungsgesellschaftsgebühr

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

Maximale Verwaltungsgebühr gemäß den Angaben im Prospekt des Fonds

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

TABELLE 2
PORTEFEUILLEUMSATZ

AB FCPI

	<u>Umsatz*</u>
AB FCPI-	
Global Equity Blend Portfolio	92.68%
Emerging Markets Growth Portfolio	49.20%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	75.92%
Japan Strategic Value Portfolio	15.90%
China Low Volatility Equity Portfolio	14.22%
Short Duration Bond Portfolio	151.60%
Global High Yield Portfolio	(0.03)%
American Income Portfolio	37.84%
European Income Portfolio	57.96%
Emerging Markets Debt Portfolio	175.82%
Mortgage Income Portfolio	(47.39)%

* Ungeprüft.

Wie im Prospekt dargelegt, kann der Anlageverwalter bei der Umsetzung der jeweiligen Anlagestrategie der Portefeuilles einen Teil seiner Vermögensverwaltungsaufgaben an eine oder mehrere seiner 100%igen Tochtergesellschaften (die „**verbundenen Unteranlageverwalter**“) übertragen. Alle verbundenen Unteranlageverwalter sind zur Erbringung von Anlageverwaltungsdienstleistungen zugelassen, registriert oder besitzen eine entsprechende Genehmigung und unterliegen der Aufsicht durch die zuständige Aufsichtsbehörde.

Für den Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024 hat der Anlageverwalter die Anlageverwaltungsdienstleistungen für die nachstehend aufgeführten Portefeuilles an die folgenden verbundenen Unteranlageverwalter übertragen:

AllianceBernstein Australia Limited:

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

AllianceBernstein Limited:

- Emerging Markets Debt Portfolio
- Global Equity Blend Portfolio
- European Income Portfolio
- Short Duration Bond Portfolio

AllianceBernstein Hong Kong Limited:

- Emerging Markets Debt Portfolio
- Asia Ex-Japan Equity Portfolio
- China Low Volatility Equity Portfolio

AllianceBernstein (Singapore) Ltd.:

- Emerging Markets Growth Portfolio
- China Low Volatility Equity Portfolio

AllianceBernstein (Japan) Ltd.:

- Japan Strategic Value Portfolio

Finanzinformationen zum Fonds

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

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

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

Anteile der Klassen SB GB und S1B GB stehen nur solchen britischen institutionellen Anlegern zur Verfügung, die zur

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

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

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

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

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

BNP Paribas Securities Services SA, Zweigniederlassung Mailand
Via Ansperto 5
Mailand
Italien

Allfunds Bank, S.A. Zweigniederlassung Mailand
Via Santa Margherita 7
Mailand
Italien

Société Générale Securities Services S.p.A.
Santa Chiara 19
Turin
Italien

Banca Sella Holding S.p.A.
Piazza Gaudenzio Sella 1
I-13900 Biella
Italien

CACEIS Bank Italy
Branch Piazza Cavour n°5
20121 Mailand
Italien

AllianceBernstein (Singapore) Ltd.
One Raffles Quay
#27-11 South Tower
Singapur 048583

Allfunds Bank, S.A.
Calle Nuria n° 57
Colonia Mirasierra
28034, Madrid
Spanien

Proservice Finteco Spółka z o.o. (bis 31. Dezember 2023)
(ehemals Moventum Spółka z o.o.)
Konstruktorska 12A
02-673 Warschau

Bank Polska Kasa Opieki Spółka Akcyjna
ul.Grzybowska 53/57
00-950 Warschau, Polen

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

Anleger im Zusammenhang mit Artikel 92 Absatz 1 Ziffer b bis f der OGAW-Richtlinie für Österreich, Kroatien, die Tschechische Republik, Dänemark, Finnland, Frankreich, Deutschland, Ungarn, Island, Liechtenstein, Luxemburg, die Niederlande, Norwegen, Portugal, Rumänien, die Slowakei und Schweden unter www.eifs.lu/alliancebernstein. Die Einrichtungsanforderungen für Anleger im Zusammenhang mit Artikel 92 Absatz 1 Ziffer a der OGAW-Richtlinie werden von der AllianceBernstein (Luxemburg) S.à r.l. bearbeitet.

Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die Security Financing Transaction Regulation (die „SFTR“) legt neue Anforderungen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps fest.

Wertpapierfinanzierungsgeschäft wird in Artikel 3(11) des SFTR folgendermaßen definiert: .

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- Wertpapier- oder Rohstoffleihe;
- ein Kaufs-/Rückverkaufsgeschäft oder Verkaufs-/Rückaufgeschäft; oder
- ein Margenleihgeschäft.

Zum 29. Februar 2024 war der Fonds in Wertpapierleihgeschäften engagiert die als Transaktionstyp unter die SFT-Verordnung fallen.

Allgemeine Angaben

Zum 29. Februar 2024 belief sich das Vermögen über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte hinweg auf folgende Beträge:

Global Equity Blend Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$616,980	0.65%	1.30%

Emerging Markets Growth Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$9,890,288	1.67%	3.36%

Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	¥586,514,590	6.69%	13.48%

Die Basisinformationsblätter (KIDs) des Fonds werden unter www.alliancebernstein.com/go/kid zur Verfügung gestellt.

Mitteilungen an die Anteilhaber

Soweit laut Gesetzgebung und anwendbarer Bestimmungen vorgeschrieben, werden Mitteilungen an die Anteilhaber im *Recueil Electronique des Sociétés et Associations* (ehemals *Mémorial*) sowie in der/den anderen Tageszeitung(en) in den Ländern veröffentlicht, die die Verwaltungsgesellschaft von Zeit zu Zeit festlegen kann.

Veränderungen des Wertpapierbestands

Während des Berichtszeitraums erfolgte Änderungen des Anlageportefeuilles werden den Anteilhabern am Hauptsitz der Verwaltungsgesellschaft kostenlos zur Verfügung gestellt.

Richtlinie zu umstrittenen Waffen

Die Verwaltungsgesellschaft veranlasst die weltweite Überprüfung von Unternehmen auf ihre Beteiligung an der Herstellung von Antipersonenminen, Streumunition und/oder Munition, die mit abgereichertem Uran, biologischen Waffen, chemischen Waffen und/oder Brandwaffen hergestellt wird. In den Fällen, in denen eine solche Beteiligung an der Herstellung verifiziert wurde, ist es die Politik der Verwaltungsgesellschaft, dem Fonds nicht zu gestatten, in Wertpapieren zu investieren, die von solchen Unternehmen ausgegeben werden.

Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Im Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Im Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024 wurden keine Barsicherheiten wiederangelegt.

Angaben zur Konzentration

Zum 29. Februar 2024 waren Folgende die zehn größten Emittenten der bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte erhaltenen Wertpapiersicherheiten:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Schweizer Regierung	\$207,370
2	Französische Regierung	\$201,771
3	Deutsche Regierung	\$147,557
4	Britische Regierung	\$81,531
5	US-Regierung	\$9,650

Emerging Markets Growth Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Britische Regierung	\$2,943,606
2	US-Regierung	\$2,620,156
3	Deutsche Regierung	\$2,273,797
4	Französische Regierung	\$1,402,638
5	Schwedische Regierung	\$1,146,439

Japan Strategic Value Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	US-Regierung	¥208,608,908
2	Britische Regierung	¥202,255,850
3	Deutsche Regierung	¥119,179,091
4	Französische Regierung	¥79,642,650
5	Niederländische Regierung	¥6,298,666

Zum 29. Februar 2024 waren Folgende die zehn größten Gegenparteien bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte:

Global Equity Blend Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	UBS AG	\$384,494
	2	Societe Generale	\$232,486

Emerging Markets Growth Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	\$6,930,474
	2	Barclays	\$2,959,814

Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	¥435,816,092
	2	Citigroup Global Markets Limited	¥90,716,064
	3	JPMorgan Chase	¥59,982,434

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapierleihe

Zum 29. Februar 2024 hielten vier Depotbanken die folgenden erhaltenen Sicherheiten:

Global Equity Blend Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$403,722
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$197,116
CREST	Wertpapiersicherheit	\$37,391
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$9,650

Emerging Markets Growth Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$6,133,034
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$2,620,156
CREST	Wertpapiersicherheit	\$1,633,446

Japan Strategic Value Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	¥287,508,530
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	¥208,608,908
CREST	Wertpapiersicherheit	¥119,867,727

Erträge/Kosten

Renditen und Kosten für die jeweiligen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte für den am 29. Februar 2024 beendeten Zeitraum:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$3,052	80%
Für dritte Partei	\$763	20%

Emerging Markets Growth Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$41,087	80%
Für dritte Partei	\$10,272	20%

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$105	80%
Für dritte Partei	\$26	20%

Japan Strategic Value Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	¥2,207,539	80%
Für dritte Partei	¥551,885	20%

China Low Volatility Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$177	80%
Für dritte Partei	\$44	20%

Zusammenfassende Transaktionsangaben

Zum 29. Februar 2024 besitzen die verschiedenen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte folgende Fälligkeiten:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$616,980

Emerging Markets Growth Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$9,890,288

Japan Strategic Value Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	¥0
Ein Tag bis eine Woche	¥0
Eine Woche bis ein Monat	¥0
Ein bis drei Monate	¥0
Drei Monate bis ein Jahr	¥0
Mehr als ein Jahr	¥0
Offene Laufzeit	¥586,514,590

Zum 29. Februar 2024 kommen folgende Abrechnungs- und Clearing-Mechanismen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte zum Einsatz:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$616,980

Emerging Markets Growth Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$9,890,288

Japan Strategic Value Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	¥586,514,590

Die zusammenfassenden Transaktionsangaben für Sicherheitspositionen (einschließlich Barmittel), die zum 29. Februar 2024 für sämtliche Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps erhalten wurden, lauten folgendermaßen:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
UBS AG	Staatsanleihe der Schweizerischen Eidgenossenschaft 0.50%, 06/27/2032	\$72,667	AAA	>1 Jahr	CHF	Schweiz
UBS AG	Schweizer Staatsanleihe 0.50%, 05/27/2030	\$72,637	AAA	>1 Jahr	CHF	Schweiz
UBS AG	Schweizer Schatzwechsel 0.00%, 12/27/2024	\$62,066	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	CHF	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/04/2032	\$61,996	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 2.50%, 09/24/2026	\$57,158	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 6.25%, 01/04/2030	\$48,429	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 3.25%, 01/31/2033	\$43,940	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2030	\$43,940	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 5.75%, 10/25/2032	\$43,940	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.50%, 01/31/2029	\$37,391	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.75%, 02/25/2028	\$34,353	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/16/2027	\$28,270	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2029	\$14,007	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 04/30/2029	\$9,607	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$7,664	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	\$7,106	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	\$1,740	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
UBS AG	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 04/10/2024	\$450	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 2.50%, 09/24/2026	\$238	AA	>1 Jahr	€	Frankreich

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 3.50%, 10/22/2025	\$176	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
UBS AG	US-Staatsanleihe 5.50%, 08/15/2028	\$35	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.00%, 01/31/2032	\$24	AA	>1 Jahr	£	Schweiz
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 2.75%, 02/25/2029	\$12	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 5.00%, 10/31/2025	\$8	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 6.50%, 07/04/2027	\$8	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.10%, 07/25/2031	\$7	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 2.30%, 02/15/2033	\$5	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 3.00%, 05/25/2033	\$2	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/10/2026	\$2	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 01/04/2031	\$1	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Emerging Markets Growth Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 4.13%, 01/29/2027	\$1,310,160	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 01/15/2027	\$1,310,132	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 3.38%, 05/15/2033	\$1,310,024	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 3.50%, 10/22/2025	\$1,229,769	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	\$958,651	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 1.00%, 08/15/2025	\$756,260	AAA	>1 Jahr	€	USA
Barclays	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2024	\$559,433	AA	Weniger als ein Monat	€	Großbritannien
Barclays	Französische Staatsanleihe 0.25%, 07/25/2024	\$559,415	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Schwedische Staatsanleihe 2.50%, 05/12/2025	\$559,174	AAA	>1 Jahr	SEK	Großbritannien

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 01/04/2027	\$558,886	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.88%, 07/31/2033	\$403,677	AA	>1 Jahr	£	USA
Barclays	Schwedische Staatsanleihe 0.13%, 06/01/2032	\$398,125	AAA	>1 Jahr	SEK	Großbritannien
Barclays	Französische Staatsanleihe 2.50%, 09/24/2026	\$283,790	AA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Schwedische Staatsanleihe 1.00%, 06/01/2025	\$189,140	AAA	>1 Jahr	SEK	Großbritannien

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Japan Strategic Value Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 4.13%, 01/29/2027	¥82,388,123	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 01/15/2027	¥82,386,390	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 3.38%, 05/15/2033	¥82,379,605	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 3.50%, 10/22/2025	¥77,332,835	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	¥60,283,829	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 1.00%, 08/15/2025	¥47,556,680	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.88%, 07/31/2033	¥25,384,848	AA	>1 Jahr	£	USA
Citigroup Global Markets Limited	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.00%, 01/31/2032	¥17,150,044	AA	>1 Jahr	£	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 4.00%, 02/29/2028	¥17,149,036	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 05/25/2033	¥17,148,805	AA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 3.50%, 04/30/2028	¥17,145,063	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 1.75%, 11/25/2024	¥17,139,527	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 1.50%, 05/25/2031	¥11,338,605	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 1.85%, 07/25/2027	¥11,338,583	AA	>1 Jahr	€	USA

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
JPMorgan Chase	Deutsche Staatsanleihe 4.75%, 07/04/2028	¥11,338,582	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 3.50%, 04/25/2026	¥11,338,579	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 5.50%, 04/25/2029	¥11,338,551	AA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 4.13%, 09/30/2027	¥9,547,682	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Niederländische Staatsanleihe 2.50%, 01/15/2030	¥6,298,666	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 1.88%, 02/28/2027	¥1,132	AA+	>1 Jahr	\$	USA

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

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

**VERWALTUNGSRAT DER
 VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

Silvio Cruz
Bertrand Reimmel
Steven Eisenberg
Eileen Koo
John Schiavetta

ANLAGEVERWALTER*

AllianceBernstein L.P.
 501 Commerce Street
 Nashville, TN 37203
 Vereinigte Staaten von Amerika

VERBUNDENE UNTERANLAGEVERWALTER

AllianceBernstein Limited
 60 London Wall
 London EC2M 5SJ
 Großbritannien

AllianceBernstein Australia Limited
 Aurora Place, Level 32F
 88 Phillip Street, 32nd Floor
 Sydney New South Wales 2000
 Australien

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

AllianceBernstein (Singapore) Ltd.
 One Raffles Quay
 #27-11 South Tower, 048583
 Singapur

AllianceBernstein (Japan) Ltd.
 Hibiya Park Front Building 14F
 2-1-6 Uchisaiwaicho, Chiyoda-ku, 14th Floor
 Tokyo 100-001
 Japan

VERWALTUNGSSTELLE* UND VERWAHRSTELLE

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

REGISTER- UND TRANSFERSTELLE

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

* Von der Verwaltungsgesellschaft delegiert.

VERTRIEBSSTELLE

AllianceBernstein Investments

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

UNABHÄNGIGER WIRTSCHAFTSPRÜFER

Ernst & Young S.A.

35E, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

RECHTSBERATER

In Luxemburg

Elvinger Hoss Prussen, société anonyme

2, place Winston Churchill
B.P. 425
L-2014 Luxemburg

In den Vereinigten Staaten

Dechert LLP

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



ALLIANCEBERNSTEIN®

ABI-SRS-SW-DA-0224